

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2022年3月8日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用) ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用) ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用) ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用) ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）  
 ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）  
 ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）  
 ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）  
 ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

（注1）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとし  
 ます。

（注2）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワTOPIXインデックス （ダイワSMA専用）	：	TOPIXインデックス
ダイワ日経225インデックス （ダイワSMA専用）	：	日経225インデックス
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）	：	外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
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）	：	外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）	：	日本債券インデックス
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）	：	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
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）	：	外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワJ-REITインデックス （ダイワSMA専用）	：	J-REITインデックス
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）	：	外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
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）	：	外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

## (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

## (3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。

## (4) 【発行（売出）価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (5) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

(6) 【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7) 【申込期間】

2022年3月9日から2022年9月8日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

< TOPIXインデックス >

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 日経225インデックス >

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	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	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
社債	その他 ( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマーシング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

## 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 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
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	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIロクサイ指数) (円ヘッジ・ベース)
資産複合 ( )	その他 ( )	中南米			
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。

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<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	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (DBI 総合指数)
社債	その他 ( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券)				
(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。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 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	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		TOPIX
債券	年6回 (隔月)	アジア		
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数 (配当込み))
社債	その他 ( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマーシング		
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。

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（注） >

## 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)			日経225
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			TOPIX
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			
不動産投信		オセアニア			
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (SSP先達国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3月9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。

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

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

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

# 2 各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行ないます。

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	TOPIXインデックス	東証株価指数 (TOPIX)	トピックス・インデックス・ マザーファンド
	日経225インデックス	日経平均株価 (日経225)	ストックインデックス225・ マザーファンド
海外の 株式	外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)	外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド
	外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数 (円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
わが国の 債券	日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数	日本債券インデックス マザーファンド
海外の 債券	外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
わが国の リート	J-REITインデックス	東証REIT指数 (配当込み)	ダイワJ-REIT マザーファンド
海外の リート	外国REITインデックス (為替ヘッジあり) <sup>(注1)</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
	外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
		—	先進国REITマザーファンド <sup>(注2)</sup>

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

(注1) 2022年3月30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」および「先進国REIT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。

(注2) 「先進国REITマザーファンド」は、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざすファンドです。

## ●各ファンドの運用方針

## TOPIXインデックス

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

◆東京証券取引所第一部上場株式<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いません。

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<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いません。

※2022年3月12日以降、「東京証券取引所上場株式」とします。

## 日経225インデックス

日経平均株価（日経225）に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行いません。

◆わが国の株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。  
投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

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

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

### 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

MSCIコクサイ指数（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。

### 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<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。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

### 日本債券インデックス

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

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

(注2) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。同モデルにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ない、ポートフォリオを効率的に構築および管理します。

### 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

### 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注3)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

### J-REITインデックス

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

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

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

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

## 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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

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

\* 2022年3月30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」および「先進国REIT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。

## 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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



## ●特定の指数について

## ◆東証株価指数（TOPIX）

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。

## ◆日経平均株価（日経225）

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所に上場する市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。

1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

## ◆MSCIコクサイ指数

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

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本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。

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

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

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

## 主な投資制限

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

**●J-REITインデックス**

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

**●外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）**

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

各ファンド\*は、特定の指数の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行いません。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。

\*「外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。

### TOPIXインデックス

### 日経225インデックス

### 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

### 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

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

\*「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」を除きます。

### 日本債券インデックス

### 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

### 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

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

\*「日本債券インデックス」を除きます。

### J-REITインデックス

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

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

### 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

## ●各マザーファンドが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「**㈱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**㈱東京証券取引所**が有します。
- **㈱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。
- **㈱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。
- **㈱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、**㈱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。
- 「TOPIXインデックス」は、**㈱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。
- **㈱東京証券取引所**は、「TOPIXインデックス」の購入者または公衆に対し、「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。
- **㈱東京証券取引所**は、当社または「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、**㈱東京証券取引所**は「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。

- 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算出する手法に対して著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 「日経」および「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- 「日経225インデックス」は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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。

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

- 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、㈩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㈩東京証券取引所が有します。
- ㈩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。
- ㈩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。
- ㈩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、㈩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。
- 「J-REITインデックス」は、㈩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。
- ㈩東京証券取引所は、「J-REITインデックス」の購入者または公衆に対し、「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。
- ㈩東京証券取引所は、当社または「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、㈩東京証券取引所は「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。「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。「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2月16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、償還金など お申込金（ 3 ）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金(3)
受託会社	<p>&lt;日経225インデックス&gt; みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社: 株式会社日本カストディ銀行</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>
受託会社	<p>&lt;上記以外の各ファンド&gt; 三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社: 株式会社日本カストディ銀行</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;TOPIX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;日経225インデックス&gt; わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄 など</p> <p>&lt;外国株式インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)&gt; 外国の株式(DR(預託証券)を含みます。) など</p> <p>&lt;日本債券インデックス&gt; わが国の公社債 など</p> <p>&lt;外国債券インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)&gt; 外国の公社債 など</p> <p>&lt;J-REIT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;外国REIT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>	

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收受します。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12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
TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券



日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの 受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
J-REITインデック ス	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
外国REITインデック ス(為替ヘッジあり) (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
外国REITインデック ス(為替ヘッジなし)	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド の受益証券および先進国REITマザーファンドの受益証券

以下、各ファンドにおいて「マザーファンド」といいます。

(注) 2022年3月30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」および「先進国REITマザーファンド」に投資します。

#### 投資態度

##### < TOPIXインデックス >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指  
数(TOPIX)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。)の  
への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないこと  
があります。

##### < 日経225インデックス >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株  
価(日経225)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。)の  
への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないこと  
があります。

##### < 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

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

#### <外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

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

#### <日本債券インデックス>

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

#### <外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

## &lt; 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## &lt; J - R E I Tインデックス &gt;

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。

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 2022年3月30日まで &gt;

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、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．保有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。

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については、先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて為替ヘッジを行ないます。

当ファンドが保有する外貨建資産ならびにダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドおよび先進国REIT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については、当ファンドにおい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、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。

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。

## &lt; 2022年3月31日から &gt;

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。）に投資し、投資成

果をベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

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

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

#### <外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

#### (2)【投資対象】

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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。

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

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

1. 株券または新株引受権証券

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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。

<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せん。）
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。

#### < J - R E I T インデックス >

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

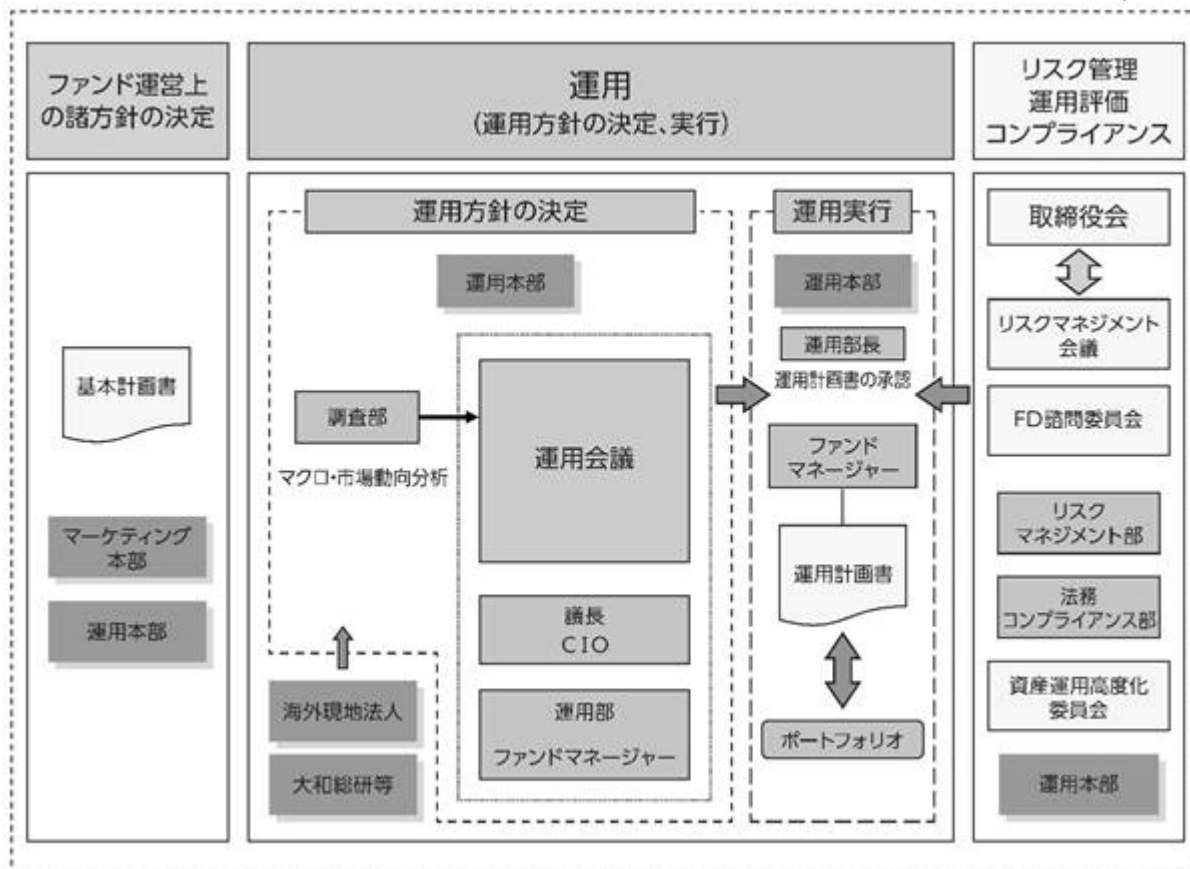
#### (3) 【運用体制】

##### < 各ファンド共通 >

##### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。





### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

#### ロ．Deputy-CIO (0～5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー (0～5名程度)

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

## 二．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12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

## (4)【分配方針】

### <各ファンド共通>

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

## (5)【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

### <各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

### <TOPIXインデックス>

### <日経225インデックス>

### <外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

### <外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

### <外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

## &lt;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;日本債券インデックス&gt;

## &lt;外国債券インデックス(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す。)の行使等により取得したものに限りま

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;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す。)の行使等により取得したものに限りま

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;J-REITインデックス&gt;

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)

## &lt;TOPIXインデックス&gt;

## &lt;日経225インデックス&gt;

## &lt;外国株式インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## &lt;外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## &lt;日本債券インデックス&gt;

## &lt;外国債券インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## &lt;外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## &lt;外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

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。

## &lt;上記以外の各ファンド&gt;

(規定なし)

## 投資信託証券（信託約款）

- < T O P I X インデックス >
- < 日経 2 2 5 インデックス >
- < 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >
- < 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >
- < 日本債券インデックス >
- < 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >
- < 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >
- < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >
- < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

- < J - R E I T 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）

- < T O P I X インデックス >
- < 日経 2 2 5 インデックス >
- < 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >
- < 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >
- < 日本債券インデックス >
- < 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >
- < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >
- < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

- < 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

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

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

< J - R E I T 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)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

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

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

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

信用取引(信託約款)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証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）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

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

< J - R E I T 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）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．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。

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．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、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

< J - R E I T インデックス >

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八．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)

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >



<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

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

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

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

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必  
要と認めるときは、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)

<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)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

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

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

< J - R E I T インデックス >

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

外貨建資産への投資は、行ないません。

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし) >

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

< J - R E I T 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)

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国 R E I T 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)

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり) >

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

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

ハ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### <参 考> マザーファンドの概要

#### トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
---------	----------------------------------------------------

主要投資対象	<p>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。</p> <p>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。</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。</p>
主な投資制限	<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 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 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>

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．投資成果を日経平均株価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。</p> <p>1．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。</p> <p>2．株式の組入比率は、高位を保ちます。</p> <p>ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均株価が改廃されたとき、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。</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>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

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
---------	-----------------------

主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</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。 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>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 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>

#### 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	<p>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。</p> <p>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。</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、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は、行ないません。</p>

#### 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	<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、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>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。</p> <p>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。</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>

## 株式

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

す。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 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。

## 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

## 主な投資制限

	<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>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 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ますものとします。</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、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J-REITマザーファンド

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	<p>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。</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号口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. 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。</p> <p>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。</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. 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。</p>
主な投資制限	<p>株式 株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p> <p>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>

## 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	<p>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>
主要投資対象	<p>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。)</p> <p>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)</p> <p>ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引</p>

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>

主な投資制限	<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>
--------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 先進国REITマザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	<p>イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。）  ロ．先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）  ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引  ニ．国内の債券</p>
投資態度	<p>イ．主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。  一部日本のリートを含む指数を対象とするETFを組入れる場合があります。  ロ．運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。  ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。  ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

主な投資制限	<p>株式</p> <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</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</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>
--------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------



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

### 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。

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 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。

<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)

(TOPIXインデックスおよび日経225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場合があります。

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスのと同内容)

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスのと同内容)

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

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <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

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <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)

(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

(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

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <外国債券インデックス(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)

(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

(外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <J-REITインデックス>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

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．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

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(J-REIT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

(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

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

<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

(J-REIT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

(外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225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(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。)その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

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

### (3)その他の留意点

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

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

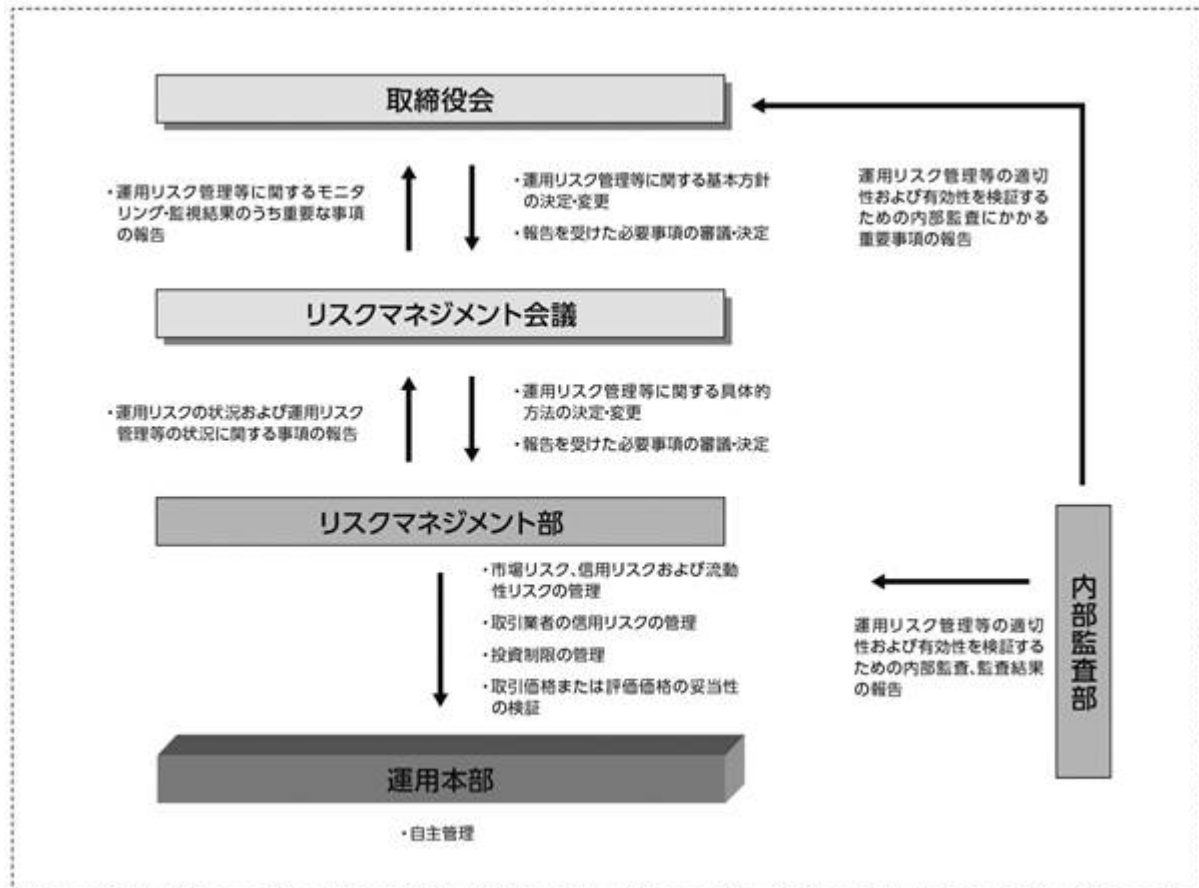
#### 流動性リスクに関する事項

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

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

### (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制( )は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

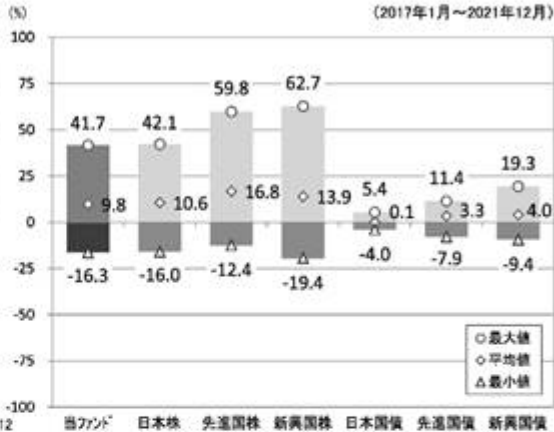
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

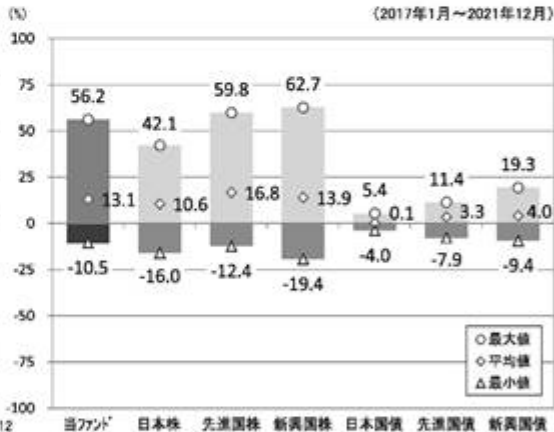
#### [TOPIXインデックス]



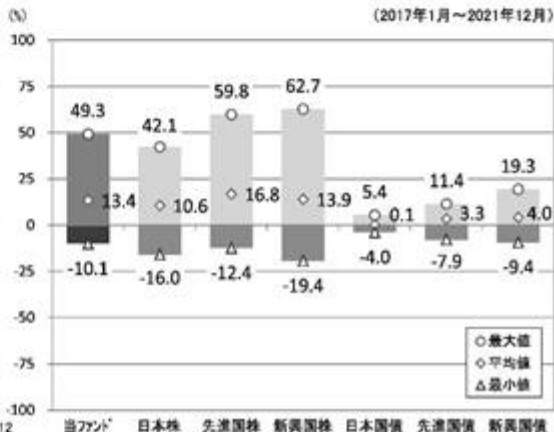
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



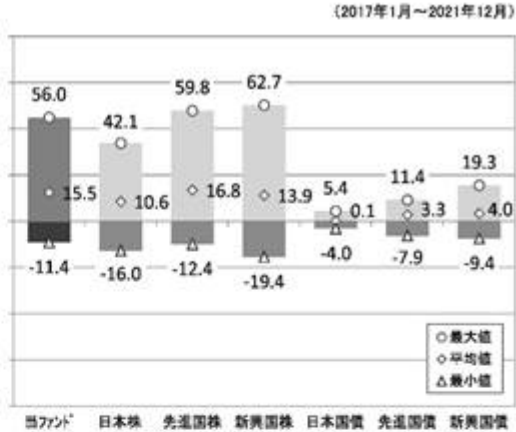
#### [日経225インデックス]



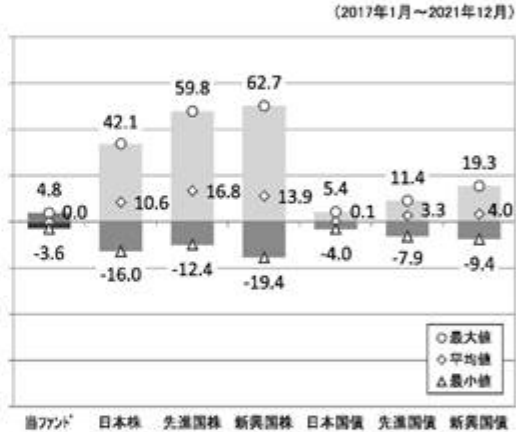
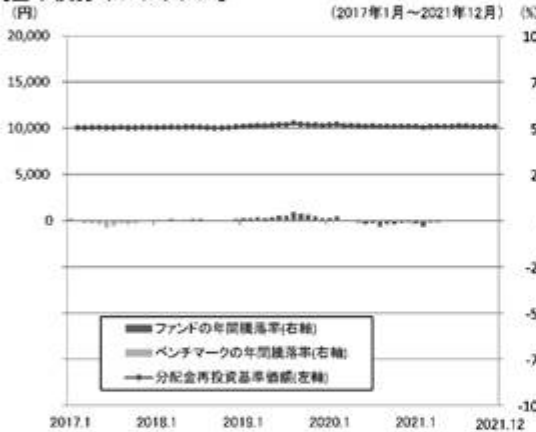
#### [外国株式インデックス（為替ヘッジあり）]



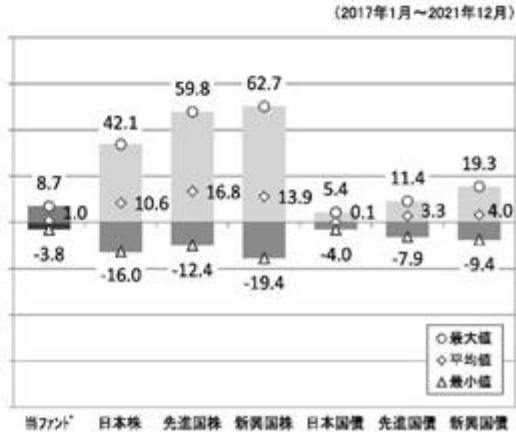
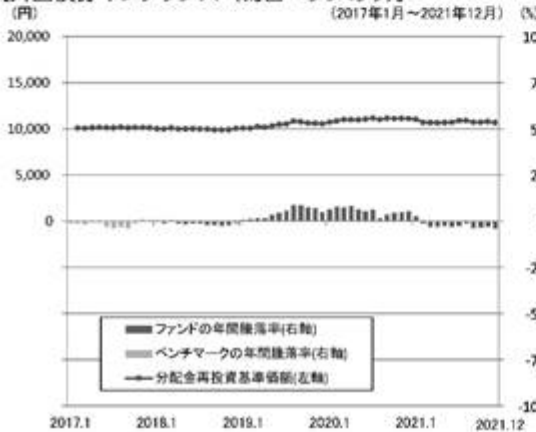
[外国株式インデックス (為替ヘッジなし)]



[日本債券インデックス]

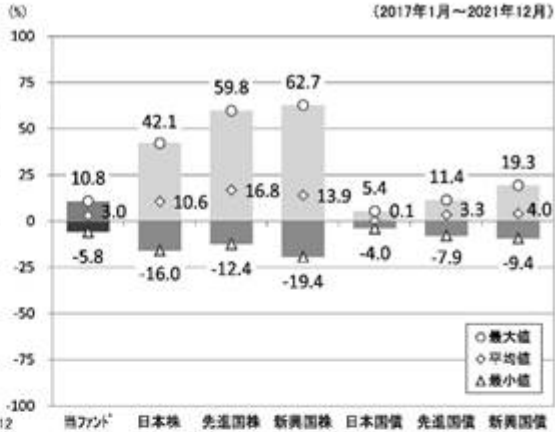
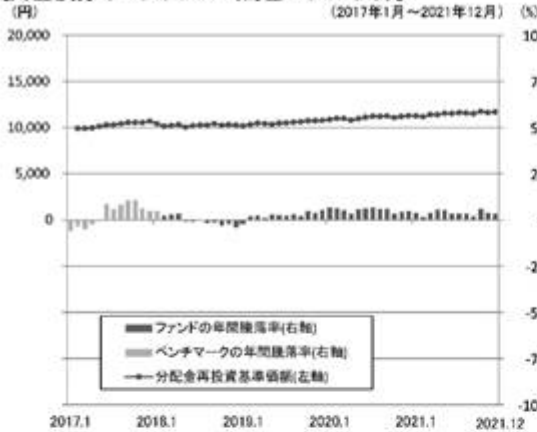


[外国債券インデックス (為替ヘッジあり)]

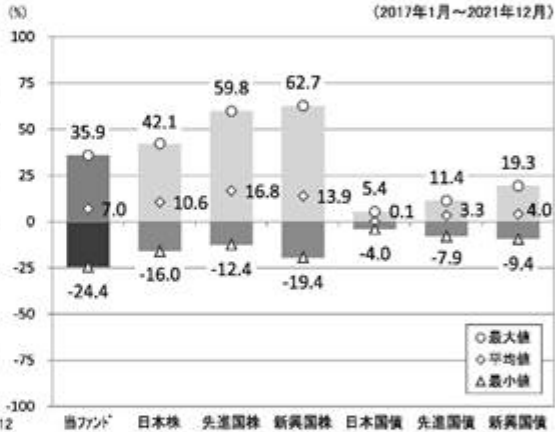
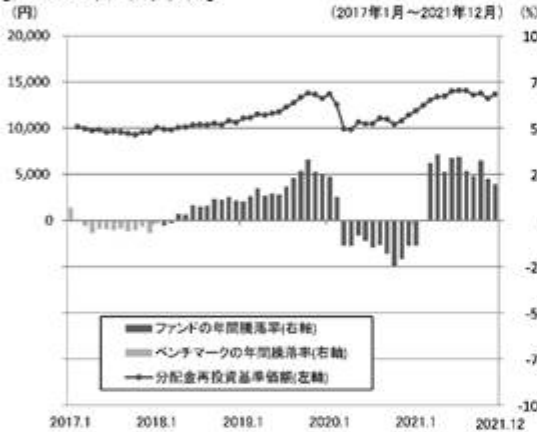




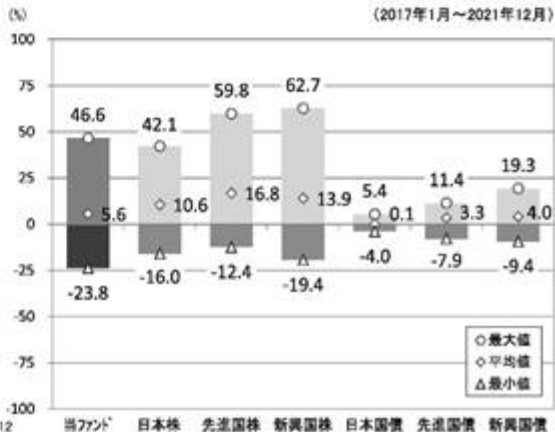
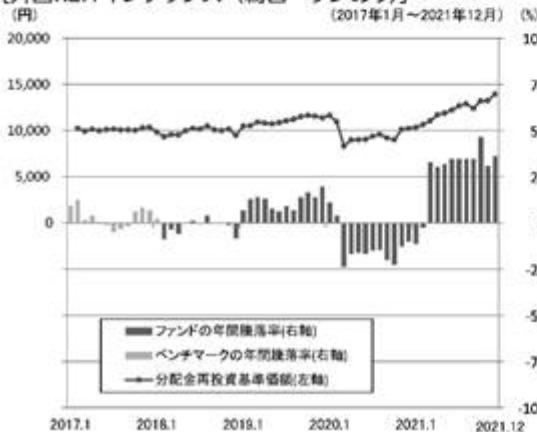
## [外国債券インデックス (為替ヘッジなし)]



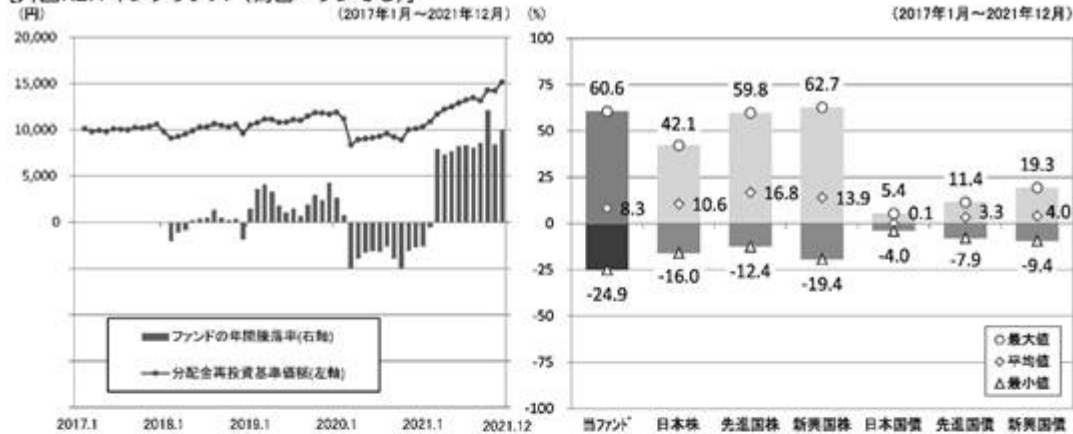
## [J-REITインデックス]



## [外国REITインデックス (為替ヘッジあり)]



## 【外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、高値など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

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

(新発10年国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.1485% (税抜0.135%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.3355% (税抜0.305%)

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。

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

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

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

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

< 日本債券インデックス >

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

< 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

## &lt; 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

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

## &lt; J - R E I Tインデックス &gt;

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

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし） &gt;

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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 E T F 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（ ）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12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

## (1)【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,283,526,118	99.99
内 日本	2,283,526,118	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	142,030	0.01
純資産総額	2,283,668,148	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12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 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	1,679,927,991	1.3290 2,232,645,086	1.3593 2,283,526,118	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6月15日)	4,156,052	4,168,187	1.0274	1.0304
第2計算期間末 (2018年6月15日)	99,679,256	100,618,182	1.1678	1.1788
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,892,823,205	1,898,380,433	1.0218	1.0248
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,083,506,949	5,183,291,476	1.0189	1.0389
2020年12月末日	1,000,790,954	-	1.2134	-
2021年1月末日	1,139,145,560	-	1.2159	-
2月末日	1,079,044,841	-	1.2536	-
3月末日	1,304,871,872	-	1.3250	-
4月末日	1,627,758,109	-	1.2871	-
5月末日	1,801,872,615	-	1.3045	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,958,666,170	3,001,224,765	1.3209	1.3399
6月末日	2,936,017,047	-	1.3009	-
7月末日	2,982,318,204	-	1.2724	-
8月末日	3,183,109,149	-	1.3121	-
9月末日	2,797,941,786	-	1.3692	-
10月末日	2,749,960,133	-	1.3495	-
11月末日	2,298,583,005	-	1.2999	-
12月末日	2,283,668,148	-	1.3451	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0030
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0200



第5計算期間	0.0190
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	14.7
第3計算期間	12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
2021年6月16日～ 2021年12月15日	1.3

## (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	3,045,067	0
第2計算期間	81,311,932	0
第3計算期間	2,042,744,740	275,692,237
第4計算期間	20,581,650,630	17,444,833,751
第5計算期間	8,768,488,999	11,517,789,316
2021年6月16日～ 2021年12月15日	660,927,562	1,220,960,774

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	186,926,529,920	98.17
内 日本	186,926,529,920	98.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,483,514,957	1.83
純資産総額	190,410,044,877	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)	3,366,480,000	1.77
内 日本	3,366,480,000	1.77

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

(注2) 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12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	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 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	3,485,200	1,987.14 6,925,614,350	2,105.50 7,338,088,600	3.85
2 ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	431,000	12,374.10 5,333,241,100	14,475.00 6,238,725,000	3.28
3 キーエンス	日本	株式	電気機 器	62,300	71,665.05 4,464,733,000	72,280.00 4,503,044,000	2.36
4 リクルートホールディング ス	日本	株式	サービ ス 業	507,200	7,006.92 3,553,910,400	6,972.00 3,536,198,400	1.86
5 東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	43,700	54,121.69 2,365,118,000	66,280.00 2,896,436,000	1.52
6 三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,250,500	632.40 2,688,040,940	624.90 2,656,137,450	1.39
7 日本電産	日本	株式	電気機 器	178,300	13,276.83 2,367,258,900	13,520.00 2,410,616,000	1.27
8 信越化学	日本	株式	化学	115,700	21,122.55 2,443,880,000	19,920.00 2,304,744,000	1.21
9 HOYA	日本	株式	精密機 器	134,200	18,399.46 2,469,207,800	17,110.00 2,296,162,000	1.21
10 ダイキン工業	日本	株式	機械	87,600	26,671.20 2,336,397,600	26,090.00 2,285,484,000	1.20
11 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	704,700	3,224.90 2,272,588,210	3,150.00 2,219,805,000	1.17
12 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	404,900	6,312.33 2,555,862,500	5,434.00 2,200,226,600	1.16

13	任天堂	日本	株式	その他 製品	38,800	52,683.29 2,044,112,000	53,650.00 2,081,620,000	1.09
14	日立	日本	株式	電気機 器	330,900	6,440.73 2,131,238,700	6,230.00 2,061,507,000	1.08
15	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	470,100	3,927.24 1,846,199,900	3,943.00 1,853,604,300	0.97
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	507,400	3,538.56 1,795,468,200	3,652.00 1,853,024,800	0.97
17	村田製作所	日本	株式	電気機 器	202,200	9,989.14 2,019,806,000	9,157.00 1,851,545,400	0.97
18	本田技研	日本	株式	輸送用 機器	542,000	3,334.71 1,807,418,200	3,230.00 1,750,660,000	0.92
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	541,000	3,744.97 2,026,031,600	3,137.00 1,697,117,000	0.89
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	473,600	3,453.10 1,635,391,700	3,518.00 1,666,124,800	0.88
21	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	492,200	3,777.96 1,859,515,400	3,362.00 1,654,776,400	0.87
22	第一三共	日本	株式	医薬品	540,700	3,016.60 1,631,080,250	2,925.00 1,581,547,500	0.83
23	SMC	日本	株式	機械	20,000	77,229.56 1,544,591,200	77,590.00 1,551,800,000	0.81
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービ ス業	77,700	17,357.44 1,348,673,500	19,395.00 1,506,991,500	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	1,022,100	1,551.67 1,585,971,600	1,454.50 1,486,644,450	0.78
26	ファナック	日本	株式	電気機 器	60,400	25,529.02 1,541,952,900	24,380.00 1,472,552,000	0.77
27	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	151,500	7,761.34 1,175,843,400	9,529.00 1,443,643,500	0.76
28	三井物産	日本	株式	卸売業	525,800	2,448.64 1,287,495,400	2,723.50 1,432,016,300	0.75
29	東京海上HD	日本	株式	保険業	223,600	6,007.19 1,343,207,800	6,392.00 1,429,251,200	0.75
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	265,200	5,120.03 1,357,834,400	5,056.00 1,340,851,200	0.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

株式	98.17%
合計	98.17%

(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。

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.23%
建設業	2.13%
食料品	3.21%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.64%
医薬品	4.71%
石油・石炭製品	0.39%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.78%
鉄鋼	0.73%
非鉄金属	0.68%
金属製品	0.63%
機械	5.45%
電気機器	19.81%
輸送用機器	7.99%
精密機器	2.86%
その他製品	2.18%
電気・ガス業	1.04%
陸運業	2.88%
海運業	0.51%
空運業	0.38%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	7.80%
卸売業	5.19%
小売業	4.02%
銀行業	4.62%
証券、商品先物取引業	0.71%
保険業	1.94%
その他金融業	1.12%
不動産業	1.78%
サービス業	6.18%

合計	98.17%
----	--------

(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 040 3月	買建	169	3,362,941,950	3,366,480,000	1.77%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●TOPIXインデックス

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,451円
純資産総額	22億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.5%
3カ月間	-1.8%
6カ月間	3.4%
1年間	12.4%
3年間	41.8%
5年間	-
設定来	41.3%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 190円 設定来分配金合計額: 560円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月					
分配金	30円	110円	30円	200円	190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

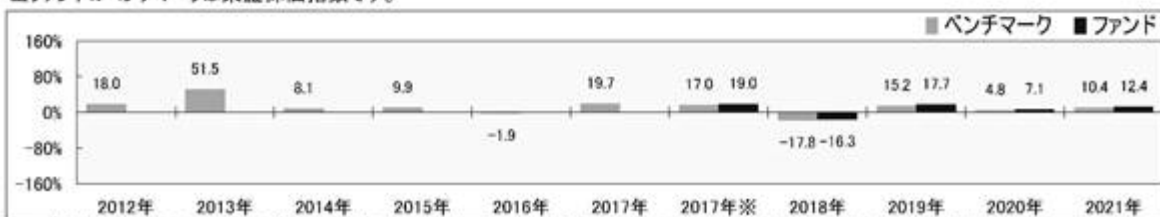
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,119	98.2%	電気機器	19.8%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.9%
国内株式先物	1	1.8%	輸送用機器	8.0%	ソニーグループ	電気機器	3.3%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.8%	キーエンス	電気機器	2.4%
コール・ローン、その他	-	1.8%	化学	6.6%	リクルートホールディングス	サービス業	1.9%
合計	2,120	-	サービス業	6.2%	TOPIX先物 0403月	-	1.8%
株式市場・上場別構成			機械	5.4%	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
一部(東証・名証)		98.2%	卸売業	5.2%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.7%	日本電産	電気機器	1.3%
新興市場他		-	銀行業	4.6%	信越化学	化学	1.2%
その他		-	その他	29.8%	HOYA	精密機器	1.2%
合計		98.2%	合計	98.2%	合計		19.7%

※先物の騰玉がある場合は、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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,927,266,366	99.98
内 日本	1,927,266,366	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	324,608	0.02
純資産総額	1,927,590,974	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12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	ストックインデックス225・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	510,520,613	3.7210 1,899,671,640	3.7751 1,927,266,366	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6月15日)	1,020,073	1,027,073	1.0201	1.0271
第2計算期間末 (2018年6月15日)	27,240,569	27,447,452	1.1850	1.1940
第3計算期間末 (2019年6月17日)	33,941,230	34,498,119	1.0971	1.1151
第4計算期間末 (2020年6月15日)	376,011,783	380,018,315	1.1262	1.1382
2020年12月末日	638,174,192	-	1.4474	-
2021年1月末日	691,545,247	-	1.4585	-
2月末日	562,429,725	-	1.5276	-
3月末日	634,612,946	-	1.5472	-
4月末日	417,702,194	-	1.5276	-
5月末日	436,960,978	-	1.5303	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	439,385,720	445,667,627	1.5388	1.5608
6月末日	433,511,122	-	1.5057	-
7月末日	410,660,596	-	1.4263	-
8月末日	422,833,052	-	1.4686	-
9月末日	653,745,254	-	1.5490	-
10月末日	703,881,602	-	1.5189	-
11月末日	884,298,207	-	1.4623	-
12月末日	1,927,590,974	-	1.5153	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0090
第3計算期間	0.0180
第4計算期間	0.0120
第5計算期間	0.0220
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-



## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	17.0
第3計算期間	5.9
第4計算期間	3.7
第5計算期間	38.6
2021年6月16日～ 2021年12月15日	2.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	21,987,038	0
第3計算期間	816,750,378	808,799,125
第4計算期間	1,970,995,928	1,668,056,539
第5計算期間	762,009,014	810,345,465
2021年6月16日～ 2021年12月15日	1,023,117,790	16,398,812

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	202,590,592,400	98.61
内 日本	202,590,592,400	98.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,859,274,011	1.39
純資産総額	205,449,866,411	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2,849,220,000	1.39
内 日本	2,849,220,000	1.39

(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12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	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	248,000	53,970.00 13,384,560,000	66,280.00 16,437,440,000	8.00
2	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	248,000	74,347.90 18,438,280,000	65,310.00 16,196,880,000	7.88
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1,488,000	6,301.43 9,376,536,000	5,434.00 8,085,792,000	3.94
4	ダイキン工業	日本	株式	機械	248,000	26,492.82 6,570,220,000	26,090.00 6,470,320,000	3.15
5	ファナック	日本	株式	電気機器	248,000	25,375.08 6,293,020,000	24,380.00 6,046,240,000	2.94
6	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	496,000	10,985.80 5,448,960,000	10,900.00 5,406,400,000	2.63
7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	744,000	6,987.88 5,198,988,000	6,972.00 5,187,168,000	2.52
8	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,488,000	3,763.48 5,600,064,000	3,362.00 5,002,656,000	2.43
9	信越化学	日本	株式	化学	248,000	20,987.86 5,204,990,000	19,920.00 4,940,160,000	2.40
10	テルモ	日本	株式	精密機器	992,000	5,279.18 5,236,952,000	4,860.00 4,821,120,000	2.35
11	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	248,000	12,381.65 3,070,650,000	14,475.00 3,589,800,000	1.75
12	京セラ	日本	株式	電気機器	496,000	6,976.37 3,460,280,000	7,187.00 3,564,752,000	1.74
13	エムスリー	日本	株式	サービス業	595,200	8,446.10 5,027,121,600	5,793.00 3,447,993,600	1.68
14	T D K	日本	株式	電気機器	744,000	4,147.60 3,085,820,000	4,490.00 3,340,560,000	1.63

15	NTTデータ	日本	株式	情報・通 信業	1,240,000	2,178.51 2,701,360,000	2,466.00 3,057,840,000	1.49
16	オムロン	日本	株式	電気機 器	248,000	11,418.30 2,831,740,000	11,460.00 2,842,080,000	1.38
17	中外製薬	日本	株式	医薬品	744,000	4,110.00 3,057,846,000	3,735.00 2,778,840,000	1.35
18	オリンパス	日本	株式	精密機 器	992,000	2,333.28 2,314,620,000	2,649.50 2,628,304,000	1.28
19	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	1,240,000	1,986.64 2,463,440,000	2,105.50 2,610,820,000	1.27
20	キッコーマン	日本	株式	食料品	248,000	9,459.91 2,346,060,000	9,670.00 2,398,160,000	1.17
21	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	248,000	7,755.12 1,923,272,000	9,529.00 2,363,192,000	1.15
22	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,240,000	1,873.10 2,322,655,000	1,870.50 2,319,420,000	1.13
23	バンダイナムコ HLDGS	日本	株式	その他 製品	248,000	8,855.99 2,196,286,000	8,994.00 2,230,512,000	1.09
24	日東電工	日本	株式	化学	248,000	8,280.80 2,053,640,000	8,890.00 2,204,720,000	1.07
25	第一三共	日本	株式	医薬品	744,000	3,009.43 2,239,017,000	2,925.00 2,176,200,000	1.06
26	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	248,000	9,633.54 2,389,118,000	8,526.00 2,114,448,000	1.03
27	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	248,000	7,384.91 1,831,460,000	8,125.00 2,015,000,000	0.98
28	セコム	日本	株式	サービ ス業	248,000	8,357.68 2,072,706,000	7,986.00 1,980,528,000	0.96
29	村田製作所	日本	株式	電気機 器	198,400	9,864.22 1,957,061,920	9,157.00 1,816,748,800	0.88
30	キーエンス	日本	株式	電気機 器	24,800	67,067.60 1,663,276,500	72,280.00 1,792,544,000	0.87

(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	98.61%
合計	98.61%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.05%
建設業	1.51%
食料品	3.61%
繊維製品	0.14%
パルプ・紙	0.08%
化学	7.58%
医薬品	6.73%
石油・石炭製品	0.19%
ゴム製品	0.71%
ガラス・土石製品	1.02%
鉄鋼	0.07%
非鉄金属	0.77%
金属製品	0.03%
機械	5.08%
電気機器	26.92%
輸送用機器	4.64%
精密機器	3.84%
その他製品	2.72%
電気・ガス業	0.13%
陸運業	1.33%
海運業	0.29%
空運業	0.03%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	10.25%
卸売業	2.20%
小売業	9.31%
銀行業	0.52%
証券、商品先物取引業	0.23%
保険業	0.70%
その他金融業	0.45%
不動産業	1.05%
サービス業	6.16%
合計	98.61%

(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	NK225先物 040 3月	買建	99	2,808,144,450	2,849,220,000	1.39%

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●日経225インデックス

2021年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

※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	15,153円
純資産総額	19億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	-2.2%
6カ月間	0.6%
1年間	6.2%
3年間	50.6%
5年間	-
設定来	60.2%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 220円 設定来分配金合計額: 680円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月					
分配金	70円	90円	180円	120円	220円					

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

## 主要な資産の状況

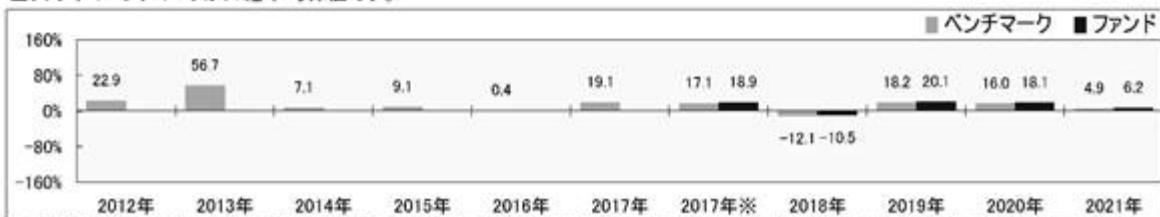
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成		銘柄数 比率		株式東証33業種別構成		組入上位10銘柄		業種名		比率	
国内株式	225	98.6%	電気機器	26.9%	東京エレクトロン	電気機器	8.0%				
国内株式先物	1	1.4%	情報・通信業	10.3%	ファーストリテイリング	小売業	7.9%				
不動産投資信託等	-	-	小売業	9.3%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.9%				
コール・ローン、その他	-	1.4%	化学	7.6%	ダイキン工業	機械	3.1%				
合計	226	-	医薬品	6.7%	ファナック	電気機器	2.9%				
株式 市場・上場別構成			サービス業	6.2%	アドバンテスト	電気機器	2.6%				
一部(東証・名証)		98.6%	機械	5.1%	リクルートホールディングス	サービス業	2.5%				
二部(東証・名証)		-	輸送用機器	4.6%	KDDI	情報・通信業	2.4%				
新興市場他		-	精密機器	3.8%	信越化学	化学	2.4%				
その他		-	その他	18.1%	テルモ	精密機器	2.3%				
合計		98.6%	合計	98.6%	合計		38.2%				

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均株価です。



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	12,743,211,661	99.99
内 日本	12,743,211,661	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,909,691	0.01
純資産総額	12,745,121,352	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12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	4,182,902,236	2.7995 11,710,335,290	3.0465 12,743,211,661	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6月15日)	3,609,633	3,630,431	1.0413	1.0473
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,333,520,140	1,345,180,653	1.1436	1.1536
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,003,717,900	3,053,452,707	1.1475	1.1665
第4計算期間末 (2020年6月15日)	7,959,510,896	8,070,496,281	1.1475	1.1635
2020年12月末日	11,569,252,394	-	1.3993	-
2021年1月末日	11,882,943,030	-	1.4157	-
2月末日	10,418,421,184	-	1.4358	-
3月末日	10,810,109,516	-	1.4814	-
4月末日	11,150,201,189	-	1.5628	-
5月末日	10,922,530,010	-	1.5699	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	11,208,379,177	11,357,996,884	1.5732	1.5942
6月末日	11,231,770,820	-	1.5857	-
7月末日	11,687,393,942	-	1.6229	-
8月末日	11,953,295,224	-	1.6605	-
9月末日	11,437,211,832	-	1.5981	-
10月末日	13,261,137,592	-	1.6807	-
11月末日	11,086,100,236	-	1.6871	-
12月末日	12,745,121,352	-	1.7336	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0060
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0190
第4計算期間	0.0160
第5計算期間	0.0210
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-



## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.7
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
2021年6月16日～ 2021年12月15日	6.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,466,456	0
第2計算期間	1,162,584,923	0
第3計算期間	3,354,512,466	1,902,942,421
第4計算期間	12,869,207,903	8,550,242,735
第5計算期間	5,926,265,855	5,738,199,717
2021年6月16日～ 2021年12月15日	2,400,464,517	2,132,902,022

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	79,827,937,366	93.41
内 香港	651,815,648	0.76
内 シンガポール	264,262,362	0.31
内 イスラエル	184,191,383	0.22
内 ノルウェー	165,469,456	0.19
内 スウェーデン	997,426,484	1.17
内 デンマーク	672,694,537	0.79
内 イギリス	3,471,434,944	4.06
内 アイルランド	162,433,484	0.19
内 オランダ	1,165,292,791	1.36

	内 ベルギー	215,092,117	0.25
	内 フランス	2,780,109,849	3.25
	内 ドイツ	2,136,562,246	2.50
	内 スイス	2,529,432,104	2.96
	内 ポルトガル	50,698,681	0.06
	内 スペイン	546,332,019	0.64
	内 イタリア	612,522,934	0.72
	内 フィンランド	256,952,262	0.30
	内 オーストリア	54,092,646	0.06
	内 カナダ	2,819,835,877	3.30
	内 アメリカ	58,562,372,784	68.53
	内 オーストラリア	1,479,336,633	1.73
	内 ニューゼaland	49,576,125	0.06
投資証券		2,032,526,172	2.38
	内 香港	31,995,405	0.04
	内 シンガポール	31,390,551	0.04
	内 イギリス	53,464,085	0.06
	内 フランス	32,655,816	0.04
	内 カナダ	11,483,882	0.01
	内 アメリカ	1,669,595,157	1.95
	内 オーストラリア	196,665,496	0.23
	内 その他	5,275,780	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,595,710,386	4.21
純資産総額		85,456,173,924	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4,881,961,066	5.71
内 イギリス	228,684,044	0.27
内 ドイツ	640,388,057	0.75
内 カナダ	162,511,395	0.19
内 アメリカ	3,742,129,692	4.38
内 オーストラリア	108,247,878	0.13
為替予約取引(売建)	80,796,076,678	94.55
内 日本	80,796,076,678	94.55

(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12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	199,715	14,904.29 2,976,614,958	20,632.28 4,120,577,318	4.82
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	86,166	25,290.25 2,179,167,993	39,331.08 3,389,002,615	3.97
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	5,505	362,027.17 1,992,959,922	389,229.98 2,142,711,042	2.51
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	10,186	93,360.46 950,970,005	124,933.57 1,272,573,383	1.49
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	207,795.70 754,506,422	337,365.16 1,224,972,903	1.43
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,469	205,075.48 711,407,040	337,018.95 1,169,118,744	1.37
7	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	28,743	29,844.12 857,812,905	39,444.95 1,133,766,451	1.33
8	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	30,067	15,999.97 481,072,574	34,507.15 1,037,526,485	1.21
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,428	41,643.91 475,907,283	58,151.81 664,558,903	0.78

10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	35,951	15,933.72 572,837,047	18,237.57 655,658,922	0.77
11	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,789	18,368.92 583,930,800	19,731.68 627,250,407	0.73
12	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,845	31,334.78 402,495,604	47,254.81 606,988,122	0.71
13	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	34,292	12,714.58 436,012,884	16,140.03 553,474,197	0.65
14	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	29,125	15,866.77 462,120,605	18,885.13 550,029,522	0.64
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	15,959	26,849.11 428,485,084	34,443.88 549,690,028	0.64
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	20,264	24,539.17 497,262,963	25,093.91 508,503,061	0.60
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	92,634	3,826.71 354,492,634	5,133.34 475,522,058	0.56
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,916	55,538.00 273,025,090	91,813.78 451,356,567	0.53
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	66,999	4,371.22 292,872,830	6,622.85 443,724,434	0.52
20	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	10,604	40,044.55 424,632,834	41,555.57 440,655,326	0.52
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	8,388	39,344.01 330,017,606	47,901.98 401,801,842	0.47
22	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	20,604.79 448,383,325	17,813.14 387,631,901	0.45
23	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	4,879	51,496.63 251,252,289	77,363.60 377,457,015	0.44
24	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,719	55,408.69 316,882,842	65,479.73 374,478,609	0.44
25	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	5,301	57,655.27 305,631,058	70,224.31 372,259,072	0.44
26	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	50,501	5,270.56 266,171,633	7,356.67 371,519,656	0.43

27	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,519	5,387.53 277,560,508	7,033.47 362,357,495	0.42
28	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	7,559	30,256.58 228,710,059	47,781.60 361,181,178	0.42
29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,690	59,211.37 277,701,740	76,227.20 357,505,590	0.42
30	ABBOTT LABORATORIES	アメリカ	株式	ヘルスケア	21,242	12,808.74 272,084,368	16,239.67 344,963,151	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.41%
投資証券	2.38%
合計	95.79%

(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	3.95%
資本財・サービス	8.94%
一般消費財・サービス	11.32%
生活必需品	6.59%
ヘルスケア	12.27%
金融	12.86%
情報技術	23.26%
コミュニケーション・サービス	8.01%
公益事業	2.71%
不動産	0.38%
合計	93.41%

(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 202203	買建	136	3,641,022,454	3,742,129,692	4.38%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202203	買建	20	224,013,649	228,684,044	0.27%
	オーストラ リア	SPI 200 FUTURES 202203	買建	7	106,371,470	108,247,878	0.13%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202203	買建	7	157,483,337	162,511,395	0.19%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202203	買建	9	141,236,937	144,875,520	0.17%
		EURO STOXX 50 202203	買建	89	486,089,585	495,512,537	0.58%
為替予約取引	日本	香港ドル売/円買 2022年 1月	売建	46,013,000	667,947,714	678,691,750	0.79%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2022年1月	売建	13,250,800	165,705,229	173,271,436	0.20%
		ユーロ売/円買 2022年1 月	売建	59,811,200	7,678,831,006	7,807,532,746	9.14%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2022年1月	売建	74,574,900	937,294,630	950,367,610	1.11%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2022年1月	売建	37,378,500	645,160,385	656,366,460	0.77%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2022年1月	売建	669,400	51,691,871	52,662,568	0.06%
		スイス・フラン売/円買 2022年1月	売建	19,191,000	2,364,582,602	2,414,035,890	2.82%
		豪ドル売/円買 2022年1 月	売建	19,798,300	1,599,540,976	1,651,574,186	1.93%
		米ドル売/円買 2022年1 月	売建	519,989,400	58,843,215,058	59,803,356,906	69.98%
		イスラエル・シケル 売/円買 2022年1月	売建	3,081,700	111,030,569	113,530,444	0.13%
		カナダ・ドル売/円買 2022年1月	売建	31,201,800	2,766,811,644	2,809,060,611	3.29%
		英ポンド売/円買 2022年 1月	売建	22,116,200	3,330,990,376	3,432,987,145	4.02%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2022年1月	売建	2,967,900	246,096,784	252,638,926	0.30%

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

- (注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。
- (注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
- (注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	17,336円
純資産総額	127億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	8.5%
6カ月間	9.3%
1年間	25.5%
3年間	80.0%
5年間	-
設定来	83.7%



※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: 210円 設定来分配金合計額: 720円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月					
分配金	60円	100円	190円	160円	210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	相入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,233	99.1%	日本円	97.1%	情報技術	23.3%	APPLE INC	アメリカ	4.8%
外国リート	56	2.3%	米ドル	1.9%	金融	12.9%	S&P500 EMINI FUT 202203	アメリカ	4.4%
外国投資証券	6	0.1%	ユーロ	0.4%	ヘルスケア	12.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.0%
			英ポンド	0.2%	一般消費財・サービス	11.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.5%
コール・ローン、その他		4.2%	スイス・フラン	0.2%	資本財・サービス	8.9%	TESLA INC	アメリカ	1.5%
合計	1,295	-	豪ドル	0.1%	コミュニケーション・サービス	8.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	0.1%	生活必需品	6.6%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
アメリカ		74.9%	カナダ・ドル	0.1%	素材	3.9%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
イギリス		4.4%	デンマーク・クローネ	0.0%	エネルギー	3.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.2%
その他		22.2%	その他	0.0%	公益事業、他	3.1%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.8%
合計		101.5%	合計		合計		合計		23.3%

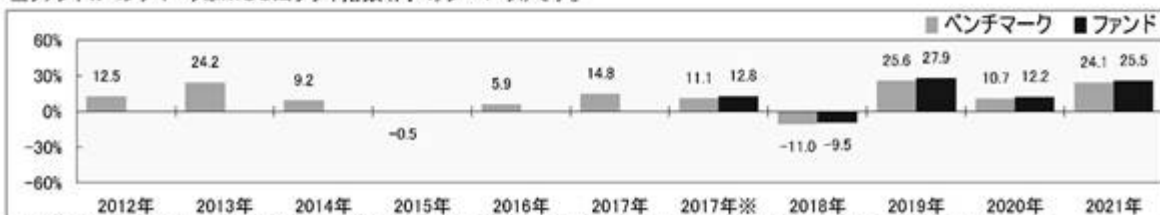
※株式業種別構成は、原則としてS&P/MSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIロクサイ指数(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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】



## (1) 【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,364,271,095	99.99
内 日本	7,364,271,095	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	648,865	0.01
純資産総額	7,364,919,960	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12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	1,721,589,465	3.8005 6,542,900,937	4.2776 7,364,271,095	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6月15日)	1,009,377	1,019,377	1.0094	1.0194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,127,308	1,149,308	1.1273	1.1493
第3計算期間末 (2019年6月17日)	16,536,717	16,580,596	1.1306	1.1336
第4計算期間末 (2020年6月15日)	223,479,606	223,479,606	1.1489	1.1489
2020年12月末日	4,411,344,199	-	1.3853	-
2021年1月末日	4,409,573,226	-	1.4134	-
2月末日	4,562,184,543	-	1.4611	-
3月末日	4,826,582,775	-	1.5583	-
4月末日	4,715,160,226	-	1.6307	-
5月末日	10,214,275,644	-	1.6542	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	10,845,036,190	10,935,990,992	1.6693	1.6833
6月末日	10,731,692,129	-	1.6806	-
7月末日	10,941,124,180	-	1.7037	-
8月末日	11,167,579,156	-	1.7452	-
9月末日	10,718,686,778	-	1.7041	-
10月末日	10,010,471,073	-	1.8281	-
11月末日	7,928,526,515	-	1.8205	-
12月末日	7,364,919,960	-	1.8943	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0220
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0140
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
2021年6月16日～ 2021年12月15日	8.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	13,626,454	0
第4計算期間	15,442,007,002	15,262,119,439
第5計算期間	9,570,631,213	3,268,373,640
2021年6月16日～ 2021年12月15日	1,665,637,161	3,812,908,535

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	245,473,913,174	92.81
内 香港	2,023,469,833	0.77
内 シンガポール	828,318,240	0.31
内 イスラエル	567,442,589	0.21
内 ノルウェー	511,312,093	0.19
内 スウェーデン	3,092,622,522	1.17
内 デンマーク	2,069,437,747	0.78
内 イギリス	10,674,406,453	4.04
内 アイルランド	501,695,448	0.19
内 オランダ	3,536,705,653	1.34

	内 ベルギー	640,414,757	0.24
	内 フランス	8,411,255,332	3.18
	内 ドイツ	6,435,905,529	2.43
	内 スイス	7,605,587,539	2.88
	内 ポルトガル	142,184,903	0.05
	内 スペイン	1,617,053,444	0.61
	内 イタリア	1,804,288,374	0.68
	内 フィンランド	744,846,176	0.28
	内 オーストリア	171,466,778	0.06
	内 カナダ	8,554,471,365	3.23
	内 アメリカ	181,014,244,554	68.44
	内 オーストラリア	4,364,713,487	1.65
	内 ニューゼーランド	162,070,358	0.06
投資証券		6,231,246,234	2.36
	内 香港	92,187,574	0.03
	内 シンガポール	96,233,703	0.04
	内 イギリス	156,586,074	0.06
	内 フランス	97,130,240	0.04
	内 カナダ	27,550,349	0.01
	内 アメリカ	5,188,687,721	1.96
	内 オーストラリア	551,457,113	0.21
	内 その他	21,413,460	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,789,568,363	4.84
純資産総額		264,494,727,771	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	12,772,511,707	4.83
内 イギリス	583,144,312	0.22
内 ドイツ	2,289,347,346	0.87
内 カナダ	557,181,926	0.21
内 アメリカ	8,832,526,700	3.34
内 オーストラリア	510,311,423	0.19
為替予約取引(買建)	5,882,992,418	2.22
内 日本	5,882,992,418	2.22

(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12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	617,100	18,441.61 11,380,355,883	20,632.28 12,732,184,678	4.81
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	266,600	38,700.89 10,317,679,087	39,331.08 10,485,668,327	3.96
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	17,010	409,452.79 6,964,792,384	389,229.98 6,620,801,967	2.50
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	31,370	130,826.50 4,104,027,619	124,933.57 3,919,166,210	1.48
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	11,220	334,539.92 3,753,539,239	337,365.16 3,785,237,118	1.43
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,737	335,979.40 3,607,411,247	337,018.95 3,618,572,485	1.37
7	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	88,900	38,845.01 3,453,331,380	39,444.95 3,506,656,837	1.33
8	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	93,380	38,363.19 3,582,359,873	34,507.15 3,222,277,686	1.22
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	35,116	51,966.03 1,824,842,794	58,151.81 2,042,059,016	0.77

10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	111,270	18,540.87 2,063,053,596	18,237.57 2,029,294,547	0.77
11	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	98,100	18,362.82 1,801,393,666	19,731.68 1,935,677,906	0.73
12	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	39,350	46,777.82 1,840,711,873	47,254.81 1,859,477,041	0.70
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	90,567	17,129.58 1,551,375,652	18,885.13 1,710,369,913	0.65
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	49,450	32,441.85 1,604,250,882	34,443.88 1,703,250,321	0.64
15	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	102,700	15,103.77 1,551,157,795	16,140.03 1,657,581,944	0.63
16	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	62,950	22,569.45 1,420,748,721	25,093.91 1,579,661,849	0.60
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	282,401	5,242.38 1,480,460,559	5,133.34 1,449,661,084	0.55
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	15,110	91,979.01 1,389,804,773	91,813.78 1,387,306,291	0.52
19	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	208,913	6,031.30 1,260,022,614	6,622.85 1,383,599,796	0.52
20	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	32,800	37,131.33 1,217,908,593	41,555.57 1,363,022,886	0.52
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	25,650	44,966.36 1,153,388,049	47,901.98 1,228,685,890	0.46
22	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	67,762	16,991.67 1,151,395,198	17,813.14 1,207,054,494	0.46
23	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	15,262	64,874.15 990,111,090	77,363.60 1,180,723,297	0.45
24	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	17,770	79,023.68 1,404,252,012	65,479.73 1,163,574,905	0.44
25	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	16,490	76,290.58 1,258,032,515	70,224.31 1,157,998,885	0.44
26	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	157,250	6,410.63 1,008,075,192	7,356.67 1,156,837,804	0.44

27	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	23,600	42,054.07 992,476,122	47,781.60 1,127,645,958	0.43
28	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	14,660	74,568.96 1,093,182,010	76,227.20 1,117,490,819	0.42
29	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	158,105	7,078.33 1,119,128,146	7,033.47 1,112,027,249	0.42
30	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	16,460	63,778.93 1,049,802,355	65,304.90 1,074,918,743	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.81%
投資証券	2.36%
合計	95.16%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.12%
素材	3.88%
資本財・サービス	8.88%
一般消費財・サービス	11.21%
生活必需品	6.55%
ヘルスケア	12.18%
金融	12.73%
情報技術	23.22%
コミュニケーション・サービス	7.98%
公益事業	2.70%
不動産	0.37%
合計	92.81%

(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 202203	買建	321	8,611,460,215	8,832,526,700	3.34%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202203	買建	51	570,911,439	583,144,312	0.22%
	オーストラ リア	SPI 200 FUTURES 202203	買建	33	501,854,595	510,311,423	0.19%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202203	買建	24	540,798,788	557,181,926	0.21%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202203	買建	35	549,100,072	563,404,800	0.21%
		EURO STOXX 50 202203	買建	310	1,694,449,504	1,725,942,546	0.65%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	7,840,000	1,006,938,702	1,023,404,592	0.39%
		スイス・フラン買/円売 2022年1月	買建	2,650,000	326,757,654	333,343,500	0.13%
		豪ドル買/円売 2022年1 月	買建	3,850,000	312,060,385	321,167,000	0.12%
		カナダ・ドル買/円売 2022年1月	買建	3,770,000	334,813,793	339,408,576	0.13%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	31,250,000	3,548,007,895	3,594,025,000	1.36%
		英ポンド買/円売 2022年 1月	買建	1,750,000	263,919,557	271,643,750	0.10%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績



## ●外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	18,943円
純資産総額	73億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.1%
3カ月間	11.2%
6カ月間	12.7%
1年間	37.9%
3年間	92.4%
5年間	-
設定来	97.2%



※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: 140円 設定来分配金合計額: 490円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月					
分配金	100円	220円	30円	0円	140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

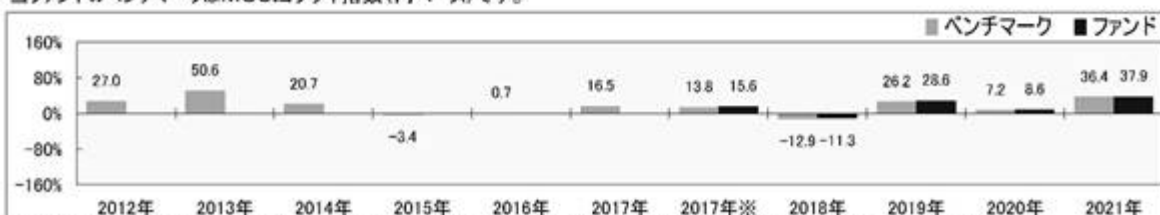
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	相入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,233	97.6%	米ドル	73.9%	情報技術	23.2%	APPLE INC	アメリカ	4.8%
外国リート	56	2.3%	ユーロ	9.7%	金融	12.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.0%
外国投資証券	6	0.1%	英ポンド	4.3%	ヘルスケア	12.2%	S&P500 EMINI FUT 202203	アメリカ	3.3%
			カナダ・ドル	3.4%	一般消費財・サービス	11.2%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.5%
コール・ローン、その他		4.8%	スイス・フラン	3.1%	資本財・サービス	8.9%	TESLA INC	アメリカ	1.5%
合計	1,295	-	豪ドル	2.0%	コミュニケーション・サービス	8.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	1.2%	生活必需品	6.5%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
アメリカ		73.7%	デンマーク・クローネ	0.8%	素材	3.9%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
イギリス		4.3%	香港ドル	0.8%	エネルギー	3.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.2%
その他		21.9%	その他	0.7%	公益事業、他	3.1%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.8%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	92.8%	合計		22.2%

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

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIロウサイ指数(円ベース)です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。  
 ・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。  
 ・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】 (2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	13,508,126,519	99.90
内 日本	13,508,126,519	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,480,739	0.10
純資産総額	13,521,607,258	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12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	9,534,923,780	1.4191 13,531,767,984	1.4167 13,508,126,519	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6月15日)	24,087,488	24,087,488	1.0065	1.0065
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,326,560	279,326,560	1.0124	1.0124
第3計算期間末 (2019年6月17日)	5,116,892,737	5,116,892,737	1.0363	1.0363
第4計算期間末 (2020年6月15日)	18,594,655,554	18,594,655,554	1.0235	1.0235
2020年12月末日	5,307,150,910	-	1.0203	-
2021年1月末日	5,649,071,924	-	1.0176	-
2月末日	5,239,728,965	-	1.0089	-
3月末日	5,842,630,984	-	1.0160	-
4月末日	5,743,435,266	-	1.0177	-
5月末日	5,630,321,136	-	1.0181	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,774,922,588	5,774,922,588	1.0197	1.0197
6月末日	5,758,051,858	-	1.0185	-
7月末日	6,020,774,674	-	1.0234	-
8月末日	6,074,597,206	-	1.0224	-
9月末日	6,801,818,065	-	1.0187	-
10月末日	6,867,159,540	-	1.0175	-
11月末日	8,633,640,954	-	1.0198	-
12月末日	13,521,607,258	-	1.0173	-

## 【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
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	0.4
2021年6月16日～ 2021年12月15日	0.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	22,931,206	0
第2計算期間	251,969,341	0
第3計算期間	8,652,065,532	3,990,278,317
第4計算期間	32,014,941,813	18,784,692,054
第5計算期間	8,663,614,937	21,168,152,589
2021年6月16日～ 2021年12月15日	7,978,866,904	332,717,995

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	89,116,037,210	90.31
内 日本	89,116,037,210	90.31
地方債証券	3,506,595,300	3.55
内 日本	3,506,595,300	3.55
特殊債証券	2,697,343,300	2.73
内 日本	2,697,343,300	2.73
社債券	3,070,966,300	3.11
内 日本	3,070,966,300	3.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	292,070,196	0.30
純資産総額	98,683,012,306	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12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	100.29 1,554,526,000	100.23 1,553,642,500	0.100000 2023/03/20	1.57
2	349 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	101.19 1,366,098,000	101.01 1,363,729,500	0.100000 2027/12/20	1.38
3	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.47 1,205,676,000	100.40 1,204,824,000	0.100000 2023/12/20	1.22
4	140 5年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	100.56 1,156,515,000	100.48 1,155,520,000	0.100000 2024/06/20	1.17
5	141 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.63 1,127,078,400	100.52 1,125,924,800	0.100000 2024/09/20	1.14
6	147 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.47 1,125,294,520	100.37 1,124,244,800	0.005000 2026/03/20	1.14
7	145 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.82 1,109,031,000	100.72 1,107,975,000	0.100000 2025/09/20	1.12
8	351 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.22 1,012,242,000	101.03 1,010,370,000	0.100000 2028/06/20	1.02
9	357 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.25 1,012,522,400	101.03 1,010,370,000	0.100000 2029/12/20	1.02
10	148 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.50 1,005,020,000	100.40 1,004,020,000	0.005000 2026/06/20	1.02
11	146 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.85 988,354,200	100.75 987,389,200	0.100000 2025/12/20	1.00
12	361 10年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.85 988,414,730	100.71 987,007,000	0.100000 2030/12/20	1.00
13	139 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.52 955,023,000	100.44 954,199,000	0.100000 2024/03/20	0.97
14	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.35 953,391,500	100.29 952,764,500	0.100000 2023/06/20	0.97
15	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.85 916,695,000	101.71 915,399,000	0.600000 2024/06/20	0.93

16	345	10年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.01 909,135,000	100.92 908,289,000	0.100000 2026/12/20	0.92
17	360	10年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.01 909,117,000	100.82 907,443,000	0.100000 2030/09/20	0.92
18	144	5年国債	日本	国債証券	890,000,000	100.78 896,977,600	100.71 896,327,900	0.100000 2025/06/20	0.91
19	359	10年国債	日本	国債証券	880,000,000	101.11 889,796,720	100.93 888,192,800	0.100000 2030/06/20	0.90
20	342	10年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.90 887,981,600	100.78 886,864,000	0.100000 2026/03/20	0.90
21	142	5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.68 855,856,500	100.57 854,913,000	0.100000 2024/12/20	0.87
22	364	10年国債	日本	国債証券	830,000,000	100.43 833,633,800	100.28 832,398,700	0.100000 2031/09/20	0.84
23	137	5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.42 803,392,000	100.34 802,736,000	0.100000 2023/09/20	0.81
24	346	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.06 788,307,000	100.94 787,332,000	0.100000 2027/03/20	0.80
25	344	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.96 787,527,000	100.85 786,630,000	0.100000 2026/09/20	0.80
26	343	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.96 787,488,000	100.82 786,450,600	0.100000 2026/06/20	0.80
27	340	10年国債	日本	国債証券	760,000,000	101.98 775,093,600	101.84 773,999,200	0.400000 2025/09/20	0.78
28	362	10年国債	日本	国債証券	710,000,000	100.74 715,268,200	100.59 714,231,600	0.100000 2031/03/20	0.72
29	333	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.67 711,697,000	101.53 710,752,000	0.600000 2024/03/20	0.72
30	352	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.26 708,855,000	101.04 707,301,000	0.100000 2028/09/20	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．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	90.31%
地方債証券	3.55%
特殊債券	2.73%
社債券	3.11%
合計	99.70%

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

#### 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

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

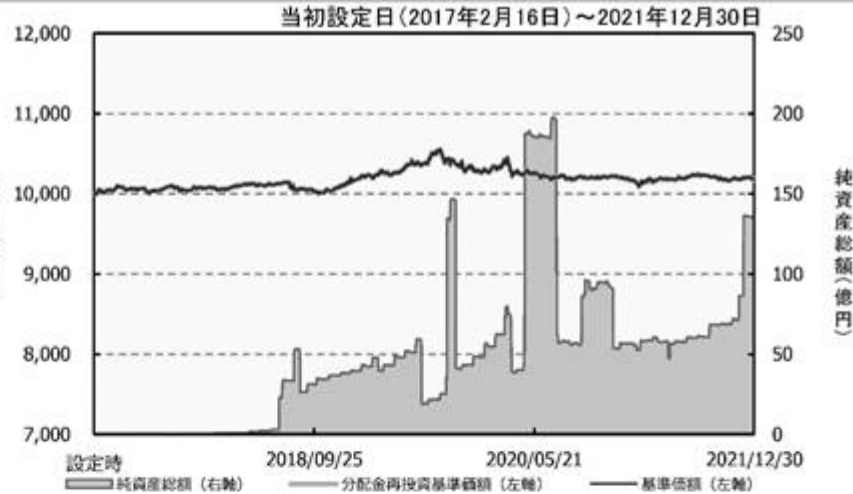
## ●日本債券インデックス

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,173円
純資産総額	135億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	-0.1%
6カ月間	-0.1%
1年間	-0.3%
3年間	0.2%
5年間	-
設定来	1.7%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円					設定来分配金合計額: 0円				
	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月					
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	342	99.6%	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(%)	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.4%	
コール・ローン、その他		0.4%	修正デュレーション	138 5年国債	0.100	2023/12/20	1.2%	
合計	342	100.0%	残存年数	140 5年国債	0.100	2024/06/20	1.2%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率	141 5年国債	0.100	2024/09/20	1.1%
国債		90.0%	AAA	92.4%	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.1%
地方債		4.3%	AA	3.9%	145 5年国債	0.100	2025/09/20	1.1%
事業債		3.7%	A	2.1%	351 10年国債	0.100	2028/06/20	1.0%
政府保証債		1.2%	BBB	-	357 10年国債	0.100	2029/12/20	1.0%
その他		0.3%	BB以下・無格付	1.6%	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.0%
合計		99.6%	合計	100.0%	合計			11.8%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.6%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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】



## (1) 【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	17,492,999,413	99.71
内 日本	17,492,999,413	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	51,443,727	0.29
純資産総額	17,544,443,140	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（2021年12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	16,872,105,916	1.0437 17,610,598,963	1.0368 17,492,999,413	99.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【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6月15日)	20,274,657	20,274,657	1.0212	1.0212
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,398,757,675	1,398,757,675	0.9966	0.9966
第3計算期間末 (2019年6月17日)	12,750,079,921	12,750,079,921	1.0418	1.0418
第4計算期間末 (2020年6月15日)	22,300,327,697	22,300,327,697	1.0992	1.0992
2020年12月末日	12,612,198,027	-	1.1094	-
2021年1月末日	12,575,344,343	-	1.1024	-
2月末日	11,770,249,757	-	1.0692	-
3月末日	12,371,957,710	-	1.0670	-
4月末日	13,131,928,797	-	1.0655	-
5月末日	7,927,972,911	-	1.0672	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	8,180,398,456	8,180,398,456	1.0724	1.0724
6月末日	8,216,174,383	-	1.0709	-
7月末日	8,988,942,116	-	1.0891	-
8月末日	9,300,306,023	-	1.0889	-
9月末日	9,274,772,994	-	1.0714	-
10月末日	10,469,297,752	-	1.0706	-
11月末日	13,037,139,255	-	1.0769	-
12月末日	17,544,443,140	-	1.0668	-

## 【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
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	2.4
2021年6月16日～ 2021年12月15日	0.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	18,852,947	0
第2計算期間	1,383,614,307	0
第3計算期間	14,932,722,296	4,098,050,663
第4計算期間	31,728,087,266	23,677,730,208
第5計算期間	7,679,681,362	20,339,945,076
2021年6月16日～ 2021年12月15日	9,330,481,080	460,408,630

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	136,463,899,629	99.92
内 ユーロ	52,602,672,580	38.52
内 中国	565,888,047	0.41
内 シンガポール	555,838,697	0.41
内 マレーシア	610,342,100	0.45
内 イスラエル	604,886,820	0.44
内 ノルウェー	303,474,614	0.22
内 スウェーデン	350,998,813	0.26
内 デンマーク	624,241,656	0.46
内 イギリス	8,261,775,922	6.05

	内 ポーランド	629,046,311	0.46
	内 カナダ	2,681,369,966	1.96
	内 アメリカ	65,516,650,391	47.97
	内 メキシコ	877,100,903	0.64
	内 オーストラリア	2,279,612,809	1.67
	コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	102,999,064	0.08
	純資産総額	136,566,898,693	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)	139,648,755,235	102.26
内 日本	139,648,755,235	102.26

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

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

(注3) 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12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	50,520,000	102.28 5,943,873,334	101.66 5,907,676,609	1.750000 2023/05/15	4.33
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	25,405,000	105.30 3,077,107,743	103.79 3,032,888,491	2.750000 2023/11/15	2.22
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	19,800,000	106.27 2,420,371,992	104.06 2,369,903,825	2.250000 2025/11/15	1.74
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	16,000,000	107.30 1,974,770,007	104.78 1,928,452,924	2.250000 2027/08/15	1.41
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,800,000	107.13 1,946,969,191	104.47 1,898,659,064	2.500000 2025/01/31	1.39
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,300,000	105.33 1,853,659,151	103.39 1,819,604,207	2.125000 2025/05/15	1.33
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,000,000	106.66 1,840,325,751	104.17 1,797,331,275	2.750000 2024/02/15	1.32
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	14,850,000	105.00 1,793,465,368	103.35 1,765,420,298	2.000000 2026/11/15	1.29

9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,820,000	105.75 1,802,730,014	103.11 1,757,728,669	2.000000 2025/08/15	1.29
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,700,000	105.50 1,783,882,708	103.13 1,743,817,299	2.125000 2024/07/31	1.28
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	13,310,000	104.96 1,606,912,331	102.99 1,576,782,449	2.500000 2023/08/15	1.15
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,810,000	105.83 1,559,337,981	103.60 1,526,522,493	2.250000 2024/11/15	1.12
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	111.04 1,532,729,231	109.12 1,506,131,690	2.875000 2028/08/15	1.10
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	104.14 1,437,437,145	101.61 1,402,558,480	1.625000 2026/02/15	1.03
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	102.47 1,414,453,419	101.21 1,396,996,113	1.375000 2023/09/30	1.02
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,750,000	103.46 1,398,247,103	101.12 1,366,689,206	1.500000 2026/08/15	1.00
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,950,000	130.92 1,347,756,281	126.99 1,307,292,475	6.125000 2027/11/15	0.96
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,000,000	103.08 1,304,214,080	101.75 1,287,361,350	2.000000 2023/02/15	0.94
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,865,000	103.84 1,297,777,154	101.60 1,269,799,849	1.625000 2026/05/15	0.93
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,300,000	112.80 1,206,660,876	111.11 1,188,602,992	3.125000 2028/11/15	0.87
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,800,000	84.58 1,148,018,070	86.92 1,179,723,103	1.125000 2040/05/15	0.86
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,580,000	106.42 1,172,688,135	103.87 1,144,545,823	2.500000 2024/05/15	0.84
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,550,000	106.79 1,050,267,414	105.45 1,037,046,947	2.375000 2027/05/15	0.76
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	111.26 934,201,648	108.84 913,895,895	2.875000 2028/05/15	0.67
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,700,000	98.39 871,398,665	97.54 863,884,624	1.250000 2031/08/15	0.63
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	105.16 846,731,462	102.69 826,838,523	1.875000 2026/06/30	0.61
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	104.78 843,633,743	102.51 825,357,065	1.875000 2024/08/31	0.60

28	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,140,000	119.06 798,706,541	116.90 784,190,216	3.500000 2026/04/25	0.57
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,900,000	94.74 751,940,259	94.88 753,019,607	0.875000 2030/11/15	0.55
30	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債 証券	4,750,000	121.16 751,155,525	117.54 728,694,101	4.500000 2026/03/01	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	99.92%
合計	99.92%

(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 2022年 1月	売建	55,813,000	8,384,334,392	8,663,851,990	6.34%
		マレーシア・リングギ ット 売/円買 2022年1月	売建	21,580,000	591,492,694	593,851,388	0.43%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2022年1月	売建	23,416,000	640,659,418	664,679,551	0.49%
		カナダ・ドル売/円買 2022年1月	売建	29,760,000	2,632,651,830	2,679,367,200	1.96%
		イスラエル・シユケル 売/円買 2022年1月	売建	17,054,000	615,013,285	628,283,003	0.46%
		メキシコ・ペソ売/円買 2022年1月	売建	163,594,000	857,019,887	913,034,473	0.67%
		米ドル売/円買 2022年1 月	売建	579,404,000	65,715,797,257	66,638,702,549	48.80%

豪ドル売/円買 2022年1月	売建	27,531,000	2,215,509,819	2,296,636,020	1.68%
ノルウェー・クローネ売/円買 2022年1月	売建	24,019,000	298,988,512	314,108,472	0.23%
ユーロ売/円買 2022年1月	売建	414,550,000	53,019,396,179	54,110,175,124	39.62%
オフショア人民元売/円買 2022年1月	売建	32,257,000	569,827,324	582,184,013	0.43%
スウェーデン・クローネ売/円買 2022年1月	売建	28,185,000	352,924,114	359,147,362	0.26%
デンマーク・クローネ売/円買 2022年1月	売建	36,396,000	625,808,597	639,113,760	0.47%
シンガポール・ドル売/円買 2022年1月	売建	6,644,000	549,638,188	565,620,330	0.41%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,668円
純資産総額	175億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.9%
3カ月間	-0.4%
6カ月間	-0.4%
1年間	-3.8%
3年間	6.3%
5年間	-
設定来	6.7%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 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6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6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	532	99.6%	日本円	101.3%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2023/05/15	4.3%
			カナダ・ドル	0.0%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	2.2%
コール・ローン、その他		0.4%	マレーシア・リンギット	0.0%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	1.7%
合計	532	100.0%	豪ドル	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.4%
			シンガポール・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			オフショア人民元	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	1.3%
国債		99.6%	南アフリカ・ランド	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	1.3%
			スウェーデン・クローネ	-0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.3%
			ノルウェー・クローネ	-0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.3%
			その他	-1.4%	BB	United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.3%
合計		99.6%	合計	100.0%	合計	合計		17.5%

※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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】



## (1) 【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,460,860,530	99.71
内 日本	7,460,860,530	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,558,304	0.29
純資産総額	7,482,418,834	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12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	2,363,649,780	3.1329 7,405,114,037	3.1565 7,460,860,530	99.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【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6月15日)	1,006,543	1,009,043	1.0065	1.0090
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,002,760	1,014,760	1.0028	1.0148
第3計算期間末 (2019年6月17日)	11,002,175	11,110,214	1.0184	1.0284
第4計算期間末 (2020年6月15日)	55,667,910	55,667,910	1.0764	1.0764
2020年12月末日	6,159,048,198	-	1.1018	-
2021年1月末日	6,051,936,305	-	1.1000	-
2月末日	6,019,966,165	-	1.0898	-
3月末日	6,154,566,992	-	1.1133	-
4月末日	6,365,460,381	-	1.1125	-
5月末日	5,403,635,985	-	1.1270	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,570,659,890	5,580,511,300	1.1309	1.1329
6月末日	5,519,578,755	-	1.1228	-
7月末日	5,882,433,593	-	1.1302	-
8月末日	6,091,857,147	-	1.1294	-
9月末日	6,071,289,260	-	1.1214	-
10月末日	6,760,321,282	-	1.1451	-
11月末日	7,447,005,494	-	1.1320	-
12月末日	7,482,418,834	-	1.1387	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0025
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0100
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0020
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.6
第4計算期間	5.7
第5計算期間	5.2
2021年6月16日～ 2021年12月15日	0.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	83,995,237	74,191,315
第4計算期間	9,243,518,976	9,202,608,333
第5計算期間	15,970,263,749	11,096,272,833
2021年6月16日～ 2021年12月15日	2,256,986,608	584,801,213

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	233,595,837,322	98.71
内 ユーロ	90,356,442,261	38.18
内 中国	1,018,901,766	0.43
内 シンガポール	1,005,491,452	0.42
内 マレーシア	1,133,351,340	0.48
内 イスラエル	1,109,675,890	0.47
内 ノルウェー	552,913,343	0.23
内 スウェーデン	661,580,700	0.28
内 デンマーク	1,023,305,332	0.43
内 イギリス	14,004,165,190	5.92

内 ポーランド	1,117,735,848	0.47
内 カナダ	4,560,791,537	1.93
内 アメリカ	111,538,501,988	47.13
内 メキシコ	1,646,796,197	0.70
内 オーストラリア	3,866,184,478	1.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,053,915,771	1.29
純資産総額	236,649,753,093	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)	1,634,055,746	0.69
内 日本	1,634,055,746	0.69

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

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

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

## (2) 投資資産 (2021年12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	96.91 1,192,684,937	96.82 1,191,626,523	1.125000 2031/02/15	0.50
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	10,300,000	97.64 1,156,847,120	97.54 1,155,585,926	1.250000 2031/08/15	0.49
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	93.01 1,069,812,522	93.03 1,070,088,570	0.625000 2030/08/15	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	94.91 1,069,900,627	94.88 1,069,506,108	0.875000 2030/11/15	0.45
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,700,000	101.16 1,012,281,818	101.02 1,010,950,921	1.625000 2031/05/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,729,000	102.16 908,227,314	101.60 903,293,422	1.625000 2026/05/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,700,000	99.52 881,464,856	99.15 878,143,654	0.250000 2023/11/15	0.37

8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,699,000	118.93 884,573,379	117.78 876,049,700	2.750000 2027/10/25	0.37
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,920,000	114.61 885,511,625	112.87 872,070,743	1.500000 2031/05/25	0.37
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,500,000	98.95 853,652,560	98.55 850,141,575	0.375000 2024/09/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,700,000	109.49 843,782,579	109.12 840,923,527	2.875000 2028/08/15	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,500,000	97.44 840,574,786	97.04 837,167,319	0.250000 2025/06/30	0.35
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,800,000	93.24 836,526,197	93.27 836,804,315	0.625000 2030/05/15	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,600,000	108.20 821,403,597	108.07 820,393,952	2.625000 2029/02/15	0.35
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,664,000	175.35 838,537,253	171.08 818,094,689	4.500000 2041/04/25	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	109.25 816,785,775	108.84 813,742,920	2.875000 2028/05/15	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	111.25 818,987,854	109.46 805,824,599	2.375000 2051/05/15	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,087,000	122.73 814,869,584	121.07 803,795,659	2.500000 2030/05/25	0.34
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	6,900,000	102.65 814,717,025	100.96 801,320,415	2.000000 2051/08/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	99.37 800,107,875	99.02 797,273,782	1.250000 2028/03/31	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,000,000	98.95 796,710,184	98.68 794,568,511	1.250000 2028/09/30	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,350,000	108.34 791,312,353	107.94 788,376,237	2.750000 2028/02/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	105.91 779,662,609	105.45 776,269,059	2.375000 2027/05/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	96.50 776,960,100	96.14 774,061,596	0.750000 2028/01/31	0.33
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,571,000	165.72 772,363,367	162.34 756,624,818	4.000000 2037/01/04	0.32

26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,730,000	101.14 756,377,387	100.91 754,627,482	- 2023/04/14	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,162,000	104.36 739,676,143	103.78 735,579,550	2.375000 2024/08/15	0.31
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	101.78 736,038,623	101.50 734,028,320	2.000000 2022/11/30	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	97.10 726,016,016	96.73 723,212,404	0.250000 2025/09/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,800,000	93.96 734,894,985	92.25 721,520,460	1.625000 2050/11/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.71%
合計	98.71%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 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	755,000	114,944,309	117,200,107	0.05%
		米ドル買/円売 2022年2 月	買建	5,401,000	620,903,928	621,043,706	0.26%
		カナダ・ドル買/円売 2022年1月	買建	105,000	9,413,796	9,453,706	0.00%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	2,025,000	232,636,050	232,905,982	0.10%
		ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	4,698,000	605,308,222	613,201,475	0.26%

	シンガポール・ドル買/ 円売 2022年2月	買建	378,000	32,163,335	32,159,030	0.01%
	豪ドル買/円売 2022年1 月	買建	97,000	8,059,322	8,091,740	0.00%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,387円
純資産総額	74億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	1.5%
6カ月間	1.4%
1年間	3.5%
3年間	13.9%
5年間	-
設定来	16.9%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 20円 設定来分配金合計額: 265円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月					
分配金	25円	120円	100円	0円	20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	853	98.4%	米ドル	47.5%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.5%
			ユーロ	38.6%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.5%
コール・ローン、その他		1.6%	英ポンド	6.0%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2030/08/15	0.5%
合計	853	100.0%	カナダ・ドル	2.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.5%
債券種別構成			豪ドル	1.7%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.4%
国債		98.4%	メキシコ・ペソ	0.7%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.5%	AA	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.5%	A	FRENCH GOVERNMENT BOND	2027/10/25	0.4%
			イスラエル・シェケル	0.5%	BBB	FRENCH GOVERNMENT BOND	2031/05/25	0.4%
			その他	2.2%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2024/09/15	0.4%
合計		98.4%	合計	100.0%	合計	合計		4.2%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、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、ヘッジなし・円ベース)です。



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)】



## (1) 【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,265,879,601	99.95
内 日本	1,265,879,601	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	593,320	0.05
純資産総額	1,266,472,921	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12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	369,190,271	3.4147 1,260,678,486	3.4288 1,265,879,601	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6月15日)	3,456,480	3,474,147	0.9782	0.9832
第2計算期間末 (2018年6月15日)	321,051,059	322,484,783	1.0077	1.0122
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,249,306,029	1,280,156,651	1.1339	1.1619
第4計算期間末 (2020年6月15日)	569,353,890	587,148,598	0.9599	0.9899
2020年12月末日	808,853,308	-	1.0707	-
2021年1月末日	893,207,723	-	1.1119	-
2月末日	770,631,707	-	1.1687	-
3月末日	1,256,061,487	-	1.2211	-
4月末日	1,282,952,739	-	1.2539	-
5月末日	1,313,255,123	-	1.2624	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,329,867,898	1,362,116,299	1.2784	1.3094
6月末日	1,337,359,142	-	1.2812	-
7月末日	1,402,482,034	-	1.2904	-
8月末日	365,033,731	-	1.2868	-
9月末日	508,017,242	-	1.2460	-
10月末日	989,416,370	-	1.2605	-
11月末日	814,128,789	-	1.2086	-
12月末日	1,266,472,921	-	1.2500	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0050
第2計算期間	0.0045
第3計算期間	0.0280
第4計算期間	0.0300
第5計算期間	0.0310
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	12.7
第5計算期間	36.4
2021年6月16日～ 2021年12月15日	3.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,533,441	0
第2計算期間	315,071,967	0
第3計算期間	1,083,924,855	300,722,332
第4計算期間	3,863,471,660	4,372,122,644
第5計算期間	633,413,235	186,299,155
2021年6月16日～ 2021年12月15日	906,767,146	929,049,677

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	445,625,452,750	97.49
内 日本	445,625,452,750	97.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,478,103,698	2.51
純資産総額	457,103,556,448	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	11,468,800,000	2.51
内 日本	11,468,800,000	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12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	44,505	721,798.03 32,123,621,629	670,000.00 29,818,350,000	6.52
2	日本プロロジスリート	日本	投資証券	64,247	389,324.86 25,012,954,563	407,000.00 26,148,529,000	5.72
3	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,270	685,687.94 26,926,965,421	653,000.00 25,643,310,000	5.61
4	GLP投資法人	日本	投資証券	127,186	190,646.37 24,247,550,006	198,900.00 25,297,295,400	5.53
5	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	58,964	340,799.75 20,094,916,978	348,500.00 20,548,954,000	4.50
6	野村不動産マスターF	日本	投資証券	126,991	164,589.01 20,901,324,007	161,800.00 20,547,143,800	4.50
7	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	198,139	107,807.27 21,360,825,230	99,100.00 19,635,574,900	4.30
8	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,264	371,845.54 14,600,143,393	380,000.00 14,920,320,000	3.26
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	78,245	196,382.23 15,365,928,062	179,800.00 14,068,451,000	3.08
10	産業ファンド	日本	投資証券	55,750	214,584.97 11,963,112,271	222,100.00 12,382,075,000	2.71
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,404	154,062.54 13,619,745,645	135,200.00 11,952,220,800	2.61
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	25,808	405,027.64 10,452,953,584	399,000.00 10,297,392,000	2.25
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	119,202	93,707.07 11,170,070,523	85,700.00 10,215,611,400	2.23
14	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,074	195,826.27 9,414,152,409	202,600.00 9,739,792,400	2.13

15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,597	624,556.40 9,116,649,883	645,000.00 9,415,065,000	2.06
16	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	25,659	342,417.73 8,786,096,555	356,500.00 9,147,433,500	2.00
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	13,560	648,748.75 8,797,033,128	663,000.00 8,990,280,000	1.97
18	API投資法人	日本	投資証券	20,929	462,627.13 9,682,323,210	416,000.00 8,706,464,000	1.90
19	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,148	770,147.97 9,355,757,558	711,000.00 8,637,228,000	1.89
20	イオンリート投資	日本	投資証券	46,183	146,739.18 6,776,855,609	161,100.00 7,440,081,300	1.63
21	森ヒルズリート	日本	投資証券	46,178	157,688.67 7,281,747,579	156,100.00 7,208,385,800	1.58
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,767	477,985.09 6,580,420,762	497,000.00 6,842,199,000	1.50
23	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	120,306	64,276.58 7,732,859,151	56,200.00 6,761,197,200	1.48
24	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	36,635	178,140.52 6,526,178,032	173,100.00 6,341,518,500	1.39
25	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	172,844	42,076.91 7,272,741,660	36,400.00 6,291,521,600	1.38
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	53,063	118,317.02 6,278,256,462	118,500.00 6,287,965,500	1.38
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	17,682	351,165.75 6,209,312,846	341,500.00 6,038,403,000	1.32
28	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	26,821	225,229.75 6,040,887,273	222,300.00 5,962,308,300	1.30
29	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	37,642	153,892.04 5,792,804,451	155,200.00 5,842,038,400	1.28
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,302	773,208.14 6,419,173,988	700,000.00 5,811,400,000	1.27

(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。

## 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	日本	TREIT先物 040 3月	買建	5,600	11,209,016,000	11,468,800,000	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

## ●J-REITインデックス

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	12,500円
純資産総額	12億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.4%
3カ月間	0.3%
6カ月間	-2.4%
1年間	19.6%
3年間	29.0%
5年間	-
設定来	36.6%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 310円 設定来分配金合計額: 985円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月					
分配金	50円	45円	280円	300円	310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。

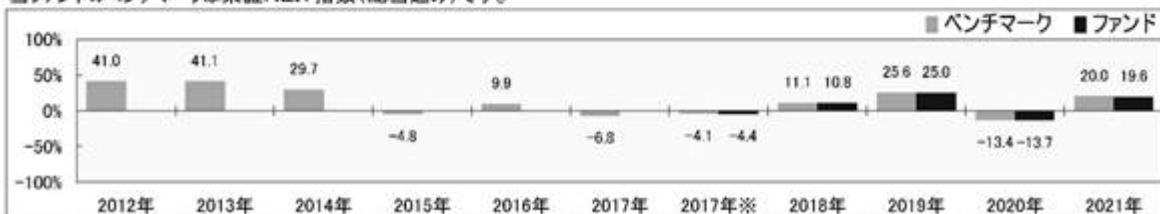
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	97.4%	オフィス不動産	26.7%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.5%
国内リート 先物	1	2.5%	各種不動産	24.1%	日本プロロジスリート	工業用不動産	5.7%
			工業用不動産	23.4%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	5.6%
			住宅用不動産	9.5%	GLP投資法人	工業用不動産	5.5%
			店舗用不動産	9.1%	大和ハウスリート投資法人	各種不動産	4.5%
			ホテル・リゾート不動産	4.3%	野村不動産マスターF	各種不動産	4.5%
			ヘルスケア不動産	0.3%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産	4.3%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.3%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.6%			産業ファンド	工業用不動産	2.7%
合計	62	-	合計	97.4%	合計		45.7%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P/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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2021年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,963,647,051	101.81
内 日本	4,963,647,051	101.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	88,393,213	1.81
純資産総額	4,875,253,838	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)	4,699,386,587	96.39
内 日本	4,699,386,587	96.39

(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12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 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	1,092,804,562	3.0023 3,280,975,185	3.3585 3,670,184,121	75.28
2 先進国REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	558,490,039	2.0179 1,126,977,050	2.3160 1,293,462,930	26.53

(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
親投資信託受益証券	101.81%
合計	101.81%

(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】

(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 2022年1月	売建	1,756,200	264,444,443	272,617,207	5.59%
		カナダ・ドル売/円買 2022年1月	売建	1,140,200	101,039,510	102,656,082	2.11%
		イスラエル・シケル売/円買 2022年1月	売建	65,300	2,352,913	2,405,710	0.05%
		シンガポール・ドル売/円買 2022年1月	売建	1,718,000	142,369,799	146,261,413	3.00%
		米ドル売/円買 2022年1月	売建	31,226,200	3,532,834,615	3,591,431,429	73.67%
		香港ドル売/円買 2022年1月	売建	4,242,800	61,581,623	62,581,300	1.28%
		ユーロ売/円買 2022年1月	売建	1,426,500	183,037,358	186,194,338	3.82%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2022年1月	売建	160,300	12,367,646	12,612,258	0.26%
		豪ドル売/円買 2022年1月	売建	3,867,500	312,074,431	322,626,850	6.62%

(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6月15日)	10,195,310	10,275,310	1.0195	1.0275

第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,933,693	283,060,364	0.9848	0.9958
第3計算期間末 (2019年6月17日)	695,159,967	714,215,108	1.0580	1.0870
第4計算期間末 (2020年6月15日)	134,966,460	134,966,460	0.8945	0.8945
2020年12月末日	2,407,351,244	-	0.9770	-
2021年1月末日	3,236,545,681	-	0.9882	-
2月末日	3,002,172,403	-	1.0184	-
3月末日	3,241,346,701	-	1.0572	-
4月末日	3,407,786,165	-	1.1188	-
5月末日	3,328,886,115	-	1.1357	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,546,416,313	3,594,317,836	1.1846	1.2006
6月末日	3,439,446,160	-	1.1523	-
7月末日	3,704,096,426	-	1.1943	-
8月末日	3,752,406,262	-	1.2163	-
9月末日	3,592,533,430	-	1.1696	-
10月末日	4,799,779,726	-	1.2457	-
11月末日	4,121,451,530	-	1.2486	-
12月末日	4,875,253,838	-	1.3141	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0080
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0290
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0160
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	10.4
第4計算期間	15.5
第5計算期間	34.2

2021年6月16日～ 2021年12月15日	6.2
----------------------------	-----

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	275,571,977	1,329,127
第3計算期間	644,244,585	271,413,599
第4計算期間	4,068,922,456	4,575,108,293
第5計算期間	3,792,473,085	949,515,894
2021年6月16日～ 2021年12月15日	1,549,551,765	771,588,510

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	900,942,458	1.71
内 アメリカ	900,942,458	1.71
投資証券	50,564,722,063	95.84
内 ガーンジー	123,024,719	0.23
内 韓国	88,173,012	0.17
内 香港	653,348,454	1.24
内 シンガポール	1,699,781,079	3.22
内 イスラエル	40,071,711	0.08
内 イギリス	2,737,375,482	5.19
内 アイルランド	48,959,663	0.09
内 オランダ	71,747,709	0.14
内 ベルギー	618,259,398	1.17
内 フランス	796,508,262	1.51
内 ドイツ	134,029,082	0.25
内 スペイン	182,555,054	0.35
内 イタリア	11,695,810	0.02
内 カナダ	957,718,280	1.82

内 アメリカ	38,562,572,380	73.09
内 オーストラリア	3,644,841,593	6.91
内 ニュージーランド	194,060,375	0.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,296,425,794	2.46
純資産総額	52,762,090,315	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)	1,348,565,182	2.56
内 ドイツ	263,316,976	0.50
内 アメリカ	1,085,248,206	2.06
為替予約取引(買建)	495,016,556	0.94
内 日本	495,016,556	0.94

(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12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 PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	191,213	17,631.53 3,371,398,364	19,286.55 3,687,839,774	6.99
2 EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	23,287	94,285.22 2,195,622,192	96,846.84 2,255,272,363	4.27
3 PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	39,456	38,178.47 1,506,373,613	42,858.75 1,691,034,935	3.21
4 SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	84,989	18,383.41 1,562,397,460	18,260.57 1,551,948,026	2.94
5 DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	73,396	19,409.39 1,424,573,320	20,158.40 1,479,546,308	2.80
6 REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	146,325	8,021.49 1,173,750,651	8,269.93 1,210,098,678	2.29
7 WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	112,576	9,438.54 1,062,565,181	9,789.35 1,102,046,113	2.09

8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証 券	36,141	27,690.37 1,000,759,987	29,048.30 1,049,834,646	1.99
9	GOODMAN GROUP	オースト リア	投資証 券	458,260	2,049.79 939,375,158	2,230.65 1,022,218,036	1.94
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証 券	36,471	23,610.27 861,092,714	25,715.02 937,852,545	1.78
11	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証 券	88,262	9,915.87 875,199,997	10,415.06 919,254,114	1.74
12	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信 託受益 証券	68,000	12,764.57 867,995,244	13,249.15 900,942,458	1.71
13	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証 券	34,629	23,358.83 808,896,881	25,927.80 897,854,077	1.70
14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証 券	154,343	4,751.13 733,311,318	5,195.45 801,881,864	1.52
15	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証 券	29,778	24,150.74 719,161,687	26,260.21 781,976,718	1.48
16	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証 券	98,500	6,838.28 673,581,832	7,492.40 738,001,676	1.40
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証 券	29,994	22,627.30 678,685,490	24,201.35 725,895,538	1.38
18	SEGRO PLC	イギリス	投資証 券	317,029	2,200.21 697,557,704	2,199.75 697,384,796	1.32
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証 券	16,834	39,844.76 670,747,782	40,511.19 681,965,443	1.29
20	VENTAS INC	アメリカ	投資証 券	103,013	5,646.44 581,665,148	5,828.06 600,366,295	1.14
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	139,421	3,916.66 546,078,629	4,152.22 578,906,943	1.10
22	LINK REIT	香港	投資証 券	563,900	1,013.14 571,315,013	1,002.26 565,175,824	1.07
23	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	162,665	3,233.09 525,921,385	3,387.33 551,001,498	1.04
24	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証 券	26,331	19,420.20 511,355,994	20,434.45 538,059,587	1.02
25	UDR INC	アメリカ	投資証 券	75,167	6,610.42 496,892,481	6,880.49 517,186,273	0.98
26	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	36,764	12,691.53 466,592,414	13,294.01 488,741,042	0.93

27	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	48,243	9,055.63 436,873,110	9,552.41 460,836,964	0.87
28	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	74,886	5,390.06 403,645,523	6,068.45 454,442,336	0.86
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	44,215	9,753.23 431,243,767	10,061.94 444,889,102	0.84
30	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	159,428	2,677.43 426,858,802	2,789.23 444,682,158	0.84

(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	1.71%
投資証券	95.84%
合計	97.54%

(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 202203	買建	210	1,051,557,698	1,085,248,206	2.06%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202203	買建	208	260,701,399	263,316,976	0.50%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	1,090,000	140,348,812	142,284,567	0.27%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	3,067,000	348,265,527	352,731,989	0.67%

(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。

## 先進国REITマザーファンド

## (1) 投資状況（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	24,259,201	0.75
内 アメリカ	24,259,201	0.75
投資証券	3,130,117,902	97.14
内 香港	29,466,518	0.91
内 シンガポール	88,332,452	2.74
内 イギリス	179,219,572	5.56
内 ベルギー	31,516,599	0.98
内 フランス	77,731,887	2.41
内 カナダ	95,356,322	2.96
内 アメリカ	2,402,304,308	74.55
内 オーストラリア	226,190,244	7.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	67,970,438	2.11
純資産総額	3,222,347,541	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)	47,776,584	1.48
内 ドイツ	1,265,947	0.04
内 アメリカ	46,510,637	1.44
為替予約取引(買建)	9,775,748	0.30
内 日本	9,775,748	0.30
為替予約取引(売建)	19,897,491	0.62
内 日本	19,897,491	0.62

(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12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	12,318	13,344.62 164,379,034	19,286.55 237,571,767	7.37
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	1,542	82,061.01 126,538,091	96,846.84 149,337,827	4.63
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	6,573	14,370.59 94,457,946	18,260.57 120,026,761	3.72
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	14,110	7,540.48 106,396,989	8,269.93 116,688,825	3.62
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	2,472	31,891.59 78,836,024	42,858.75 105,946,836	3.29
6	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	4,756	17,405.40 82,780,284	20,158.40 95,873,375	2.98
7	CHOICE PROPERTIES REIT	カナダ	投資証券	69,400	1,293.87 89,795,992	1,374.01 95,356,322	2.96
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	40,110	1,605.00 64,376,582	2,230.65 89,471,404	2.78
9	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	37,450	1,570.25 58,805,960	2,199.75 82,380,667	2.56
10	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	8,348	8,591.99 71,725,966	9,789.35 81,721,512	2.54
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,676	22,489.86 60,182,867	29,048.30 77,733,253	2.41
12	GECINA SA	フランス	投資証券	4,870	16,406.41 79,899,471	15,961.37 77,731,887	2.41
13	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	2,749	16,935.54 46,555,813	25,927.80 71,275,545	2.21
14	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	6,617	8,517.23 56,358,518	10,415.06 68,916,459	2.14
15	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	2,618	18,061.59 47,285,244	26,260.21 68,749,246	2.13
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	12,769	4,042.60 51,620,693	5,195.45 66,340,744	2.06
17	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	4,901	12,495.31 61,240,012	13,294.01 65,153,951	2.02
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	2,501	19,415.60 48,558,597	24,201.35 60,527,597	1.88



19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証 券	2,327	20,489.66 47,679,445	25,715.02 59,838,855	1.86
20	DEXUS/AU	オースト リア	投資証 券	60,890	864.06 52,617,870	949.31 57,804,070	1.79
21	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	17,059	3,601.96 61,448,103	3,387.33 57,784,616	1.79
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証 券	1,396	33,226.97 46,384,861	40,511.19 56,553,627	1.76
23	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証 券	7,330	5,282.86 38,723,427	7,492.40 54,919,313	1.70
24	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	13,220	3,855.47 50,969,319	4,152.22 54,892,375	1.70
25	TRITAX BIG BOX REIT PLC	イギリス	投資証 券	138,880	298.21 41,416,244	383.13 53,209,417	1.65
26	UDR INC	アメリカ	投資証 券	7,679	5,324.27 40,885,114	6,880.49 52,835,332	1.64
27	VENTAS INC	アメリカ	投資証 券	8,929	6,299.64 56,249,534	5,828.06 52,038,778	1.61
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証 券	2,501	14,111.80 35,293,621	20,434.45 51,106,567	1.59
29	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証 券	18,383	2,464.07 45,299,349	2,685.71 49,371,536	1.53
30	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	シンガ ポール	投資証 券	275,388	181.36 49,946,984	173.70 47,836,548	1.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.75%
投資証券	97.14%
合計	97.89%

(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	アメリカ	DJ US REAL ESTATE 202203	買建	9	44,929,918	46,510,637	1.44%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202203	買建	1	1,254,508	1,265,947	0.04%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2022年1 月	買建	85,000	9,606,190	9,775,748	0.30%
		米ドル売/円買 2022年1 月	売建	173,000	19,896,730	19,897,491	0.62%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,141円
純資産総額	48億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.2%
3カ月間	12.4%
6カ月間	14.0%
1年間	36.3%
3年間	46.8%
5年間	-
設定来	39.4%

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 160円 設定来分配金合計額: 640円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月					
分配金	80円	110円	290円	0円	160円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	327	100.2%	日本円	94.7%	産業施設	17.8%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.2%
外国投資信託等	4	1.6%	米ドル	4.5%	商業施設	16.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		0.6%	豪ドル	0.4%	住宅	16.3%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.3%
合計	331	-	ユーロ	0.2%	特殊用途施設	11.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.2%
国・地域別構成			韓国ウォン	0.1%	各種不動産	9.4%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
アメリカ		78.2%	カナダドル	0.1%	オフィス	8.4%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.7%
オーストラリア		7.1%	ニュージーランドドル	0.0%	ヘルスクエア	8.3%	WELLTOWER INC	ヘルスクエア	アメリカ	2.2%
イギリス		5.4%	イスラエル・シケル	0.0%	貸倉庫	6.8%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	2.2%
シンガポール		3.2%	英ポンド	-0.0%	ホテル/リゾート	2.4%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
その他		7.9%	その他	-0.0%	その他	0.5%	DJ US REAL ESTATE 202203	-	アメリカ	1.9%
合計		101.7%	合計	100.0%	合計	97.8%	合計			32.3%

※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)(円ヘッジ・円ベース)です。(2022年3月9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(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】（2021年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	13,407,985	99.99
内 日本	13,407,985	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,213	0.01
純資産総額	13,409,198	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12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	3,992,254	2.9255 11,679,734	3.3585 13,407,985	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6月15日)	9,896,754	9,996,754	0.9897	0.9997
第2計算期間末 (2018年6月15日)	9,693,791	10,023,791	0.9694	1.0024
第3計算期間末 (2019年6月17日)	518,637,200	534,240,737	1.0304	1.0614
第4計算期間末 (2020年6月15日)	424,828,364	439,928,561	0.8440	0.8740
2020年12月末日	456,476,344	-	0.9069	-
2021年1月末日	467,167,201	-	0.9281	-
2月末日	491,580,570	-	0.9766	-
3月末日	1,123,401,482	-	1.0489	-
4月末日	1,175,759,834	-	1.0978	-
5月末日	1,235,427,730	-	1.1220	-
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,290,025,686	1,308,743,688	1.1716	1.1886
6月末日	1,255,009,694	-	1.1398	-
7月末日	1,286,506,765	-	1.1684	-
8月末日	47,742,040	-	1.1916	-
9月末日	46,627,931	-	1.1638	-
10月末日	50,672,316	-	1.2648	-
11月末日	12,584,517	-	1.2585	-
12月末日	13,409,198	-	1.3409	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0330
第3計算期間	0.0310
第4計算期間	0.0300
第5計算期間	0.0170
2021年6月16日～ 2021年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.0
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.5
第4計算期間	15.2
第5計算期間	40.8
2021年6月16日～ 2021年12月15日	8.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	493,339,911	0
第4計算期間	0	0
第5計算期間	597,719,068	0
2021年6月16日～ 2021年12月15日	0	1,091,058,979

(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「ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

## ●外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2021年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,409円
純資産総額	13百万円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	6.5%
3カ月間	15.2%
6カ月間	17.6%
1年間	50.0%
3年間	57.6%
5年間	-
設定来	51.6%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 170円 設定来分配金合計額: 1,210円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期						
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月						
分配金	100円	330円	310円	300円	170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。

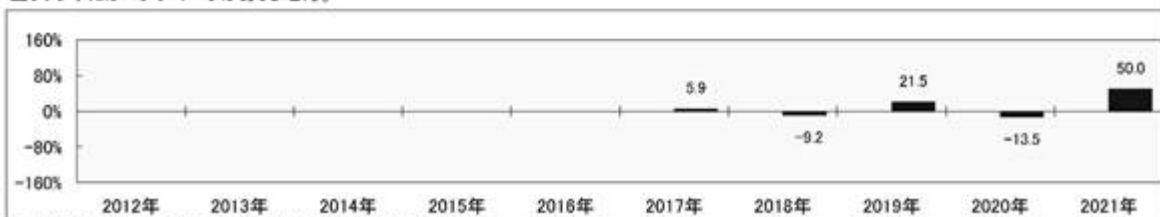
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	327	98.3%	米ドル	76.9%	産業施設	17.6%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.0%
外国投資信託等	4	1.8%	豪ドル	6.9%	住宅	15.7%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.3%
コール・ローン、その他		2.5%	英ポンド	5.5%	商業施設	15.4%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.2%
合計	331	-	ユーロ	4.1%	特殊用途施設	11.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.0%	各種不動産	9.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.8%
アメリカ		76.8%	カナダ・ドル	1.8%	オフィス	8.3%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.3%
オーストラリア		6.9%	香港ドル	1.3%	ヘルスクエア	8.0%	WELLTOWER INC	ヘルスクエア	アメリカ	2.1%
イギリス		5.2%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	7.1%	DJ US REAL ESTATE 202203	-	アメリカ	2.1%
シンガポール		3.2%	韓国ウォン	0.2%	ホテル/リゾート	2.5%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
その他		7.9%	その他	-0.0%	その他	0.6%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.9%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	95.7%	合計			30.6%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(2月16日)から年末、2021年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

### 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いません。



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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

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

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等の一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

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

[別表A]

ファンド名	該当日
-------	-----

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

## [ 別表B ]

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

## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

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

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

\*「J-REITインデックス」を除きます。

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

毎年6月16日から翌年6月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2017年2月16日から2017年6月15日までとします。

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

## (5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合(「外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」および「外国REITインデックス(為替

ヘッジなし)」を除きます。)、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
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.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同

じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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っている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	13,890,167	3,100,054
親投資信託受益証券	5,183,020,961	3,001,016,814
未収入金	140,000	6,010,000
流動資産合計	5,197,051,128	3,010,126,868
資産合計	5,197,051,128	3,010,126,868
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	99,784,527	42,558,595
未払解約金	-	5,981,400
未払受託者報酬	873,593	185,406
未払委託者報酬	12,667,710	2,689,022
その他未払費用	218,349	46,275
流動負債合計	113,544,179	51,460,698
負債合計	113,544,179	51,460,698
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,989,226,381	1 2,239,926,064
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	94,280,568	718,740,106
(分配準備積立金)	2,031,455	86,267,483
元本等合計	5,083,506,949	2,958,666,170
純資産合計	5,083,506,949	2,958,666,170
負債純資産合計	5,197,051,128	3,010,126,868



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年6月18日 至 2020年6月15日		自 2020年6月16日 至 2021年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		47		6
有価証券売買等損益		289,790,021		1,737,762,853
<b>営業収益合計</b>		<b>289,789,974</b>		<b>1,737,762,859</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,909		1,516
受託者報酬		1,596,138		1,215,382
委託者報酬		23,145,103		17,624,458
その他費用		400,341		303,727
<b>営業費用合計</b>		<b>25,144,491</b>		<b>19,145,083</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>		<b>314,934,465</b>		<b>1,718,617,776</b>
経常利益又は経常損失( )		314,934,465		1,718,617,776
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>		<b>314,934,465</b>		<b>1,718,617,776</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( )		162,040,844		1,582,051,944
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>		<b>40,413,703</b>		<b>94,280,568</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,529,649,089		1,212,283,781
<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>1,529,649,089</b>		<b>1,212,283,781</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,223,104,076		681,831,480
<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>1,223,104,076</b>		<b>681,831,480</b>
分配金		1 99,784,527		1 42,558,595
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>94,280,568</b>		<b>718,740,106</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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,852,409,502円	4,989,226,381円
期中追加設定元本額	20,581,650,630円	8,768,488,999円
期中一部解約元本額	17,444,833,751円	11,517,789,316円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,989,226,381口	2,239,926,064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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(101,743,256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(190,904,707円)及び分配準備積立金(72,726円)より分配対象額は292,720,689円(1万口当たり586.71円)であり、うち99,784,527円(1万口当たり200円)を分配金額としております。</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(46,556,605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(82,208,958円)、投資信託約款に規定される収益調整金(632,472,623円)及び分配準備積立金(60,515円)より分配対象額は761,298,701円(1万口当たり3,398.77円)であり、うち42,558,595円(1万口当たり190円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	144,591,954	139,716,007
合計	144,591,954	139,716,007

## (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6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2020年6月16日 至 2021年6月15日
-------------------------------------

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0189円 (10,189円)	1.3209円 (13,209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	2,252,508,305	3,001,016,814	
親投資信託受益証券 合計			3,001,016,814	
合計			3,001,016,814	

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6月15日現在	2021年6月15日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		22,442,306,208	9,333,778,781
株式	2 3	140,637,428,520	176,669,720,970
派生商品評価勘定		-	36,834,650
未収入金		976,345,455	-
未収配当金		1,161,108,607	1,083,477,946
未収利息		943,490	255,932
前払金		61,213,200	-
その他未収収益	4	33,685,116	19,206,442
差入委託証拠金		45,600,000	-
流動資産合計		165,358,630,596	187,143,274,721
資産合計		165,358,630,596	187,143,274,721
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		116,007,900	1,100
前受金		-	2,600,000
未払金		5,856,600	-
未払解約金		130,214,650	43,339,590
受入担保金		21,959,179,861	5,651,977,789
その他未払費用		59,262	-
流動負債合計		22,211,318,273	5,697,918,479
負債合計		22,211,318,273	5,697,918,479
純資産の部			
元本等			
元本	1	141,769,254,313	136,188,256,579
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,378,058,010	45,257,099,663
元本等合計		143,147,312,323	181,445,356,242
純資産合計		143,147,312,323	181,445,356,242
負債純資産合計		165,358,630,596	187,143,274,721

## 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6月16日 至 2021年6月15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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。 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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	137,575,273,801円	141,769,254,313円
期中追加設定元本額	39,667,785,354円	23,223,708,925円

期中一部解約元本額	35,473,804,842円	28,804,706,659円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	3,431,880,768円	3,007,921,668円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	7,031,041,815円	6,153,412,861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	2,678,796円	927,296円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	49,608,551円	25,923,401円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	725,117,589円	511,513,581円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	40,741,510円	26,728,376円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,079,559,180円	761,667,628円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	93,444,117円	171,090,658円
D-I's TOPIXイン デックス	55,557,627円	31,725,000円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	13,600,232円	-円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	21,174,600円	81,759,929円
iFree TOPIXイン デックス	1,794,166,388円	3,600,007,778円
iFree 8資産バランス	2,416,776,177円	2,950,735,005円
iFree 年金バランス	92,512,175円	365,291,756円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,610,936,766円	65,441,251,037円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,891,908,692円	2,833,165,324円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,733,714,207円	3,784,765,693円



ダイワ・ライフ・バランス70	3,281,143,353円	3,584,315,339円
年金ダイワ日本株式インデックス	5,113,096,051円	5,710,990,378円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	14,119,485円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	53,875,091円	46,852,838円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	32,163,043円	43,845,022円
ダイワつみたてインデックス日本株式	620,750,487円	1,110,959,581円
ダイワつみたてインデックスバランス30	11,880,333円	10,159,812円
ダイワつみたてインデックスバランス50	7,017,784円	8,324,391円
ダイワつみたてインデックスバランス70	10,310,045円	13,605,466円
ダイワ世界バランスファンド40VA	153,610,897円	117,698,161円
ダイワ世界バランスファンド60VA	155,742,680円	130,882,312円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,889,004,308円	6,575,175,983円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	735,977,487円	580,569,028円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	121,831,903円	82,764,931円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	199,527,738円	149,390,769円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	183,644,716円	165,602,078円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	11,062,968,954円	10,040,729,674円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	5,133,228,644円	2,252,508,305円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	2,052,886,383円	2,522,537,924円

	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,336,114,842円	1,218,784,836円
	ダイワライフスタイル25	201,336,286円	158,924,191円
	ダイワライフスタイル50	665,325,688円	608,100,800円
	ダイワライフスタイル75	549,365,823円	500,068,324円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	12,099,913,102円	10,807,579,445円
計		141,769,254,313円	136,188,256,579円
2.	期末日における受益権の総数	141,769,254,313口	136,188,256,579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 20,192,814,970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 5,415,195,540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 500,160,000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 971,440,000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32,561,275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18,808,175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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>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。</p>
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

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
--	--------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	6,881,048,958	28,152,441,149
新株予約権証券	0	-
合計	6,881,048,958	28,152,441,149

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年9月20日から2020年6月15日まで、及び2020年9月24日から2021年6月15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6月15日 現在			2021年6月15日 現在				
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,458,263,200	-	2,342,340,000	115,923,200	4,677,310,000	-	4,714,275,000	36,965,000
合計	2,458,263,200	-	2,342,340,000	115,923,200	4,677,310,000	-	4,714,275,000	36,965,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.0097円	1.3323円
(1万口当たり純資産額)	(10,097円)	(13,323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	3,100	2,949.00	9,141,900	
日本水産	83,400	546.00	45,536,400	
マルハニチロ	14,000	2,457.00	34,398,000	
ハウスイ	500	951.00	475,500	
カネコ種苗	2,700	1,480.00	3,996,000	
サカタのタネ	10,600	3,850.00	40,810,000	
ホクト	7,900	1,936.00	15,294,400	貸付株式数 2,100株
ホクリヨウ	2,300	770.00	1,771,000	貸付株式数 100株
ヒノキヤグループ	2,300	2,624.00	6,035,200	
ショーボンドHD	12,700	4,655.00	59,118,500	貸付株式数 300株
ミライト・ホールディングス	30,600	1,943.00	59,455,800	
タマホーム	5,700	2,262.00	12,893,400	貸付株式数 2,100株
サンヨーホームズ	1,500	736.00	1,104,000	貸付株式数 300株
日本アクア	4,100	561.00	2,300,100	貸付株式数 1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	757.00	2,271,000	貸付株式数 900株
ベステラ	1,800	1,630.00	2,934,000	貸付株式数 600株
キャンディル	1,700	566.00	962,200	
スペースバリューHD	11,500	668.00	7,682,000	貸付株式数 400株
住石ホールディングス	21,600	128.00	2,764,800	貸付株式数 2,700株
日鉄鉱業	2,100	6,240.00	13,104,000	
三井松島HLDGS	3,600	988.00	3,556,800	
INPEX	324,700	810.00	263,007,000	
石油資源開発	11,900	1,997.00	23,764,300	
K&Oエナジーグループ	4,200	1,349.00	5,665,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	922.00	1,475,200	
第一カッター興業	2,300	1,417.00	3,259,100	
明豊ファシリティワークス	3,100	868.00	2,690,800	貸付株式数 1,100株
安藤・間	56,800	814.00	46,235,200	
東急建設	27,000	747.00	20,169,000	
コムシスホールディングス	31,500	3,205.00	100,957,500	
ビーアールホールディングス	12,200	505.00	6,161,000	貸付株式数 1,300株

高松コンストラクションG P	5,400	2,040.00	11,016,000	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	10,140.00	28,392,000	貸付株式数	500株
ソネック	1,000	970.00	970,000	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,100	897.00	3,677,700	貸付株式数	1,300株
オリエンタル白石	31,600	289.00	9,132,400		
大成建設	63,500	3,620.00	229,870,000		
大林組	203,500	929.00	189,051,500		
清水建設	190,900	864.00	164,937,600		
飛島建設	5,700	1,056.00	6,019,200		
長谷工コーポレーション	66,800	1,511.00	100,934,800		
松井建設	7,800	727.00	5,670,600	貸付株式数	1,600株
銭高組	900	4,250.00	3,825,000		
鹿島建設	149,600	1,427.00	213,479,200		
不動テトラ	5,100	1,835.00	9,358,500		
大未建設	2,500	1,026.00	2,565,000	貸付株式数	500株
鉄建建設	3,900	1,875.00	7,312,500		
西松建設	15,000	3,370.00	50,550,000	貸付株式数	100株
三井住友建設	50,800	483.00	24,536,400		
大豊建設	5,000	3,980.00	19,900,000	貸付株式数	1,700株
前田建設	50,800	984.00	49,987,200		
佐田建設	5,100	492.00	2,509,200	貸付株式数	1,700株
ナカノフドー建設	4,900	398.00	1,950,200	貸付株式数	1,700株
奥村組	11,200	2,905.00	32,536,000		
東鉄工業	8,400	2,338.00	19,639,200		
イチケン	1,500	1,844.00	2,766,000		
富士ピー・エス	2,400	567.00	1,360,800		
浅沼組	2,500	4,510.00	11,275,000		
戸田建設	84,100	764.00	64,252,400		
熊谷組	9,700	2,825.00	27,402,500		
北野建設	1,200	2,370.00	2,844,000	貸付株式数	100株
植木組	1,800	1,504.00	2,707,200	貸付株式数	600株
矢作建設	9,300	707.00	6,575,100		
ピーエス三菱	6,400	640.00	4,096,000		
日本ハウスHLDGS	13,800	352.00	4,857,600		
大東建託	22,300	12,160.00	271,168,000		
新日本建設	8,400	854.00	7,173,600		
NIPPO	16,900	3,165.00	53,488,500		
東亜道路	1,300	4,565.00	5,934,500		
前田道路	12,600	2,210.00	27,846,000		

日本道路	2,000	8,010.00	16,020,000	
東亜建設	5,700	2,472.00	14,090,400	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	19,900	585.00	11,641,500	
若築建設	3,500	1,417.00	4,959,500	
東洋建設	23,200	577.00	13,386,400	
五洋建設	87,400	798.00	69,745,200	
世紀東急	9,900	871.00	8,622,900	
福田組	2,400	4,900.00	11,760,000	
日本ドライケミカル	1,600	1,772.00	2,835,200	貸付株式数 500株
住友林業	48,300	2,218.00	107,129,400	
日本基礎技術	6,300	514.00	3,238,200	
バコーポレーション	8,400	380.00	3,192,000	貸付株式数 2,900株
大和ハウス	188,500	3,280.00	618,280,000	
ライト工業	11,800	1,812.00	21,381,600	
積水ハウス	221,200	2,217.50	490,511,000	
日特建設	5,200	766.00	3,983,200	
北陸電気工事	3,300	1,224.00	4,039,200	貸付株式数 100株
ユアテック	11,800	737.00	8,696,600	
日本リーテック	4,400	1,700.00	7,480,000	貸付株式数 1,700株
四電工	1,100	3,290.00	3,619,000	
中電工	9,200	2,310.00	21,252,000	貸付株式数 1,400株
関電工	33,200	886.00	29,415,200	
きんでん	40,900	1,853.00	75,787,700	
東京エネシス	6,700	984.00	6,592,800	
トーエネック	1,900	3,680.00	6,992,000	
住友電設	5,700	2,334.00	13,303,800	
日本電設工業	11,000	1,842.00	20,262,000	貸付株式数 2,300株
協和エクシオ	30,900	2,755.00	85,129,500	
新日本空調	5,400	2,055.00	11,097,000	貸付株式数 800株
日本工営	3,800	3,240.00	12,312,000	
九電工	14,300	3,465.00	49,549,500	
三機工業	15,000	1,412.00	21,180,000	
日揮ホールディングス	68,000	1,050.00	71,400,000	
中外炉工業	2,400	1,985.00	4,764,000	
ヤマト	6,300	783.00	4,932,900	
太平電業	4,500	2,673.00	12,028,500	
高砂熱学	18,400	1,898.00	34,923,200	
三晃金属	800	2,401.00	1,920,800	
NEC ネットエスアイ	21,200	1,770.00	37,524,000	
朝日工業社	1,400	2,970.00	4,158,000	

明星工業	13,100	746.00	9,772,600	
大 気 社	9,800	3,435.00	33,663,000	貸付株式数 700株
ダイダン	4,500	2,636.00	11,862,000	貸付株式数 1,500株
日比谷総合設備	6,600	1,839.00	12,137,400	貸付株式数 500株
ニッポン	19,500	1,581.00	30,829,500	貸付株式数 2,800株
日清製粉G本社	74,200	1,694.00	125,694,800	
日東富士製粉	500	7,010.00	3,505,000	
昭和産業	5,800	2,980.00	17,284,000	
鳥越製粉	6,400	790.00	5,056,000	貸付株式数 200株
中部飼料	8,200	1,169.00	9,585,800	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	9,300	752.00	6,993,600	貸付株式数 1,100株
東洋精糖	1,500	1,205.00	1,807,500	
日本甜菜糖	3,500	1,640.00	5,740,000	
D M三井製糖ホールディ	5,100	1,874.00	9,557,400	貸付株式数 2,200株
塩水港精糖	10,300	226.00	2,327,800	貸付株式数 3,000株
日新製糖	3,100	1,732.00	5,369,200	貸付株式数 500株
L I F U L L	22,500	361.00	8,122,500	貸付株式数 8,500株
ミクシィ	16,100	2,938.00	47,301,800	
ジェイエシーリクルート メント	4,400	1,777.00	7,818,800	
日本M & Aセンター	102,300	2,793.00	285,723,900	
メンバーズ	2,100	3,310.00	6,951,000	
中広	1,100	369.00	405,900	貸付株式数 300株
U Tグループ	9,100	3,265.00	29,711,500	貸付株式数 2,900株
アイティメディア	2,500	1,855.00	4,637,500	貸付株式数 200株
タケエイ	7,200	1,344.00	9,676,800	
E・Jホールディングス	3,500	1,139.00	3,986,500	
夢真ビーネックスグルー フ	17,000	1,287.00	21,879,000	
コシダカホールディング ス	17,000	638.00	10,846,000	貸付株式数 3,000株
アルトナー	1,600	892.00	1,427,200	
パソナグループ	6,800	2,199.00	14,953,200	
C D S	1,500	1,523.00	2,284,500	
リンクアンドモチベーシ ョン	11,600	664.00	7,702,400	貸付株式数 400株
G C A	8,100	1,030.00	8,343,000	
エス・エム・エス	21,300	3,400.00	72,420,000	
サニーサイドアップG	2,000	841.00	1,682,000	貸付株式数 800株
パーソルホールディング ス	62,100	2,249.00	139,662,900	貸付株式数 24,900株
リニカル	3,600	806.00	2,901,600	貸付株式数 1,300株
クックパッド	21,700	256.00	5,555,200	



エスクリ	2,500	489.00	1,222,500	
アイ・ケイ・ケイ	3,100	675.00	2,092,500	貸付株式数 1,200株
森永製菓	15,400	3,430.00	52,822,000	貸付株式数 6,000株
中村屋	1,600	3,815.00	6,104,000	
江崎グリコ	18,100	4,450.00	80,545,000	
名糖産業	3,200	1,556.00	4,979,200	
井村屋グループ	3,800	2,323.00	8,827,400	
不二家	4,100	2,179.00	8,933,900	貸付株式数 500株
山崎製パン	49,200	1,587.00	78,080,400	
第一屋製パン	1,800	952.00	1,713,600	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,100	5,430.00	5,973,000	貸付株式数 400株
亀田製菓	3,800	4,480.00	17,024,000	
寿スピリッツ	6,300	7,690.00	48,447,000	貸付株式数 2,500株
カルビー	30,000	2,599.00	77,970,000	
森永乳業	12,300	5,910.00	72,693,000	
六甲バター	4,500	1,632.00	7,344,000	貸付株式数 200株
ヤクルト	45,000	6,640.00	298,800,000	
明治ホールディングス	43,300	7,010.00	303,533,000	
雪印メグミルク	15,700	2,205.00	34,618,500	
プリマハム	9,500	3,025.00	28,737,500	
日本ハム	25,100	4,445.00	111,569,500	
林兼産業	2,800	618.00	1,730,400	
丸大食品	6,400	1,700.00	10,880,000	
S Foods	6,000	3,485.00	20,910,000	
柿安本店	2,200	2,562.00	5,636,400	貸付株式数 800株
伊藤ハム米久HLDGS	42,600	703.00	29,947,800	
学情	2,300	1,422.00	3,270,600	貸付株式数 800株
スタジオアリス	3,400	2,311.00	7,857,400	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,800	997.00	1,794,600	貸付株式数 600株
シミックホールディングス	3,200	1,583.00	5,065,600	
エプロ	1,500	944.00	1,416,000	貸付株式数 500株
システナ	23,000	1,966.00	45,218,000	
NJS	1,500	2,085.00	3,127,500	
デジタルアーツ	3,700	8,960.00	33,152,000	
日鉄ソリューションズ	9,500	3,520.00	33,440,000	
総合警備保障	24,500	5,220.00	127,890,000	
キューブシステム	3,700	1,042.00	3,855,400	貸付株式数 1,300株
いちご	72,000	373.00	26,856,000	
エイジア	1,200	2,114.00	2,536,800	貸付株式数 300株
日本駐車場開発	72,200	161.00	11,624,200	

コア	2,600	1,427.00	3,710,200		
カカクコム	46,200	3,390.00	156,618,000		
アイロムグループ	2,400	2,109.00	5,061,600	貸付株式数	800株
セントケア・ホールディング	4,900	1,090.00	5,341,000	貸付株式数	100株
サイネックス	1,700	680.00	1,156,000	貸付株式数	200株
ルネサンス	4,200	1,301.00	5,464,200	貸付株式数	1,500株
ディップ	9,900	3,510.00	34,749,000	貸付株式数	3,300株
S B Sホールディングス	5,100	3,305.00	16,855,500	貸付株式数	100株
デジタルホールディングス	4,700	2,483.00	11,670,100	貸付株式数	1,100株
新日本科学	8,000	830.00	6,640,000		
キャリアデザインセンター	1,500	1,085.00	1,627,500		
ベネフィット・ワン	22,700	3,535.00	80,244,500	貸付株式数	3,500株
エムスリー	110,100	7,821.00	861,092,100		
ツカダ・グローバルHOLD	4,900	426.00	2,087,400	貸付株式数	1,900株
プラス	1,100	618.00	679,800	貸付株式数	300株
アウトソーシング	35,800	2,119.00	75,860,200	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	523.00	3,294,900	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,200	3,005.00	6,611,000		
ディー・エヌ・エー	26,800	2,313.00	61,988,400		
博報堂DYHLDGS	86,400	1,797.00	155,260,800		
ぐるなび	11,000	586.00	6,446,000	貸付株式数	4,300株
タカミヤ	7,500	532.00	3,990,000		
ジャパンベストレスキュー	5,000	830.00	4,150,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	385.00	6,314,000	貸付株式数	1,700株
ライク	1,800	2,097.00	3,774,600	貸付株式数	600株
ビジネス・ブレークスルー	3,000	434.00	1,302,000		
エスプール	16,300	984.00	16,039,200		
WDBホールディングス	2,900	2,796.00	8,108,400		
手間いらず	900	6,550.00	5,895,000	貸付株式数	200株
ティア	3,600	473.00	1,702,800	貸付株式数	200株
CDG	500	1,578.00	789,000		
バリューコマース	4,500	3,400.00	15,300,000		
インフォマート	63,100	1,014.00	63,983,400		
サッポロホールディングス	22,600	2,330.00	52,658,000		
アサヒグループホールディ	143,100	5,505.00	787,765,500		

キリンHD	277,600	2,306.00	640,145,600		
宝ホールディングス	48,900	1,509.00	73,790,100		
オエノンホールディングス	19,900	374.00	7,442,600		
養命酒	2,300	1,848.00	4,250,400		
コカ・コーラボトラーズJHD	50,200	1,822.00	91,464,400		
サントリー食品インター	43,800	4,275.00	187,245,000		
ダイドーグループHD	3,800	5,030.00	19,114,000	貸付株式数	1,400株
伊藤園	19,900	6,760.00	134,524,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,900	2,106.00	14,531,400	貸付株式数	2,500株
ユニカフェ	2,500	998.00	2,495,000		
ジャパンフーズ	1,000	1,211.00	1,211,000		
日清オイリオグループ	8,500	3,090.00	26,265,000	貸付株式数	3,200株
不二製油グループ	16,200	2,794.00	45,262,800	貸付株式数	400株
かどや製油	700	4,010.00	2,807,000	貸付株式数	200株
J-オイルミルズ	6,200	1,915.00	11,873,000	貸付株式数	400株
ローソン	16,100	5,030.00	80,983,000	貸付株式数	3,500株
サンエー	4,700	4,300.00	20,210,000		
カワチ薬品	4,600	2,277.00	10,474,200	貸付株式数	1,500株
エービーシー・マート	9,900	6,400.00	63,360,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	787.00	1,967,500		
高千穂交易	2,400	1,106.00	2,654,400	貸付株式数	900株
アスクル	11,200	1,832.00	20,518,400		
ゲオホールディングス	8,500	1,200.00	10,200,000	貸付株式数	2,100株
アダストリア	8,800	1,994.00	17,547,200	貸付株式数	3,500株
ジーフット	3,000	414.00	1,242,000	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	423.00	423,000	貸付株式数	400株
オルパヘルスケアHLDGS	1,100	1,725.00	1,897,500	貸付株式数	400株
伊藤忠食品	1,600	5,270.00	8,432,000		
くら寿司	7,600	4,185.00	31,806,000	貸付株式数	2,800株
キャンドウ	3,500	1,961.00	6,863,500	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,100	1,286.00	6,558,600	貸付株式数	1,000株
パルグループHLDGS	5,500	1,670.00	9,185,000		
JALUX	1,700	1,878.00	3,192,600	貸付株式数	700株
エディオン	27,000	1,052.00	28,404,000	貸付株式数	11,500株
あらた	5,000	4,240.00	21,200,000		
サーラコーポレーション	13,200	593.00	7,827,600	貸付株式数	2,200株

ワッツ	3,300	929.00	3,065,700	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	800	3,950.00	3,160,000		
ハローズ	2,600	2,717.00	7,064,200	貸付株式数	1,000株
J Pホールディングス	18,300	283.00	5,178,900		
フジオフードG本社	5,300	1,336.00	7,080,800	貸付株式数	2,100株 (100株)
あみやき亭	1,300	2,920.00	3,796,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,200	5,960.00	13,112,000		
ひらまつ	11,800	227.00	2,678,600	貸付株式数	4,500株
フィールズ	5,700	486.00	2,770,200		
双日	354,200	349.00	123,615,800		
アルフレッサホールディングス	66,800	1,704.00	113,827,200		
大黒天物産	2,100	8,160.00	17,136,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,000	1,023.00	5,115,000	貸付株式数	1,900株
ファーマライズHD	1,500	778.00	1,167,000	貸付株式数	600株
キッコーマン	47,100	7,440.00	350,424,000		
味の素	155,700	2,692.50	419,222,250		
キューピー	36,800	2,590.00	95,312,000		
ハウス食品G本社	24,600	3,365.00	82,779,000		
カゴメ	26,900	3,045.00	81,910,500	貸付株式数	10,400株
焼津水産化工	3,100	977.00	3,028,700	貸付株式数	600株
アリアケジャパン	6,100	6,930.00	42,273,000	貸付株式数	500株
ピエトロ	900	1,727.00	1,554,300		
エバラ食品工業	1,700	2,590.00	4,403,000		
やまみ	800	1,948.00	1,558,400		
ニチレイ	31,300	2,948.00	92,272,400		
横浜冷凍	17,400	901.00	15,677,400	貸付株式数	700株
東洋水産	33,900	4,425.00	150,007,500		
イトアンドHLDGS	2,300	1,887.00	4,340,100	貸付株式数	900株
大冷	1,100	1,970.00	2,167,000		
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,000	784.00	3,136,000	貸付株式数	1,300株
日清食品HD	25,800	8,100.00	208,980,000		
永谷園ホールディングス	3,500	2,194.00	7,679,000		
一正蒲鉾	2,800	970.00	2,716,000	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,500	1,919.00	14,392,500	貸付株式数	1,200株
ロックフィールド	7,500	1,542.00	11,565,000	貸付株式数	2,700株
日本たばこ産業	350,600	2,202.00	772,021,200	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,641.00	6,564,000	貸付株式数	1,000株

わらべや日洋HD	4,500	2,175.00	9,787,500	貸付株式数	1,600株
なとり	4,100	1,906.00	7,814,600		
イフジ産業	1,500	926.00	1,389,000	貸付株式数	200株
ピクルスコーポレーション	1,700	3,225.00	5,482,500		
北の達人コーポ	23,100	497.00	11,480,700	貸付株式数	9,100株 (8,900株)
ユーグレナ	34,100	902.00	30,758,200	貸付株式数	11,400株
スター・マイカ・HLDGS	3,300	1,155.00	3,811,500		
ADワークスグループ	12,600	166.00	2,091,600	貸付株式数	4,900株
片倉工業	8,600	1,534.00	13,192,400	貸付株式数	1,700株
グンゼ	4,600	4,675.00	21,505,000		
ヒューリック	135,700	1,313.00	178,174,100	貸付株式数	53,800株
神栄	1,000	1,383.00	1,383,000	貸付株式数	300株
ラサ商事	3,300	901.00	2,973,300		
アルペン	5,200	2,943.00	15,303,600	貸付株式数	1,900株
ハブ	2,100	810.00	1,701,000	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	4,700	2,375.00	11,162,500		
クオールホールディングス	8,600	1,530.00	13,158,000		
アルコニックス	6,800	1,480.00	10,064,000	貸付株式数	400株
神戸物産	44,300	3,080.00	136,444,000	貸付株式数	17,500株
ソリトンシステムズ	3,300	1,702.00	5,616,600		
ジズホールディングス	4,300	8,130.00	34,959,000	貸付株式数	1,300株
ビックカメラ	37,600	1,142.00	42,939,200		
DCMホールディングス	39,500	1,050.00	41,475,000		
ペッパーフードサービス	8,300	516.00	4,282,800	貸付株式数	3,300株 (300株)
ハイパー	1,300	558.00	725,400		
Monotaro	91,500	2,643.00	241,834,500		
東京一番フーズ	1,600	592.00	947,200	貸付株式数	600株
DDホールディングス	3,200	592.00	1,894,400	貸付株式数	1,200株
あいホールディングス	9,100	2,146.00	19,528,600	貸付株式数	3,600株
ディーブイエックス	2,100	1,000.00	2,100,000	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	601.00	841,400	貸付株式数	400株
アークランドサービスHD	5,500	2,288.00	12,584,000	貸付株式数	2,100株
J. フロントリテイリング	76,700	1,116.00	85,597,200		
ドトール・日レスHD	10,100	1,712.00	17,291,200		
マツモトキヨシHLDGS	26,600	4,945.00	131,537,000		

ブロンコビリー	3,300	2,433.00	8,028,900	貸付株式数	1,300株
Z O Z O	37,800	3,710.00	140,238,000		
トレジャー・ファクトリー	2,000	955.00	1,910,000		
物語コーポレーション	3,500	7,180.00	25,130,000	貸付株式数	1,300株
ココカラファイン	5,700	8,300.00	47,310,000		
三越伊勢丹HD	112,400	841.00	94,528,400		
東洋紡	25,100	1,364.00	34,236,400		
ユニチカ	18,500	385.00	7,122,500		
富士紡ホールディングス	3,200	4,105.00	13,136,000		
日清紡ホールディングス	38,600	920.00	35,512,000		
倉敷紡績	5,600	1,955.00	10,948,000	貸付株式数	1,200株
ダイワボウHD	29,500	1,840.00	54,280,000		
シキボウ	3,700	940.00	3,478,000	貸付株式数	1,100株
日東紡績	9,700	3,615.00	35,065,500	貸付株式数	1,100株
トヨタ紡織	18,700	2,260.00	42,262,000		
マクニカ・富士エレHLDGS	15,200	2,598.00	39,489,600	貸付株式数	1,400株
H a m e e	1,800	1,680.00	3,024,000	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,847.00	8,541,000	貸付株式数	1,100株
ウエルシアHD	34,100	3,590.00	122,419,000	貸付株式数	200株
クリエイトSDH	9,400	3,315.00	31,161,000	貸付株式数	3,700株
バイタルKSKHD	11,100	692.00	7,681,200		
八洲電機	4,500	977.00	4,396,500		
メディアスホールディングス	3,800	1,066.00	4,050,800	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,500	1,916.00	12,454,000		
ジューテックHD	1,400	1,018.00	1,425,200		
丸善CHI HD	5,000	411.00	2,055,000	貸付株式数	2,500株
大光	3,000	690.00	2,070,000	貸付株式数	1,000株
OCHIホールディングス	1,900	1,289.00	2,449,100		
TOKAIホールディングス	31,300	886.00	27,731,800		
黒谷	2,300	915.00	2,104,500	貸付株式数	600株
ミサワ	1,800	718.00	1,292,400		
ティーライフ	1,300	1,505.00	1,956,500	貸付株式数	300株
Cominix	1,300	747.00	971,100	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	460.00	782,000	貸付株式数	400株
三洋貿易	6,400	1,359.00	8,697,600		
チムニー	2,100	1,421.00	2,984,100	貸付株式数	700株

シュッピン	4,600	1,075.00	4,945,000	貸付株式数	1,700株
ビューティガレージ	1,100	4,530.00	4,983,000	貸付株式数	200株
オイシックス・ラ・大地	8,500	3,630.00	30,855,000	貸付株式数	2,500株
ウイン・パートナーズ	4,600	999.00	4,595,400		
ネクステージ	11,600	1,707.00	19,801,200		
ジョイフル本田	18,300	1,358.00	24,851,400	貸付株式数	7,400株
鳥貴族ホールディングス	2,200	1,924.00	4,232,800	貸付株式数	700株
ホットランド	4,600	1,416.00	6,513,600	貸付株式数	1,800株
すかいらーくHD	71,400	1,577.00	112,597,800	貸付株式数	28,500株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,900	1,496.00	4,338,400	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	4,900	1,244.00	6,095,600	貸付株式数	1,400株
日本毛織	19,800	1,003.00	19,859,400	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	12,100	105.00	1,270,500	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,300	456.00	1,048,800	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	7,600	177.00	1,345,200		
ヨシックス	1,300	2,416.00	3,140,800	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパー マーケ	18,400	1,110.00	20,424,000	貸付株式数	7,400株
三栄建築設計	2,800	1,994.00	5,583,200		
野村不動産HLDGS	39,300	2,936.00	115,384,800		
三重交通グループHD	12,400	481.00	5,964,400	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,400	2,017.00	18,959,800		
日本商業開発	4,500	1,868.00	8,406,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーシ ョン	10,700	1,517.00	16,231,900	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,200	3,000.00	3,600,000	貸付株式数	400株
ハウスコム	1,200	1,285.00	1,542,000		
日本管理センター	3,700	1,304.00	4,824,800		
サンセイランディック	1,800	887.00	1,596,600	貸付株式数	700株 (700株)
エストラスト	1,100	679.00	746,900		
フージャースHD	10,400	737.00	7,664,800		
オープンハウス	20,500	5,200.00	106,600,000		
東急不動産HD	174,600	729.00	127,283,400		
飯田GHD	53,500	2,957.00	158,199,500		
イーグランド	1,200	1,031.00	1,237,200		
帝国繊維	7,200	2,122.00	15,278,400	貸付株式数	1,700株
日本コークス工業	57,800	105.00	6,069,000		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,507.00	5,877,300	貸付株式数	1,300株

ミタチ産業	1,100	657.00	722,700	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,400	3,615.00	12,291,000	貸付株式数	200株
あさひ	5,000	1,404.00	7,020,000	貸付株式数	1,900株
日本調剤	3,900	1,600.00	6,240,000		
コスモス薬品	6,500	16,260.00	105,690,000		
シップヘルスケアHD	22,800	2,537.00	57,843,600		
トーエル	3,100	809.00	2,507,900	貸付株式数	100株
ソフトクリエイイトHD	2,600	2,290.00	5,954,000	貸付株式数	600株
オンリー	1,100	470.00	517,000	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	251,000	5,006.00	1,256,506,000		
クリエイイト・レストランツ・ホール	34,700	880.00	30,536,000	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,340.00	2,814,000		
ツルハホールディングス	14,000	14,160.00	198,240,000		
デリカフーズHLDGS	3,500	647.00	2,264,500		
スターティアホールディングス	1,600	1,488.00	2,380,800	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,000	1,632.00	8,160,000	貸付株式数	300株
フェリシモ	1,600	1,408.00	2,252,800	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	15,800	1,813.00	28,645,400		
帝人	60,000	1,762.00	105,720,000	貸付株式数	23,400株
東レ	461,600	762.70	352,062,320		
クラレ	100,700	1,114.00	112,179,800		
旭化成	422,500	1,250.50	528,336,250		
サカイオーベックス	1,700	2,980.00	5,066,000		
TOKYO BASE	6,000	722.00	4,332,000		
稲葉製作所	4,700	1,503.00	7,064,100	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,300	2,306.00	5,303,800		
トーカロ	16,600	1,442.00	23,937,200		
アルファCO	2,200	1,131.00	2,488,200		
SUMCO	82,200	2,664.00	218,980,800	貸付株式数	30,700株
川田テクノロジーズ	1,300	3,605.00	4,686,500		
R S T E C H N O L O G I E S	2,100	6,050.00	12,705,000		
信和	3,500	720.00	2,520,000		
ビーロッド	3,300	617.00	2,036,100	貸付株式数	1,200株
ファーストブラザーズ	1,200	1,016.00	1,219,200	貸付株式数	400株
ハウズドゥ	3,300	1,053.00	3,474,900	貸付株式数	1,200株



シーアールイー	1,800	1,539.00	2,770,200	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,400	2,398.00	3,357,200	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	2,100	5,020.00	10,542,000		
アグレ都市デザイン	1,600	1,044.00	1,670,400	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,200	3,735.00	4,482,000		
テンポイノベーション	2,200	905.00	1,991,000	貸付株式数	500株
グローバルリンクマネジメン ト	1,300	894.00	1,162,200	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	1,861.00	2,605,400		
日本フェルト	3,000	455.00	1,365,000		
イチカワ	800	1,359.00	1,087,200		
エコナックホールディング ス	13,500	92.00	1,242,000		
日東製網	900	1,526.00	1,373,400		
芦森工業	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	500株
アツギ	4,900	621.00	3,042,900		
ウイルプラスHLDGS	1,200	1,217.00	1,460,400	貸付株式数	400株
JMホールディングス	4,900	2,111.00	10,343,900	貸付株式数	1,700株
コメダホールディングス	14,000	2,052.00	28,728,000		
サツドラホールディングス	900	2,069.00	1,862,100		
アレンザホールディングス	4,600	1,256.00	5,777,600	貸付株式数	1,500株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,800	1,883.00	3,389,400	貸付株式数	600株 (600株)
パロックジャパン	4,600	795.00	3,657,000		
クスリのアオキHLDGS	6,400	8,560.00	54,784,000	貸付株式数	2,500株
ダイニク	2,500	764.00	1,910,000		
共和レザー	3,300	717.00	2,366,100		
ピーバンドットコム	1,100	825.00	907,500	貸付株式数	300株
力の源HD	2,300	662.00	1,522,600	貸付株式数	600株
FOOD & LIFE CO MPAN	37,700	4,880.00	183,976,000		
アセンテック	1,800	1,399.00	2,518,200	貸付株式数	500株
セーレン	15,700	2,152.00	33,786,400		
ソトー	1,800	798.00	1,436,400		
東海染工	800	1,112.00	889,600		
小松マテーレ	10,500	957.00	10,048,500	貸付株式数	3,300株
ワコールホールディングス	15,900	2,484.00	39,495,600		
ホギメディカル	8,500	3,495.00	29,707,500	貸付株式数	2,700株
クラウディアHLDGS	2,100	299.00	627,900	貸付株式数	600株

T S Iホールディングス	19,400	338.00	6,557,200		
マツオカコーポレーション	2,000	1,717.00	3,434,000	貸付株式数	800株
ワールド	8,200	1,504.00	12,332,800		
T I S	64,000	2,830.00	181,120,000		
J N Sホールディングス	3,100	602.00	1,866,200	貸付株式数	1,200株
電算システム	2,500	2,961.00	7,402,500		
グリー	42,600	638.00	27,178,800	貸付株式数	15,200株
コーエーテクモHD	17,200	5,330.00	91,676,000		
三菱総合研究所	2,700	3,870.00	10,449,000		
ボルテージ	3,100	493.00	1,528,300	貸付株式数	400株
電算	500	2,393.00	1,196,500		
A G S	3,100	851.00	2,638,100		
ファインデックス	5,600	1,025.00	5,740,000		
ブレインパッド	1,700	4,855.00	8,253,500	貸付株式数	600株
K L a b	12,000	736.00	8,832,000	貸付株式数	4,700株
ポルトゥウィン・ピット クル	8,800	1,147.00	10,093,600		
イーブックイニシアティブ	1,300	3,280.00	4,264,000	貸付株式数	400株
ネクソン	162,100	2,583.00	418,704,300		
アイスタイル	20,300	523.00	10,616,900	貸付株式数	7,700株
エムアップホールディング ス	1,900	3,405.00	6,469,500	貸付株式数	600株
エイチーム	4,900	1,517.00	7,433,300		
エニグモ	6,300	1,332.00	8,391,600		
テクノスジャパン	5,300	621.00	3,291,300		
e n i s h	3,500	524.00	1,834,000		
コロプラ	20,900	860.00	17,974,000	貸付株式数	100株
オルトプラス	4,900	432.00	2,116,800	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	31,600	523.00	16,526,800	貸付株式数	12,300株
クロス・マーケティングG	3,100	717.00	2,222,700	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツH L D G S	3,100	1,580.00	4,898,000	貸付株式数	600株 (600株)
システム情報	5,000	984.00	4,920,000	貸付株式数	1,900株
メディアドゥ	2,700	4,795.00	12,946,500	貸付株式数	900株
じげん	16,200	438.00	7,095,600		
ブイキューブ	3,600	2,669.00	9,608,400	貸付株式数	1,300株
エンカレッジ・テクノジ	1,100	694.00	763,400	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,300	1,671.00	3,843,300	貸付株式数	800株
ディー・エル・イー	4,300	318.00	1,367,400		
フィックスターズ	6,800	892.00	6,065,600	貸付株式数	2,700株

CARTA HOLDINGS	2,800	1,725.00	4,830,000	貸付株式数	1,200株
オブティム	4,600	2,374.00	10,920,400	貸付株式数	1,700株
セレス	2,200	3,685.00	8,107,000	貸付株式数	300株
SHIFT	3,300	16,590.00	54,747,000	貸付株式数	200株
特種東海製紙	3,900	4,375.00	17,062,500		
ティーガイア	6,700	1,958.00	13,118,600	貸付株式数	2,700株
セック	900	2,650.00	2,385,000	貸付株式数	200株
日本アジアグループ	7,300	963.00	7,029,900		
テクマトリックス	10,200	1,775.00	18,105,000		
プロシッパ	1,800	1,352.00	2,433,600		
ガンホー・オンライン・エンター	15,400	2,373.00	36,544,200		
GMOペイメントゲートウェイ	13,600	13,930.00	189,448,000		
ザッパラス	4,000	588.00	2,352,000		
システムリサーチ	1,900	2,062.00	3,917,800	貸付株式数	500株
インターネットイニシアティブ	17,300	3,260.00	56,398,000		
さくらインターネット	7,500	641.00	4,807,500	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,900	1,017.00	1,932,300	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインHD	1,600	5,150.00	8,240,000	貸付株式数	500株 (400株)
SRAホールディングス	3,400	2,741.00	9,319,400		
システムインテグレータ	1,800	648.00	1,166,400		
朝日ネット	6,000	726.00	4,356,000	貸付株式数	300株
eBASE	7,900	876.00	6,920,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,200	1,635.00	11,772,000		
アドソル日進	2,400	2,415.00	5,796,000		
フリービット	4,400	824.00	3,625,600		
コムチュア	6,000	2,379.00	14,274,000		
サイバーコム	1,100	1,545.00	1,699,500	貸付株式数	400株
アステリア	4,800	847.00	4,065,600	貸付株式数	1,800株
アイル	3,700	1,506.00	5,572,200		
王子ホールディングス	288,000	647.00	186,336,000		
日本製紙	28,500	1,262.00	35,967,000		
三菱製紙	7,800	365.00	2,847,000		
北越コーポレーション	45,900	581.00	26,667,900	貸付株式数	14,300株
中越パルプ	2,300	1,222.00	2,810,600		
巴川製紙	2,100	806.00	1,692,600		

大王製紙	30,900	1,767.00	54,600,300		
阿波製紙	1,600	422.00	675,200		
マークラインズ	2,900	3,085.00	8,946,500		
メディカル・データ・ビジ	7,500	2,177.00	16,327,500	貸付株式数	2,800株
gumi	9,200	892.00	8,206,400	貸付株式数	3,500株
ショーケース	1,800	808.00	1,454,400	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	1,600	1,274.00	2,038,400	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,100	2,742.00	5,758,200	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	3,200	2,112.00	6,758,400	貸付株式数	1,100株
P C Iホールディングス	2,500	1,233.00	3,082,500	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	1,400	1,766.00	2,472,400	貸付株式数	500株 (500株)
アイビーシー	1,200	1,004.00	1,204,800	貸付株式数	200株
ネオジャパン	1,300	1,596.00	2,074,800	貸付株式数	400株
P R T I M E S	1,600	3,355.00	5,368,000	貸付株式数	500株
ラクス	19,500	2,292.00	44,694,000		
ランドコンピュータ	1,000	1,133.00	1,133,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	5,170.00	4,653,000		
オープンドア	4,000	2,470.00	9,880,000	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,500	788.00	1,970,000	貸付株式数	800株
アカツキ	2,700	3,750.00	10,125,000		
ベネフィットジャパン	700	2,053.00	1,437,100		
UBICOMホールディングス	1,800	3,405.00	6,129,000		
カナミックネットワーク	7,000	670.00	4,690,000	貸付株式数	1,900株
ノムラシステムコーポレーション	3,300	302.00	996,600	貸付株式数	1,100株
レンゴー	65,900	941.00	62,011,900		
トーモク	3,800	1,976.00	7,508,800		
ザ・パック	4,800	2,786.00	13,372,800	貸付株式数	800株
チェンジ	12,000	2,996.00	35,952,000		
シンクロ・フード	5,200	399.00	2,074,800		
オークネット	3,800	1,426.00	5,418,800		
セグエグループ	1,800	1,178.00	2,120,400		
エイトレッド	1,300	2,258.00	2,935,400	貸付株式数	400株
AOI TYO HOLDINGS	6,300	898.00	5,657,400		
マクロミル	13,000	864.00	11,232,000		
ビーグリー	1,600	1,478.00	2,364,800	貸付株式数	500株

オロク	2,200	3,720.00	8,184,000	
ユーザーローカル	1,000	4,270.00	4,270,000	
テモナ	1,900	1,117.00	2,122,300	貸付株式数 500株
ニーズウェル	1,400	609.00	852,600	貸付株式数 100株
サインポスト	1,600	924.00	1,478,400	貸付株式数 600株
昭和電工	48,500	3,590.00	174,115,000	
住友化学	502,700	607.00	305,138,900	
住友精化	3,100	3,585.00	11,113,500	
日産化学	35,200	5,610.00	197,472,000	
ラサ工業	2,200	1,913.00	4,208,600	貸付株式数 200株
クレハ	5,500	6,210.00	34,155,000	
多木化学	2,500	5,310.00	13,275,000	貸付株式数 900株
テイカ	4,500	1,349.00	6,070,500	
石原産業	11,600	1,068.00	12,388,800	
片倉コープアグリ	1,600	1,213.00	1,940,800	
日本曹達	8,900	3,445.00	30,660,500	
東ソー	98,500	1,957.00	192,764,500	
トクヤマ	19,000	2,307.00	43,833,000	
セントラル硝子	11,800	2,108.00	24,874,400	
東亜合成	38,500	1,183.00	45,545,500	
大阪ソーダ	6,300	2,451.00	15,441,300	
関東電化	14,800	1,012.00	14,977,600	
デンカ	23,400	3,790.00	88,686,000	
イビデン	31,400	5,740.00	180,236,000	
信越化学	118,000	19,175.00	2,262,650,000	
日本カ - バイド	2,200	1,298.00	2,855,600	
堺 化 学	4,400	1,871.00	8,232,400	
第一稀元素化学工	6,800	1,785.00	12,138,000	
エア・ウォーター	65,400	1,780.00	116,412,000	
日本酸素HLDGS	52,600	2,134.00	112,248,400	
日本化学工業	1,900	2,930.00	5,567,000	
東邦アセチレン	1,200	1,179.00	1,414,800	
日本パ - カライジング	31,500	1,094.00	34,461,000	
高压ガス	9,800	652.00	6,389,600	
チタン工業	900	1,885.00	1,696,500	
四国化成	8,000	1,278.00	10,224,000	
戸田工業	1,400	2,270.00	3,178,000	
ステラ ケミファ	3,500	3,105.00	10,867,500	貸付株式数 400株
保土谷化学	1,900	3,910.00	7,429,000	
日本触媒	11,500	5,560.00	63,940,000	

大日精化	5,000	2,354.00	11,770,000	
カネカ	16,400	4,310.00	70,684,000	
協和キリン	65,500	3,775.00	247,262,500	
三菱瓦斯化学	64,100	2,491.00	159,673,100	
三井化学	55,100	3,770.00	207,727,000	
J S R	64,400	3,280.00	211,232,000	
東京応化工業	11,000	7,180.00	78,980,000	
大阪有機化学	6,000	4,465.00	26,790,000	
三菱ケミカルH L D G S	426,200	889.10	378,934,420	
K Hネオケム	10,700	2,655.00	28,408,500	
ダイセル	85,600	895.00	76,612,000	
住友ベークライト	10,100	4,970.00	50,197,000	貸付株式数 3,900株
積水化学	134,600	1,878.00	252,778,800	
日本ゼオン	57,800	1,547.00	89,416,600	
アイカ工業	17,700	3,985.00	70,534,500	
宇部興産	32,200	2,323.00	74,800,600	
積水樹脂	10,200	2,129.00	21,715,800	
タキロンシーアイ	13,800	580.00	8,004,000	
旭有機材	3,600	1,349.00	4,856,400	
ニチバン	3,200	1,755.00	5,616,000	貸付株式数 1,200株
リケンテクノス	15,100	594.00	8,969,400	
大倉工業	3,000	2,397.00	7,191,000	貸付株式数 100株
積水化成成品	7,900	611.00	4,826,900	
群栄化学	1,400	2,440.00	3,416,000	
タイガース ポリマー	2,200	444.00	976,800	貸付株式数 700株
ミライアル	1,900	1,394.00	2,648,600	
ダイキアクシス	2,600	870.00	2,262,000	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	13,100	688.00	9,012,800	貸付株式数 5,000株
竹本容器	2,700	979.00	2,643,300	貸付株式数 800株
森六ホールディングス	3,300	2,233.00	7,368,900	貸付株式数 700株
日本化薬	39,200	1,045.00	40,964,000	
カーリットホールディングス	6,300	738.00	4,649,400	
E P Sホールディングス	8,500	1,798.00	15,283,000	貸付株式数 1,000株
ソルクシーズ	2,600	1,025.00	2,665,000	貸付株式数 900株
レグス	1,700	2,930.00	4,981,000	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	23,300	721.00	16,799,300	
フェイス	2,300	805.00	1,851,500	
プロトコーポレーション	7,900	1,201.00	9,487,900	
ハイマックス	2,000	1,079.00	2,158,000	

アミューズ	3,500	2,393.00	8,375,500	
野村総合研究所	115,800	3,620.00	419,196,000	
ドリームインキュベータ	2,100	960.00	2,016,000	
サイバネットシステム	4,600	825.00	3,795,000	
クイック	3,800	1,230.00	4,674,000	貸付株式数 700株
T A C	4,000	238.00	952,000	
C Eホールディングス	3,600	531.00	1,911,600	
日本システム技術	1,200	1,608.00	1,929,600	
電通グループ	69,900	3,870.00	270,513,000	貸付株式数 6,500株
インテージホールディングス	8,000	1,583.00	12,664,000	貸付株式数 1,000株
テイクアンドギヴニーズ	3,400	1,046.00	3,556,400	貸付株式数 300株
東邦システムサイエンス	1,200	921.00	1,105,200	貸付株式数 600株
ぴあ	1,800	3,445.00	6,201,000	貸付株式数 700株
イオンファンタジー	2,400	2,318.00	5,563,200	貸付株式数 900株
ソースネクスト	31,100	319.00	9,920,900	
シーティーエス	7,100	880.00	6,248,000	貸付株式数 1,300株
ネクシーズグループ	2,200	931.00	2,048,200	貸付株式数 800株
インフォコム	5,900	3,120.00	18,408,000	
メディカルシステムネットワーク	5,800	723.00	4,193,400	貸付株式数 700株
日本精化	4,700	1,475.00	6,932,500	
扶桑化学工業	5,100	4,080.00	20,808,000	
トリケミカル	6,100	3,525.00	21,502,500	貸付株式数 2,300株
H E R O Z	1,800	2,351.00	4,231,800	貸付株式数 700株
ラクスル	7,000	5,210.00	36,470,000	貸付株式数 2,000株
F I G	6,800	290.00	1,972,000	貸付株式数 800株
システムサポート	1,900	1,417.00	2,692,300	貸付株式数 700株
A D E K A	29,400	2,008.00	59,035,200	
日油	24,200	5,780.00	139,876,000	
ミヨシ油脂	2,300	1,253.00	2,881,900	
新日本理化	12,300	275.00	3,382,500	貸付株式数 900株
ハリマ化成グループ	4,700	904.00	4,248,800	
イーソル	3,400	1,140.00	3,876,000	貸付株式数 1,300株
アルテリア・ネットワークス	7,500	1,667.00	12,502,500	
東海ソフト	1,000	1,535.00	1,535,000	貸付株式数 200株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,600	2,327.00	3,723,200	
トビラシステムズ	800	1,429.00	1,143,200	貸付株式数 300株

Sansan	5,700	9,400.00	53,580,000	貸付株式数	1,700株
花王	156,000	6,885.00	1,074,060,000		
第一工業製薬	2,200	3,350.00	7,370,000		
石原ケミカル	1,700	2,151.00	3,656,700	貸付株式数	700株
日華化学	2,300	1,241.00	2,854,300		
ニイタカ	1,400	2,464.00	3,449,600	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	5,490.00	21,411,000		
武田薬品	542,200	3,800.00	2,060,360,000		
アステラス製薬	565,000	1,944.50	1,098,642,500		
大日本住友製薬	48,300	2,282.00	110,220,600		
塩野義製薬	82,000	5,837.00	478,634,000		
わかもと製薬	8,200	322.00	2,640,400	貸付株式数	3,000株
日本新薬	18,500	8,650.00	160,025,000		
ピオフェルミン製薬	1,300	3,105.00	4,036,500		
中外製薬	203,800	4,555.00	928,309,000		
科研製薬	11,200	4,755.00	53,256,000		
エーザイ	71,800	11,405.00	818,879,000		
理研ビタミン	6,400	1,529.00	9,785,600		
ロート製薬	31,000	2,894.00	89,714,000		
小野薬品	149,600	2,523.00	377,440,800		
久光製薬	18,900	5,860.00	110,754,000		
有機合成薬品	5,100	341.00	1,739,100	貸付株式数	2,000株
持田製薬	8,900	3,740.00	33,286,000		
参天製薬	113,600	1,533.00	174,148,800		
扶桑薬品	2,100	2,322.00	4,876,200	貸付株式数	200株
日本ケミファ	700	2,398.00	1,678,600		
ツムラ	21,900	3,595.00	78,730,500	貸付株式数	6,800株
日医工	18,700	944.00	17,652,800		
テルモ	199,700	4,589.00	916,423,300		
HUGグループHD	17,700	2,943.00	52,091,100		
キッセイ薬品工業	11,400	2,229.00	25,410,600	貸付株式数	1,300株
生化学工業	11,400	1,118.00	12,745,200		
栄研化学	11,600	2,166.00	25,125,600	貸付株式数	2,900株
日水製薬	2,300	976.00	2,244,800		
鳥居薬品	4,100	2,542.00	10,422,200	貸付株式数	100株
JCRファーマ	18,500	3,560.00	65,860,000		
東和薬品	9,300	2,603.00	24,207,900		
富士製薬工業	4,500	1,182.00	5,319,000		
ゼリア新薬工業	11,900	2,106.00	25,061,400	貸付株式数	4,900株
第一三共	512,200	2,620.00	1,341,964,000		



キョーリン製薬HD	14,600	1,743.00	25,447,800		
大幸薬品	8,300	1,057.00	8,773,100	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,200	3,345.00	14,049,000	貸付株式数	700株
大塚ホールディングス	135,100	4,790.00	647,129,000		
大正製薬HD	15,400	6,270.00	96,558,000	貸付株式数	5,400株
ペプチドリーム	33,700	5,260.00	177,262,000		
大日本塗料	7,000	841.00	5,887,000		
日本ペイントHOLD	263,600	1,713.00	451,546,800		
関西ペイント	71,800	2,941.00	211,163,800	貸付株式数	28,600株
神東塗料	5,800	197.00	1,142,600		
中国塗料	15,600	922.00	14,383,200		
日本特殊塗料	4,800	1,112.00	5,337,600	貸付株式数	300株
藤倉化成	8,200	525.00	4,305,000		
太陽ホールディングス	4,800	5,330.00	25,584,000		
D I C	26,700	2,908.00	77,643,600	貸付株式数	10,600株
サカタインクス	13,600	1,070.00	14,552,000		
東洋インキSCホールディングン	13,100	2,083.00	27,287,300	貸付株式数	5,200株
T & K TOKA	4,600	807.00	3,712,200		
アルプス技研	5,500	1,997.00	10,983,500		
サニックス	10,500	396.00	4,158,000	貸付株式数	3,900株
ダイオーズ	800	1,028.00	822,400	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,200	722.00	4,476,400		
オリエンタルランド	66,200	16,340.00	1,081,708,000		
フォーカスシステムズ	4,200	1,050.00	4,410,000		
ダスキン	14,400	2,562.00	36,892,800	貸付株式数	4,500株
パーク24	34,600	2,181.00	75,462,600	貸付株式数	13,700株
明光ネットワークジャパン	8,100	593.00	4,803,300	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,688.00	4,895,200	貸付株式数	700株
クレスコ	4,300	1,772.00	7,619,600		
フジ・メディア・HD	66,000	1,276.00	84,216,000		
秀英予備校	2,000	402.00	804,000	貸付株式数	600株
田谷	1,500	570.00	855,000	貸付株式数	600株
ラウンドワン	21,500	1,438.00	30,917,000		
リゾートトラスト	28,700	1,809.00	51,918,300	貸付株式数	11,400株
オービック	20,100	21,270.00	427,527,000		
ジャストシステム	9,100	6,320.00	57,512,000	貸付株式数	2,400株
TDCソフト	5,600	1,005.00	5,628,000	貸付株式数	1,900株
Zホールディングス	869,700	524.80	456,418,560		
ビー・エム・エル	8,000	3,665.00	29,320,000	貸付株式数	200株

トレンドマイクロ	34,000	5,790.00	196,860,000	
りらいあコミュニケーション	9,500	1,327.00	12,606,500	貸付株式数 2,600株
IDホールディングス	2,400	1,350.00	3,240,000	
リソー教育	33,700	317.00	10,682,900	
日本オラクル	12,900	10,040.00	129,516,000	
早稲田アカデミー	2,700	915.00	2,470,500	貸付株式数 600株
アルファシステムズ	1,700	3,715.00	6,315,500	貸付株式数 600株
フューチャー	7,900	2,126.00	16,795,400	
CAC HOLDINGS	4,100	1,450.00	5,945,000	
SBテクノロジー	2,600	3,085.00	8,021,000	貸付株式数 900株
トーセ	1,700	814.00	1,383,800	貸付株式数 300株
ユー・エス・エス	69,200	1,867.00	129,196,400	
オービックビジネスC	6,500	6,410.00	41,665,000	貸付株式数 2,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	29,100	3,385.00	98,503,500	
アイティフォー	8,200	805.00	6,601,000	貸付株式数 3,100株
東京個別指導学院	5,700	615.00	3,505,500	貸付株式数 900株
東計電算	900	4,845.00	4,360,500	
サイバーエージェント	154,100	2,233.00	344,105,300	
楽天グループ	291,400	1,313.00	382,608,200	
エックスネット	1,000	1,021.00	1,021,000	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,536.00	5,222,400	
テー・オー・ダブリュー	10,500	338.00	3,549,000	貸付株式数 4,200株
大塚商会	34,500	5,910.00	203,895,000	貸付株式数 13,500株
サイボウズ	7,600	2,612.00	19,851,200	貸付株式数 1,100株
山田コンサルティングGP	3,600	1,174.00	4,226,400	貸付株式数 400株
セントラルスポーツ	2,300	2,560.00	5,888,000	貸付株式数 100株
パラカ	1,600	1,631.00	2,609,600	貸付株式数 600株
電通国際情報S	8,000	4,015.00	32,120,000	
ACCESS	7,800	884.00	6,895,200	貸付株式数 2,400株
デジタルガレージ	10,500	4,750.00	49,875,000	貸付株式数 3,800株
イーエムシステムズ	10,400	902.00	9,380,800	貸付株式数 4,100株
ウェザーニューズ	2,000	5,850.00	11,700,000	
CIJ	4,000	846.00	3,384,000	
ビジネスエンジニアリング	600	3,270.00	1,962,000	貸付株式数 200株
日本エンタープライズ	8,000	219.00	1,752,000	貸付株式数 2,700株
WOWOW	3,300	2,435.00	8,035,500	貸付株式数 1,200株 (400株)
スカラ	5,800	820.00	4,756,000	貸付株式数 2,100株

インテリジェント ウェイブ	3,700	669.00	2,475,300	
フルキャストホールディングス	5,400	2,188.00	11,815,200	
エン・ジャパン	11,100	3,905.00	43,345,500	
あすか製薬HD	7,800	1,022.00	7,971,600	
サワイグループHD	14,300	5,000.00	71,500,000	
富士フイルムHLDS	114,600	7,880.00	903,048,000	
コニカミノルタ	132,800	642.00	85,257,600	
資生堂	129,600	8,160.00	1,057,536,000	
ライオン	84,900	1,981.00	168,186,900	
高砂香料	4,100	2,677.00	10,975,700	貸付株式数 500株
マンダム	13,600	2,160.00	29,376,000	貸付株式数 5,300株
ミルボン	8,800	6,600.00	58,080,000	
ファンケル	24,000	3,650.00	87,600,000	
コーセー	12,300	18,240.00	224,352,000	
コタ	4,500	1,413.00	6,358,500	
シーボン	700	1,955.00	1,368,500	
ポーラ・オルビスHD	28,000	3,045.00	85,260,000	
ノエビアホールディングス	5,400	5,350.00	28,890,000	
アジュバンコスメジャパン	1,900	1,031.00	1,958,900	貸付株式数 500株
エステー	4,200	1,782.00	7,484,400	貸付株式数 400株
アグロカネショウ	2,500	1,394.00	3,485,000	
コニシ	10,600	1,538.00	16,302,800	貸付株式数 1,800株
長谷川香料	11,100	2,300.00	25,530,000	
星光PMC	3,500	871.00	3,048,500	
小林製薬	18,400	9,550.00	175,720,000	
荒川化学工業	5,000	1,222.00	6,110,000	貸付株式数 2,000株
メック	4,600	2,880.00	13,248,000	貸付株式数 1,700株 (1,500株)
日本高純度化学	1,900	2,777.00	5,276,300	
タカラバイオ	17,100	2,979.00	50,940,900	
JCU	7,400	3,575.00	26,455,000	
新田ゼラチン	4,000	642.00	2,568,000	
OATアグリオ	1,200	1,453.00	1,743,600	
デクセリアルズ	18,700	2,200.00	41,140,000	
アース製薬	5,000	6,710.00	33,550,000	貸付株式数 1,900株
北興化学	6,300	1,010.00	6,363,000	
大成ラミック	2,400	2,740.00	6,576,000	
クミアイ化学	26,900	946.00	25,447,400	貸付株式数 4,400株

日本農薬	11,500	526.00	6,049,000	
富士興産	2,100	1,218.00	2,557,800	
ニチレキ	7,700	1,317.00	10,140,900	
ユシロ化学	3,400	1,194.00	4,059,600	
ビーピー・カストロール	2,300	1,397.00	3,213,100	
富士石油	16,900	280.00	4,732,000	貸付株式数 6,200株
MORESCO	2,100	1,128.00	2,368,800	
出光興産	72,100	2,729.00	196,760,900	
ENEOSホールディングス	976,500	470.80	459,736,200	
コスモエネルギーHLDGS	20,700	2,455.00	50,818,500	貸付株式数 500株
横浜ゴム	37,500	2,351.00	88,162,500	
TOYO TIRE	34,400	2,330.00	80,152,000	
ブリヂストン	173,100	4,997.00	864,980,700	貸付株式数 68,600株
住友ゴム	58,400	1,527.00	89,176,800	
藤倉コンポジット	5,500	487.00	2,678,500	
オカモト	3,900	4,265.00	16,633,500	
アキレス	4,500	1,385.00	6,232,500	
フコク	2,800	964.00	2,699,200	貸付株式数 1,100株
ニッタ	6,800	2,742.00	18,645,600	
クリエートメディック	1,800	1,010.00	1,818,000	
住友理工	12,300	723.00	8,892,900	
三ツ星ベルト	7,700	1,774.00	13,659,800	貸付株式数 400株
バンドー化学	11,000	883.00	9,713,000	
AGC	59,900	4,825.00	289,017,500	
日本板硝子	34,300	655.00	22,466,500	
石塚硝子	1,000	1,936.00	1,936,000	貸付株式数 400株
有沢製作所	9,000	912.00	8,208,000	貸付株式数 3,300株
日本山村硝子	2,400	938.00	2,251,200	
日本電気硝子	24,100	2,664.00	64,202,400	
オハラ	2,700	1,519.00	4,101,300	貸付株式数 1,000株
住友大阪セメント	11,600	3,040.00	35,264,000	
太平洋セメント	38,500	2,455.00	94,517,500	
リソルホールディングス	700	4,000.00	2,800,000	
日本ヒューム	5,600	722.00	4,043,200	
日本コンクリート	14,600	338.00	4,934,800	
三谷セキサン	3,000	4,105.00	12,315,000	
アジアパイルHD	9,600	490.00	4,704,000	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	64,000	1,638.00	104,832,000	

日本カーボン	3,700	4,395.00	16,261,500	貸付株式数	300株
東洋炭素	3,900	2,662.00	10,381,800	貸付株式数	400株
ノリタケ	3,600	4,305.00	15,498,000		
TOTO	46,600	6,140.00	286,124,000		
日本碍子	71,200	1,978.00	140,833,600		
日本特殊陶業	49,700	1,694.00	84,191,800		
ダントーホールディングス	5,700	276.00	1,573,200	貸付株式数	1,100株
MARUWA	2,300	10,950.00	25,185,000	貸付株式数	200株
品川リフラクトリーズ	1,500	3,835.00	5,752,500		
黒崎播磨	1,100	4,465.00	4,911,500		
ヨータイ	4,700	1,144.00	5,376,800		
イソライト	2,900	638.00	1,850,200		
東京窯業	7,700	325.00	2,502,500		
ニッカトー	2,900	704.00	2,041,600		
フジミインコーポレーテッド	5,300	5,160.00	27,348,000		
クニミネ工業	2,200	1,140.00	2,508,000		
エーアンドエーマテリアル	900	1,024.00	921,600		
ニチアス	16,500	2,815.00	46,447,500	貸付株式数	2,400株
日本製鉄	307,600	1,921.50	591,053,400		
神戸製鋼所	118,600	737.00	87,408,200		
中山製鋼所	8,400	426.00	3,578,400		
合同製鐵	3,400	1,687.00	5,735,800		
JFEホールディングス	186,400	1,342.00	250,148,800		
東京製鐵	25,500	1,146.00	29,223,000		
共英製鋼	7,200	1,480.00	10,656,000		
大和工業	13,800	3,790.00	52,302,000		
東京鐵鋼	2,700	1,588.00	4,287,600		
大阪製鐵	3,300	1,143.00	3,771,900	貸付株式数	100株
淀川製鋼所	8,400	2,280.00	19,152,000	貸付株式数	400株
丸一鋼管	20,900	2,767.00	57,830,300		
モリ工業	1,900	2,493.00	4,736,700		
大同特殊鋼	10,600	5,630.00	59,678,000	貸付株式数	4,100株
日本高周波	2,300	422.00	970,600		
日本冶金工	4,900	2,341.00	11,470,900		
山陽特殊製鋼	7,700	1,603.00	12,343,100	貸付株式数	1,600株
愛知製鋼	3,500	3,165.00	11,077,500		
日立金属	61,200	2,123.00	129,927,600		
日本金属	1,700	986.00	1,676,200	貸付株式数	500株
大平洋金属	4,500	1,837.00	8,266,500		

新日本電工	43,200	305.00	13,176,000	
栗本鉄工所	2,900	1,675.00	4,857,500	
虹 技	800	1,171.00	936,800	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	700	1,315.00	920,500	
日本製鋼所	19,700	2,981.00	58,725,700	
三菱製鋼	5,000	897.00	4,485,000	貸付株式数 1,700株
日亜鋼業	8,800	297.00	2,613,600	
日本精線	1,000	4,625.00	4,625,000	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,100	1,276.00	3,955,600	貸付株式数 1,000株
大紀アルミニウム	9,800	1,182.00	11,583,600	貸付株式数 1,900株
日本軽金属HD	17,400	1,861.00	32,381,400	
三井金属	17,400	3,140.00	54,636,000	
東邦亜鉛	3,600	1,980.00	7,128,000	
三菱マテリアル	42,300	2,243.00	94,878,900	
住友鉱山	82,300	4,702.00	386,974,600	
DOWAホールディングス	16,300	4,420.00	72,046,000	
古河機金	10,300	1,285.00	13,235,500	
エス・サイエンス	35,400	40.00	1,416,000	貸付株式数 7,000株
大阪チタニウム	6,700	835.00	5,594,500	貸付株式数 2,600株
東邦チタニウム	11,900	1,087.00	12,935,300	貸付株式数 1,900株
UACJ	9,700	2,779.00	26,956,300	
CKサンエツ	1,300	3,280.00	4,264,000	貸付株式数 500株
古河電工	20,100	2,854.00	57,365,400	
住友電工	223,900	1,694.50	379,398,550	
フジクラ	78,500	480.00	37,680,000	
昭和電線HLDGS	6,300	1,696.00	10,684,800	
東京特殊電線	700	2,520.00	1,764,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	11,600	565.00	6,554,000	
カナレ電気	900	1,811.00	1,629,900	貸付株式数 400株
平河ビューテック	3,600	1,189.00	4,280,400	
リョービ	7,700	1,620.00	12,474,000	貸付株式数 1,100株
アーステイ	8,100	524.00	4,244,400	
アサヒHD	24,600	2,290.00	56,334,000	貸付株式数 1,800株
東洋製罐グループHD	40,700	1,655.00	67,358,500	
ホッカンホールディングス	3,100	1,411.00	4,374,100	
コロナ	3,700	930.00	3,441,000	
横河ブリッジHLDGS	11,200	2,079.00	23,284,800	
駒井ハルテック	1,400	1,795.00	2,513,000	
高田機工	600	2,714.00	1,628,400	貸付株式数 100株
三和ホールディングス	60,700	1,382.00	83,887,400	

文化シヤツタ -	19,000	1,069.00	20,311,000	
三協立山	8,200	805.00	6,601,000	
アルインコ	4,100	976.00	4,001,600	貸付株式数 100株
東洋シヤツタ -	1,500	680.00	1,020,000	
L I X I L	88,800	2,925.00	259,740,000	
日本ファイルコン	4,200	498.00	2,091,600	
ノーリツ	13,200	1,916.00	25,291,200	
長府製作所	6,500	2,044.00	13,286,000	貸付株式数 100株
リンナイ	12,600	10,930.00	137,718,000	
ユニプレス	10,600	991.00	10,504,600	
ダイニチ工業	3,800	795.00	3,021,000	
日東精工	8,600	552.00	4,747,200	貸付株式数 1,800株
三洋工業	700	1,869.00	1,308,300	
岡 部	12,200	664.00	8,100,800	貸付株式数 1,700株
ジーテクト	7,900	1,577.00	12,458,300	
東 プ レ	11,900	1,614.00	19,206,600	
高周波熱錬	11,800	584.00	6,891,200	貸付株式数 500株
東京製綱	2,900	1,176.00	3,410,400	
サンコール	5,400	454.00	2,451,600	貸付株式数 2,100株
モリテックスチル	5,400	521.00	2,813,400	貸付株式数 2,100株
パイオラックス	9,300	1,514.00	14,080,200	
エイチワン	6,200	805.00	4,991,000	
日本発条	63,400	925.00	58,645,000	
中央発條	3,500	1,227.00	4,294,500	貸付株式数 1,000株
アドバネクス	900	1,324.00	1,191,600	貸付株式数 300株
三浦工業	27,900	4,965.00	138,523,500	
タ ク マ	22,300	1,770.00	39,471,000	
テクノプロ・ホールディング	12,400	7,850.00	97,340,000	
アトラグループ	1,800	335.00	603,000	貸付株式数 600株
インターワークス	1,500	419.00	628,500	
アイ・アールジャパンHD	2,600	13,940.00	36,244,000	
K e e P e r 技研	4,200	2,579.00	10,831,800	貸付株式数 1,500株
ファーストロジック	2,000	760.00	1,520,000	貸付株式数 400株
三機サービス	1,500	1,051.00	1,576,500	貸付株式数 400株
G u n o s y	4,500	973.00	4,378,500	
デザインワン・ジャパン	3,400	229.00	778,600	貸付株式数 600株
イー・ガーディアン	3,200	2,798.00	8,953,600	
リブセンス	6,500	234.00	1,521,000	貸付株式数 1,500株 (1,300株)

ジャパンマテリアル	18,800	1,349.00	25,361,200	貸付株式数	1,100株
ベクトル	7,900	959.00	7,576,100		
ウチヤマホールディングス	3,000	403.00	1,209,000		
チャームケアコーポレーション	5,100	1,191.00	6,074,100		
キャリアリンク	2,200	2,349.00	5,167,800	貸付株式数	800株
I B J	5,400	1,175.00	6,345,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	2,300	1,770.00	4,071,000		
バリューHR	2,600	1,747.00	4,542,200	貸付株式数	900株
M & Aキャピタルパートナー	5,200	4,750.00	24,700,000		
ライドオンエクスプレスHD	2,600	1,514.00	3,936,400	貸付株式数	900株
E R Iホールディングス	1,500	610.00	915,000	貸付株式数	500株
アビスト	1,000	2,910.00	2,910,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクス	3,600	2,298.00	8,272,800		
ウィルグループ	4,600	1,015.00	4,669,000	貸付株式数	1,600株
エスクローAJ	9,900	249.00	2,465,100		
リクルートホールディングス	446,100	5,739.00	2,560,167,900		
エラン	9,000	1,298.00	11,682,000		
ツガミ	13,600	1,678.00	22,820,800	貸付株式数	1,100株
オークマ	7,500	5,570.00	41,775,000		
芝浦機械	6,700	2,539.00	17,011,300		
アマダ	94,400	1,141.00	107,710,400		
アイダエンジニア	16,200	870.00	14,094,000		
滝澤鉄工所	1,800	1,130.00	2,034,000		
F U J I	25,800	2,580.00	66,564,000		
牧野フライス	7,500	4,540.00	34,050,000	貸付株式数	1,100株
オーエスジー	31,400	1,895.00	59,503,000		
ダイジェット	700	1,301.00	910,700		
旭ダイヤモンド	16,300	524.00	8,541,200		
D M G 森精機	41,200	1,957.00	80,628,400		
ソディック	16,000	1,117.00	17,872,000		
ディスコ	8,700	35,100.00	305,370,000		
日東工器	3,200	1,827.00	5,846,400		
日進工具	5,100	1,517.00	7,736,700	貸付株式数	600株
パンチ工業	5,400	643.00	3,472,200		
富士ダイス	2,800	646.00	1,808,800	貸付株式数	100株



土木管理総合試験	3,100	381.00	1,181,100	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	4,400	417.00	1,834,800	貸付株式数	1,200株
日本郵政	469,700	907.70	426,346,690		
ベルシステム24HLDGS	10,400	1,769.00	18,397,600	貸付株式数	3,800株
鎌倉新書	6,600	1,069.00	7,055,400	貸付株式数	2,400株 (1,900株)
SMN	1,900	799.00	1,518,100	貸付株式数	500株
一蔵	900	448.00	403,200		
グローバルキッズCOMP	1,300	1,005.00	1,306,500		
エアトリ	4,200	2,953.00	12,402,600	貸付株式数	1,400株
アトラエ	4,400	2,114.00	9,301,600	貸付株式数	1,600株
ストライク	2,400	4,305.00	10,332,000	貸付株式数	900株
ソラスト	15,700	1,383.00	21,713,100		
セラク	2,200	2,256.00	4,963,200	貸付株式数	700株
インソース	6,300	2,057.00	12,959,100		
豊田自動織機	52,700	9,800.00	516,460,000		
豊和工業	3,800	817.00	3,104,600		
OKK	2,600	408.00	1,060,800		
石川製作所	1,800	1,699.00	3,058,200	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,900	530.00	2,067,000		
津田駒工業	1,200	899.00	1,078,800	貸付株式数	100株
エンシュウ	1,400	895.00	1,253,000		
島精機製作所	9,300	2,012.00	18,711,600	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,100	2,546.00	20,622,600	貸付株式数	200株
NCホールディングス	2,100	1,047.00	2,198,700		
イワキポンプ	4,000	1,015.00	4,060,000		
フリーー	6,500	1,259.00	8,183,500		
ヤマシンフィルタ	13,300	742.00	9,868,600	貸付株式数	5,100株
日阪製作所	8,000	816.00	6,528,000		
やまびこ	12,500	1,235.00	15,437,500		
平田機工	3,000	6,770.00	20,310,000	貸付株式数	100株
ペガサスマシン製造	6,300	489.00	3,080,700		
マルマエ	2,700	2,365.00	6,385,500	貸付株式数	900株
タツモ	2,800	1,752.00	4,905,600	貸付株式数	1,100株
ナブテスコ	37,900	4,610.00	174,719,000	貸付株式数	15,600株
三井海洋開発	6,800	2,222.00	15,109,600		
レオン自動機	6,300	1,424.00	8,971,200	貸付株式数	500株
SMC	19,100	64,690.00	1,235,579,000		
ホソカワミクロン	2,300	6,000.00	13,800,000		

ユニオンツール	2,400	3,980.00	9,552,000	貸付株式数	900株
オйлレス工業	8,900	1,561.00	13,892,900	貸付株式数	3,500株
日精エーエスビー	2,100	5,280.00	11,088,000		
サト - ホールディングス	8,500	2,627.00	22,329,500		
技研製作所	5,700	4,610.00	26,277,000		
日本エアーテック	2,300	1,362.00	3,132,600	貸付株式数	300株
カワタ	1,800	889.00	1,600,200		
日精樹脂工業	5,000	1,330.00	6,650,000		
オカダアイヨン	2,100	1,286.00	2,700,600		
ワイエイシイホールディングス	2,800	1,119.00	3,133,200	貸付株式数	1,000株
小松製作所	295,000	3,042.00	897,390,000		
住友重機械	37,200	3,210.00	119,412,000		
日立建機	30,500	3,425.00	104,462,500		
日工	10,000	698.00	6,980,000		
巴工業	2,500	2,289.00	5,722,500		
井関農機	6,200	1,454.00	9,014,800		
TOWA	6,100	2,260.00	13,786,000	貸付株式数	1,300株
丸山製作所	1,300	1,811.00	2,354,300		
北川鉄工所	2,700	1,688.00	4,557,600		
シンニッタン	8,500	256.00	2,176,000	貸付株式数	2,600株
ローツェ	2,900	10,390.00	30,131,000	貸付株式数	1,100株
タカキタ	2,200	646.00	1,421,200	貸付株式数	300株
クボタ	342,400	2,281.50	781,185,600		
荏原実業	1,700	6,250.00	10,625,000		
東洋エンジニア	9,000	715.00	6,435,000	貸付株式数	3,400株
三菱化工機	2,200	2,692.00	5,922,400	貸付株式数	800株
月島機械	11,600	1,189.00	13,792,400		
帝国電機製作所	4,500	1,272.00	5,724,000		
東京機械	3,400	736.00	2,502,400	貸付株式数	800株
新東工業	14,600	776.00	11,329,600		
渋谷工業	5,600	3,335.00	18,676,000	貸付株式数	100株
アイチコーポレーション	11,000	854.00	9,394,000	貸付株式数	3,000株
小森コーポレーション	16,100	844.00	13,588,400	貸付株式数	2,900株
鶴見製作所	4,900	1,776.00	8,702,400		
住友精密	900	2,501.00	2,250,900		
日本ギア工業	2,400	321.00	770,400	貸付株式数	700株
酒井重工業	1,100	2,557.00	2,812,700		
荏原製作所	27,100	5,350.00	144,985,000		
石井鉄工所	900	3,070.00	2,763,000	貸付株式数	200株

西島製作所	6,600	884.00	5,834,400	
北越工業	6,700	1,125.00	7,537,500	
ダイキン工業	83,000	20,455.00	1,697,765,000	
オルガノ	2,200	6,110.00	13,442,000	
ト - ヨ - カネツ	2,500	2,498.00	6,245,000	
栗田工業	35,300	5,290.00	186,737,000	貸付株式数 6,800株
椿本チエイン	9,100	3,165.00	28,801,500	
大同工業	3,000	1,074.00	3,222,000	
日 機 装	21,200	1,167.00	24,740,400	
木村化工機	5,800	883.00	5,121,400	貸付株式数 2,100株
レイズネクスト	10,500	1,147.00	12,043,500	
アネスト岩田	10,700	1,047.00	11,202,900	貸付株式数 2,600株
ダイフク	35,900	9,680.00	347,512,000	貸付株式数 14,300株
サムコ	1,700	3,300.00	5,610,000	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,400	1,000.00	3,400,000	
油研工業	900	1,734.00	1,560,600	貸付株式数 100株
タダノ	31,600	1,132.00	35,771,200	
フジテック	22,800	2,551.00	58,162,800	貸付株式数 8,800株
C K D	15,200	2,477.00	37,650,400	
キトー	5,400	1,695.00	9,153,000	
平和	18,000	1,933.00	34,794,000	貸付株式数 7,100株
理想科学工業	5,000	1,707.00	8,535,000	貸付株式数 800株
S A N K Y O	15,700	2,802.00	43,991,400	
日本金銭機械	6,600	578.00	3,814,800	
マースグループHLDGS	3,800	1,611.00	6,121,800	
フクシマガリレイ	4,500	4,440.00	19,980,000	
オーイズミ	2,300	382.00	878,600	
ダイコク電機	2,600	907.00	2,358,200	
竹内製作所	11,200	2,796.00	31,315,200	
ア マ ノ	17,100	2,927.00	50,051,700	
J U K I	9,200	820.00	7,544,000	
サンデンホールディングス	9,100	366.00	3,330,600	
蛇の目マシン	6,200	760.00	4,712,000	貸付株式数 2,300株
ブラザー工業	79,800	2,392.00	190,881,600	
マックス	8,700	1,675.00	14,572,500	
モリタホールディングス	10,200	1,619.00	16,513,800	
グローリー	16,800	2,315.00	38,892,000	
新晃工業	6,200	1,920.00	11,904,000	貸付株式数 100株
大和冷機工業	10,700	1,069.00	11,438,300	

セガサミーホールディングス	59,500	1,509.00	89,785,500	
日本ピストンリング	2,400	1,327.00	3,184,800	
リケン	2,900	2,592.00	7,516,800	貸付株式数 700株
T P R	8,500	1,505.00	12,792,500	貸付株式数 3,300株
ツバキ・ナカシマ	12,800	1,809.00	23,155,200	貸付株式数 3,700株
ホシザキ	20,500	9,950.00	203,975,000	
大豊工業	5,600	1,024.00	5,734,400	
日本精工	133,100	1,028.00	136,826,800	
N T N	151,200	309.00	46,720,800	貸付株式数 52,800株
ジェイテクト	62,100	1,213.00	75,327,300	
不二越	5,900	4,290.00	25,311,000	
ミネベアミツミ	112,000	2,916.00	326,592,000	
日本トムソン	18,600	613.00	11,401,800	
T H K	40,600	3,280.00	133,168,000	
ユーシン精機	4,300	820.00	3,526,000	
前澤給装工業	4,700	1,053.00	4,949,100	
イーグル工業	8,100	1,116.00	9,039,600	
前澤工業	4,500	615.00	2,767,500	
日本ピラ - 工業	6,800	2,296.00	15,612,800	貸付株式数 2,600株
キッツ	19,800	795.00	15,741,000	
日立	313,200	6,100.00	1,910,520,000	
東芝	129,100	4,700.00	606,770,000	
三菱電機	650,500	1,739.00	1,131,219,500	
富士電機	39,400	5,160.00	203,304,000	
東洋電機製造	2,400	1,189.00	2,853,600	貸付株式数 400株
安川電機	70,100	5,250.00	368,025,000	
シンフォニアテクノロジー	8,600	1,311.00	11,274,600	貸付株式数 3,100株
明電舎	11,100	2,293.00	25,452,300	
オリジン	1,600	1,320.00	2,112,000	貸付株式数 400株
山洋電気	3,200	7,970.00	25,504,000	
デンヨー	5,500	2,034.00	11,187,000	貸付株式数 600株
ベイカレントコンサルティング	4,100	37,450.00	153,545,000	
ORCHESTRA HDGS	1,600	2,992.00	4,787,200	貸付株式数 500株
アイモバイル	2,600	1,878.00	4,882,800	貸付株式数 400株
キャリアインデックス	3,200	862.00	2,758,400	貸付株式数 500株
MS - Japan	2,700	1,113.00	3,005,100	貸付株式数 1,000株

船場	900	821.00	738,900	貸付株式数	100株
グレイステクノロジー	6,800	1,714.00	11,655,200	貸付株式数	2,500株
ジャパンエレベーターSHD	18,200	2,565.00	46,683,000		
フルテック	900	1,360.00	1,224,000	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	640.00	1,792,000		
ツナググループHLDGS	1,200	397.00	476,400	貸付株式数	400株
GAMEWITH	1,800	621.00	1,117,800	貸付株式数	700株
ソウルドアウト	1,500	1,776.00	2,664,000	貸付株式数	500株
MS&CONSULTING	1,100	633.00	696,300		
ミダック	1,400	6,800.00	9,520,000		
日総工産	5,000	831.00	4,155,000	貸付株式数	1,300株
キュービーネットHLDGS	3,000	1,795.00	5,385,000	貸付株式数	300株
RPAホールディングス	7,400	744.00	5,505,600	貸付株式数	2,800株
三桜工業	9,200	1,244.00	11,444,800		
マキタ	85,000	5,080.00	431,800,000	貸付株式数	3,200株
東芝テック	7,100	4,570.00	32,447,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	7,840.00	9,408,000		
マブチモーター	18,000	4,345.00	78,210,000	貸付株式数	5,600株
日本電産	156,900	12,535.00	1,966,741,500		
ユーエムシーエレクトロニクス	3,900	748.00	2,917,200		
トレックス・セミコンダクター	3,600	2,252.00	8,107,200		
東光高岳	3,400	1,420.00	4,828,000	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	15,600	629.00	9,812,400	貸付株式数	5,100株
宮越ホールディングス	2,700	1,036.00	2,797,200	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,300	4,875.00	35,587,500	貸付株式数	400株
ヤーマン	10,900	1,417.00	15,445,300		
JVCケンウッド	57,000	236.00	13,452,000	貸付株式数	22,500株
ミマキエンジニアリング	6,000	739.00	4,434,000		
I-PEX	3,000	2,519.00	7,557,000		
日新電機	15,300	1,354.00	20,716,200		
大崎電気	13,200	623.00	8,223,600	貸付株式数	4,100株
オムロン	54,100	8,550.00	462,555,000		
日東工業	9,600	1,802.00	17,299,200	貸付株式数	1,600株
IDEC	8,800	2,172.00	19,113,600	貸付株式数	1,900株
正興電機製作所	2,200	1,612.00	3,546,400	貸付株式数	600株

不二電機工業	1,000	1,280.00	1,280,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	23,500	2,968.00	69,748,000	
サクサホールディングス	1,500	1,390.00	2,085,000	貸付株式数 100株
メルコホールディングス	2,300	4,920.00	11,316,000	
テクノメディカ	1,400	1,630.00	2,282,000	
ダイヤモンドエレクトリク HD	1,900	2,712.00	5,152,800	貸付株式数 700株
日本電気	82,900	5,550.00	460,095,000	
富士通	58,600	19,445.00	1,139,477,000	
沖電気	26,300	1,028.00	27,036,400	
岩崎通信機	2,900	946.00	2,743,400	
電気興業	3,100	2,256.00	6,993,600	
サンケン電気	7,500	5,180.00	38,850,000	
ナカヨ	1,100	1,499.00	1,648,900	貸付株式数 200株
アイホン	3,800	2,056.00	7,812,800	
ルネサスエレクトロニクス	280,400	1,185.00	332,274,000	貸付株式数 111,100株
セイコーエプソン	80,800	2,077.00	167,821,600	
ワコム	48,000	700.00	33,600,000	貸付株式数 18,800株
アルバック	12,000	5,540.00	66,480,000	
アクセル	2,700	891.00	2,405,700	
E I Z O	5,500	4,935.00	27,142,500	
ジャパンディスプレイ	61,700	40.00	2,468,000	
日本信号	14,900	938.00	13,976,200	
京三製作所	13,400	434.00	5,815,600	
能美防災	8,500	2,032.00	17,272,000	
ホーチキ	4,500	1,184.00	5,328,000	
星和電機	3,400	538.00	1,829,200	
エレコム	15,100	2,042.00	30,834,200	
パナソニック	695,000	1,266.50	880,217,500	
シャープ	86,800	1,924.00	167,003,200	貸付株式数 34,300株
アンリツ	39,600	2,110.00	83,556,000	貸付株式数 15,500株
富士通ゼネラル	20,100	2,837.00	57,023,700	
ソニーグループ	408,400	11,015.00	4,498,526,000	
T D K	31,400	14,060.00	441,484,000	
帝国通信工業	2,700	1,172.00	3,164,400	貸付株式数 500株
タムラ製作所	23,200	601.00	13,943,200	貸付株式数 1,200株
アルプスアルパイン	53,200	1,213.00	64,531,600	
池上通信機	2,300	831.00	1,911,300	
日本電波工業	6,500	1,090.00	7,085,000	貸付株式数 2,300株
鈴木	3,000	1,025.00	3,075,000	貸付株式数 1,100株

日本トリム	1,600	3,720.00	5,952,000	
ローランド ディー . ジー .	3,800	2,574.00	9,781,200	貸付株式数 1,100株
フオスタ - 電機	6,600	998.00	6,586,800	貸付株式数 900株
S M K	1,600	2,581.00	4,129,600	貸付株式数 600株
ヨコオ	5,100	2,345.00	11,959,500	
ティアック	5,200	129.00	670,800	貸付株式数 600株
ホシデン	18,000	1,015.00	18,270,000	
ヒロセ電機	10,000	16,350.00	163,500,000	
日本航空電子	14,900	1,932.00	28,786,800	
T O A	7,400	891.00	6,593,400	
マクセルホールディングス	12,900	1,262.00	16,279,800	
古野電気	8,300	1,056.00	8,764,800	貸付株式数 100株
ユニデンホールディングス	1,800	2,663.00	4,793,400	
スミダコーポレーション	5,500	1,189.00	6,539,500	
アイコム	2,800	2,391.00	6,694,800	
リオン	2,900	2,744.00	7,957,600	
本多通信工業	4,400	495.00	2,178,000	貸付株式数 1,700株
横河電機	65,200	1,732.00	112,926,400	
新電元工業	2,500	4,775.00	11,937,500	
アズビル	44,300	4,500.00	199,350,000	
東亜ディーケーケー	2,800	827.00	2,315,600	
日本光電工業	27,000	3,235.00	87,345,000	
チ ノ ー	1,800	1,488.00	2,678,400	
共和電業	6,100	382.00	2,330,200	
日本電子材料	2,800	2,022.00	5,661,600	貸付株式数 900株
堀場製作所	12,900	7,530.00	97,137,000	
アドバンテスト	48,500	10,300.00	499,550,000	
小野測器	2,500	556.00	1,390,000	貸付株式数 200株
エスベック	5,600	2,158.00	12,084,800	
キーエンス	64,000	56,820.00	3,636,480,000	
日置電機	3,200	5,880.00	18,816,000	
シスメックス	50,900	11,755.00	598,329,500	
日本マイクロニクス	11,400	1,633.00	18,616,200	
メガチップス	6,500	3,250.00	21,125,000	貸付株式数 300株
O B A R A G R O U P	3,700	3,850.00	14,245,000	貸付株式数 1,400株
I M A G I C A G R O U P	5,400	480.00	2,592,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,123.00	1,698,400	貸付株式数 300株
デンソー	143,400	7,805.00	1,119,237,000	

原田工業	2,700	923.00	2,492,100	貸付株式数	1,100株
コーセル	7,900	1,142.00	9,021,800		
イリソ電子工業	5,500	5,170.00	28,435,000	貸付株式数	2,200株
オプテックスグループ	10,800	1,916.00	20,692,800		
千代田インテグレ	2,700	1,802.00	4,865,400		
アイ・オー・データ	2,400	1,062.00	2,548,800		
レーザーテック	28,700	21,330.00	612,171,000		
スタンレー電気	45,200	3,345.00	151,194,000		
岩崎電気	2,400	1,879.00	4,509,600		
ウシオ電機	33,300	1,758.00	58,541,400		
岡谷電機	4,600	359.00	1,651,400	貸付株式数	1,800株
ヘリオステクノH	6,200	350.00	2,170,000	貸付株式数	700株
エノモト	1,900	1,748.00	3,321,200		
日本セラミック	6,600	2,957.00	19,516,200		
遠藤照明	3,300	783.00	2,583,900		
古河電池	4,800	1,577.00	7,569,600	貸付株式数	1,900株
双信電機	3,300	580.00	1,914,000	貸付株式数	1,200株
山一電機	4,300	1,733.00	7,451,900		
図 研	4,400	3,050.00	13,420,000		
日本電子	12,000	6,220.00	74,640,000		
カ シ オ	52,600	1,906.00	100,255,600		
ファナック	57,200	27,165.00	1,553,838,000		
日本シイエムケイ	13,900	447.00	6,213,300	貸付株式数	5,500株
エンプラス	3,000	4,050.00	12,150,000	貸付株式数	1,100株
大真空	2,300	4,320.00	9,936,000		
ロ - ム	27,000	10,180.00	274,860,000		
浜松ホトニクス	46,700	6,810.00	318,027,000		
三井ハイテック	6,400	5,420.00	34,688,000	貸付株式数	1,500株
新光電気工業	22,000	3,825.00	84,150,000		
京 セ ラ	99,000	7,144.00	707,256,000		
協栄産業	700	1,379.00	965,300	貸付株式数	100株
太陽誘電	29,000	5,540.00	160,660,000		
村田製作所	191,300	8,563.00	1,638,101,900		
双葉電子工業	10,700	798.00	8,538,600		
日東電工	41,400	8,470.00	350,658,000		
北陸電気工業	2,200	1,024.00	2,252,800		
東海理化電機	16,800	1,765.00	29,652,000		
ニチコン	20,900	1,178.00	24,620,200	貸付株式数	8,200株
日本ケミコン	6,700	2,522.00	16,897,400	貸付株式数	800株
K O A	9,100	1,670.00	15,197,000		



三井E & S HD	21,700	520.00	11,284,000		
日立造船	53,000	715.00	37,895,000	貸付株式数	700株
三菱重工業	102,200	3,383.00	345,742,600		
川崎重工業	50,800	2,481.00	126,034,800		
I H I	43,700	2,751.00	120,218,700		
名村造船所	21,900	193.00	4,226,700	貸付株式数	3,900株
サノヤスホールディングス	9,800	148.00	1,450,400		
スプリックス	2,000	1,364.00	2,728,000	貸付株式数	500株
マネジメントソリューションズ	3,200	2,281.00	7,299,200	貸付株式数	1,100株
プロレド・パートナーズ	1,100	2,567.00	2,823,700	貸付株式数	300株
AND FACTORY	1,200	713.00	855,600	貸付株式数	200株
ギークス	1,300	1,867.00	2,427,100	貸付株式数	200株
カープスホールディングス	17,300	905.00	15,656,500	貸付株式数	600株
フォーラムエンジニアリング	4,400	977.00	4,298,800		
日本車輛	2,200	2,215.00	4,873,000		
三菱ロジスネクスト	8,800	1,077.00	9,477,600	貸付株式数	3,400株
近畿車輛	1,000	1,280.00	1,280,000	貸付株式数	200株
F P G	21,800	775.00	16,895,000	貸付株式数	4,900株
島根銀行	3,000	643.00	1,929,000		
じもとホールディングス	4,300	658.00	2,829,400		
全国保証	16,800	4,820.00	80,976,000	貸付株式数	6,600株
めぶきフィナンシャルG	333,400	237.00	79,015,800		
東京きらぼしFG	8,200	1,444.00	11,840,800		
九州フィナンシャルG	130,500	396.00	51,678,000		
かんぽ生命保険	79,800	2,104.00	167,899,200		
ゆうちょ銀行	181,200	931.00	168,697,200	貸付株式数	72,800株
富山第一銀行	14,700	279.00	4,101,300		
コンコルディア・フィナンシャル	389,800	415.00	161,767,000		
ジェイリース	2,500	1,158.00	2,895,000	貸付株式数	800株
西日本フィナンシャルHD	42,500	657.00	27,922,500		
マーキュリアインベストメント	3,200	741.00	2,371,200		
イントラスト	2,100	742.00	1,558,200	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,600	1,000.00	3,600,000		
C a s a	2,100	980.00	2,058,000	貸付株式数	900株
アルヒ	9,700	1,519.00	14,734,300	貸付株式数	2,300株
プレミアグループ	3,200	3,640.00	11,648,000		

日産自動車	767,600	563.00	432,158,800	
いすゞ自動車	187,500	1,561.00	292,687,500	
トヨタ自動車	660,200	10,075.00	6,651,515,000	
日野自動車	81,100	998.00	80,937,800	
三菱自動車工業	240,200	311.00	74,702,200	貸付株式数 96,500株
エフテック	4,700	929.00	4,366,300	
レシップホールディングス	2,900	633.00	1,835,700	
G M B	1,500	1,043.00	1,564,500	貸付株式数 400株
ファルテック	1,400	766.00	1,072,400	
武蔵精密工業	14,700	2,468.00	36,279,600	
日産車体	9,300	742.00	6,900,600	貸付株式数 3,800株
新明和工業	18,200	992.00	18,054,400	貸付株式数 4,100株
極東開発工業	11,200	1,694.00	18,972,800	貸付株式数 400株
トピー工業	5,300	1,363.00	7,223,900	
ティラド	2,100	2,798.00	5,875,800	
タチエス	10,000	1,420.00	14,200,000	
N O K	31,300	1,348.00	42,192,400	
フタバ産業	15,800	528.00	8,342,400	
K Y B	7,400	3,920.00	29,008,000	貸付株式数 100株
市光工業	9,800	757.00	7,418,600	
大同メタル工業	13,000	634.00	8,242,000	
プレス工業	31,200	347.00	10,826,400	
ミクニ	7,900	305.00	2,409,500	
太平洋工業	13,600	1,143.00	15,544,800	
河西工業	9,400	409.00	3,844,600	貸付株式数 3,500株
アイシン	47,500	4,890.00	232,275,000	
マ ッ ダ	204,100	1,003.00	204,712,300	
今仙電機製作所	5,600	729.00	4,082,400	
本田技研	512,600	3,626.00	1,858,687,600	
スズキ	129,100	4,770.00	615,807,000	
S U B A R U	186,300	2,292.50	427,092,750	
安永	3,200	1,259.00	4,028,800	貸付株式数 1,300株
ヤマハ発動機	92,200	3,250.00	299,650,000	
小糸製作所	39,000	7,030.00	274,170,000	
T B K	7,400	418.00	3,093,200	貸付株式数 1,900株
エクセディ	8,800	1,700.00	14,960,000	
ミツバ	12,000	875.00	10,500,000	貸付株式数 700株
豊田合成	21,100	2,737.00	57,750,700	
愛三工業	10,200	884.00	9,016,800	
盟和産業	1,100	983.00	1,081,300	貸付株式数 300株

日本プラスト	5,100	724.00	3,692,400	
ヨロズ	5,500	1,280.00	7,040,000	貸付株式数 300株
エフ・シー・シー	10,500	1,699.00	17,839,500	
新家工業	1,600	1,638.00	2,620,800	
シマノ	24,500	24,595.00	602,577,500	
テイ・エス テック	29,800	1,629.00	48,544,200	
33FG	5,500	1,332.00	7,326,000	
第四北越フィナンシャルG	10,400	2,393.00	24,887,200	
ひろぎんHLDGS	95,700	574.00	54,931,800	貸付株式数 27,100株
LITALICO	2,700	5,360.00	14,472,000	
ジャムコ	4,000	1,166.00	4,664,000	貸付株式数 300株
小野建	5,500	1,308.00	7,194,000	貸付株式数 2,200株
はるやまHLDGS	2,300	674.00	1,550,200	貸付株式数 400株
南陽	1,200	1,945.00	2,334,000	
ノジマ	11,400	3,005.00	34,257,000	
佐島電機	4,000	805.00	3,220,000	
カップ・クリエイト	8,900	1,468.00	13,065,200	貸付株式数 3,300株
エコートレーディング	1,700	622.00	1,057,400	
伯東	4,200	1,550.00	6,510,000	
コンドーテック	4,800	1,001.00	4,804,800	
中山福	4,100	472.00	1,935,200	
ライトオン	4,600	699.00	3,215,400	貸付株式数 1,700株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,200	2,607.00	21,377,400	
三菱食品	6,900	2,958.00	20,410,200	
良品計画	84,700	2,108.00	178,547,600	
三城ホールディングス	7,900	270.00	2,133,000	貸付株式数 2,800株
松田産業	5,000	2,182.00	10,910,000	貸付株式数 600株
第一興商	12,800	4,440.00	56,832,000	
メディパルHD	64,100	2,169.00	139,032,900	
アドヴァン	6,500	962.00	6,253,000	
SPK	2,900	1,335.00	3,871,500	
萩原電気HLDGS	2,400	2,447.00	5,872,800	
アルビス	1,900	2,268.00	4,309,200	
アズワン	4,600	13,500.00	62,100,000	貸付株式数 200株
スズデン	2,200	1,464.00	3,220,800	
尾家産業	2,000	1,260.00	2,520,000	貸付株式数 300株
シモジマ	4,100	1,081.00	4,432,100	貸付株式数 1,400株
ドウシシャ	6,100	1,675.00	10,217,500	
小津産業	1,600	1,916.00	3,065,600	

コナカ	7,800	365.00	2,847,000	
高速	3,500	1,473.00	5,155,500	
ハウス ローゼ	600	1,636.00	981,600	
G - 7ホールディングス	3,900	3,020.00	11,778,000	
たけびし	2,200	1,552.00	3,414,400	貸付株式数 300株
イオン北海道	8,600	1,053.00	9,055,800	貸付株式数 2,300株
コジマ	11,300	731.00	8,260,300	貸付株式数 4,300株
ヒマラヤ	2,200	1,004.00	2,208,800	
コーナン商事	9,200	3,720.00	34,224,000	貸付株式数 3,500株
ネットワンシステムズ	26,200	3,445.00	90,259,000	
エコス	2,400	1,915.00	4,596,000	
ワタミ	8,300	997.00	8,275,100	貸付株式数 3,300株
マルシェ	1,500	526.00	789,000	貸付株式数 600株
リックス	1,300	1,537.00	1,998,100	
システムソフト	18,400	159.00	2,925,600	貸付株式数 5,100株
パンパシフィックHD	128,300	2,415.00	309,844,500	
丸文	5,600	626.00	3,505,600	
西松屋チェーン	14,400	1,502.00	21,628,800	貸付株式数 5,600株
ゼンショーホールディングス	34,200	2,779.00	95,041,800	貸付株式数 12,300株
ハピネット	5,700	1,459.00	8,316,300	貸付株式数 100株
幸楽苑ホールディングス	4,100	1,617.00	6,629,700	貸付株式数 1,000株
ハークスレイ	1,000	1,025.00	1,025,000	貸付株式数 500株
橋本総業HLDGS	1,400	3,035.00	4,249,000	
日本ライフライン	20,700	1,390.00	28,773,000	
サイゼリヤ	9,500	2,645.00	25,127,500	貸付株式数 200株
タカショー	5,000	807.00	4,035,000	貸付株式数 1,600株
V Tホールディングス	24,500	477.00	11,686,500	貸付株式数 9,500株
マルカ	2,100	2,466.00	5,178,600	
アルゴグラフィックス	5,100	3,215.00	16,396,500	貸付株式数 1,800株
魚力	1,900	1,981.00	3,763,900	
IDOM	22,000	653.00	14,366,000	
日本エム・ディ・エム	3,900	2,193.00	8,552,700	
ポブラ	3,100	298.00	923,800	貸付株式数 400株
フジ・コーポレーション	3,400	1,298.00	4,413,200	
ユナイテッドアローズ	7,400	2,242.00	16,590,800	貸付株式数 2,800株
進和	3,800	2,128.00	8,086,400	
エスケイジャパン	2,500	457.00	1,142,500	貸付株式数 600株
ダイトロン	2,700	2,020.00	5,454,000	
ハイデイ日高	9,100	1,780.00	16,198,000	貸付株式数 3,300株

シークス	8,100	1,637.00	13,259,700	
京都きもの友禅	4,300	284.00	1,221,200	
コロワイド	21,200	2,000.00	42,400,000	貸付株式数 8,400株
ピーシーデポコーポ	7,400	459.00	3,396,600	貸付株式数 3,500株
田中商事	1,700	705.00	1,198,500	
オーハシテクニカ	3,400	1,529.00	5,198,600	
壱番屋	4,400	4,840.00	21,296,000	
白銅	2,100	1,880.00	3,948,000	
トップカルチャー	2,500	343.00	857,500	
P L A N T	1,600	722.00	1,155,200	貸付株式数 500株
スギホールディングス	12,900	8,950.00	115,455,000	
ダイコー通産	800	1,528.00	1,222,400	
薬王堂ホールディングス	2,800	2,423.00	6,784,400	貸付株式数 600株
島津製作所	83,800	4,140.00	346,932,000	
J M S	5,900	854.00	5,038,600	貸付株式数 2,100株
クボテック	1,800	336.00	604,800	貸付株式数 400株
長野計器	5,000	1,162.00	5,810,000	
ブイ・テクノロジー	3,100	5,870.00	18,197,000	貸付株式数 900株
スター精密	10,300	1,822.00	18,766,600	貸付株式数 3,900株
東京計器	4,100	1,105.00	4,530,500	
愛知時計	700	4,195.00	2,936,500	
インターアクション	3,400	2,581.00	8,775,400	
オーバル	6,600	285.00	1,881,000	貸付株式数 100株
東京精密	11,000	5,230.00	57,530,000	
マニー	25,900	2,589.00	67,055,100	貸付株式数 3,100株
ニコン	99,300	1,200.00	119,160,000	
トプコン	32,900	1,778.00	58,496,200	
オリンパス	360,600	2,373.50	855,884,100	
理研計器	5,800	2,810.00	16,298,000	
S C R E E Nホールディングス	11,300	10,910.00	123,283,000	
キヤノン電子	5,900	1,742.00	10,277,800	
タムロン	5,600	2,465.00	13,804,000	貸付株式数 2,000株
H O Y A	128,300	14,180.00	1,819,294,000	
シード	2,300	810.00	1,863,000	
ノーリツ鋼機	6,100	2,265.00	13,816,500	
エー・アンド・デイ	5,700	1,072.00	6,110,400	
朝日インテック	68,700	2,717.00	186,657,900	
キヤノン	323,700	2,623.00	849,065,100	貸付株式数 141,500株
リコー	166,000	1,350.00	224,100,000	

シチズン時計	83,100	436.00	36,231,600	
リズム	1,900	798.00	1,516,200	
大研医器	4,800	561.00	2,692,800	
メニコン	10,200	7,150.00	72,930,000	貸付株式数 3,900株
シンシア	1,300	641.00	833,300	貸付株式数 200株 (200株)
中本パックス	1,600	1,583.00	2,532,800	貸付株式数 100株
スノーピーク	4,000	3,190.00	12,760,000	貸付株式数 100株
パラマウントベッドHD	12,200	1,991.00	24,290,200	
トランザクション	3,800	1,389.00	5,278,200	貸付株式数 200株
粧美堂	1,900	423.00	803,700	
ニホンフラッシュ	5,700	1,251.00	7,130,700	
前田工織	7,300	3,325.00	24,272,500	貸付株式数 2,800株
永大産業	8,600	312.00	2,683,200	
アートネイチャー	6,300	655.00	4,126,500	
バンダイナムコHLDGS	53,900	8,140.00	438,746,000	
アイフィスジャパン	1,800	710.00	1,278,000	
共立印刷	8,200	142.00	1,164,400	
SHOEI	6,500	3,950.00	25,675,000	
フランスベッドHLDGS	9,100	910.00	8,281,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	10,300	797.00	8,209,100	
パイロットコーポレーション	10,900	3,555.00	38,749,500	貸付株式数 1,200株
萩原工業	3,600	1,437.00	5,173,200	
エイベックス	11,400	1,534.00	17,487,600	貸付株式数 4,400株
トッパン・フォームズ	11,500	1,093.00	12,569,500	
フジシールインターナショナル	13,500	2,376.00	32,076,000	貸付株式数 5,200株
タカラトミー	30,000	984.00	29,520,000	
廣済堂	4,800	836.00	4,012,800	
エステールホールディングス	4,000	648.00	2,592,000	貸付株式数 700株
レック	7,800	1,178.00	9,188,400	
タカノ	1,900	642.00	1,219,800	
三光合成	7,200	445.00	3,204,000	
プロネクサス	5,300	1,038.00	5,501,400	
ホクシン	6,700	169.00	1,132,300	貸付株式数 1,100株 (500株)
ウッドワン	2,400	1,293.00	3,103,200	
大建工業	4,400	2,066.00	9,090,400	

き も と	11,100	261.00	2,897,100	
凸版印刷	98,500	1,909.00	188,036,500	
大日本印刷	78,100	2,442.00	190,720,200	
共同印刷	2,000	2,686.00	5,372,000	
N I S S H A	13,300	1,689.00	22,463,700	
光村印刷	600	1,690.00	1,014,000	貸付株式数 200株
藤森工業	5,800	4,040.00	23,432,000	
ヴィア・ホールディングス	7,600	224.00	1,702,400	貸付株式数 3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,726.00	5,695,800	貸付株式数 1,200株
前澤化成工業	4,300	1,258.00	5,409,400	貸付株式数 1,600株
未来工業	2,300	1,734.00	3,988,200	
アシックス	57,700	2,558.00	147,596,600	
ツ ツ ミ	2,000	2,373.00	4,746,000	
ウェーブロックHLDGS	2,300	705.00	1,621,500	
ジェイ エス ピー	4,200	1,634.00	6,862,800	貸付株式数 1,400株
ニ チ ハ	9,100	2,935.00	26,708,500	
エフピコ	12,200	4,220.00	51,484,000	貸付株式数 800株
小松ウオール工業	2,200	2,012.00	4,426,400	貸付株式数 100株
ヤマハ	38,800	6,540.00	253,752,000	
河合楽器	2,000	3,735.00	7,470,000	
クリナップ	6,000	522.00	3,132,000	
ピジョン	42,100	3,300.00	138,930,000	貸付株式数 14,800株
天馬	4,900	2,443.00	11,970,700	
オリバー	1,500	2,705.00	4,057,500	貸付株式数 300株
兼松サステック	500	1,803.00	901,500	
キングジム	5,300	944.00	5,003,200	貸付株式数 2,100株
象印マホービン	17,600	1,708.00	30,060,800	
リンテック	13,800	2,442.00	33,699,600	
信越ポリマー	9,600	1,068.00	10,252,800	
東 リ	14,700	245.00	3,601,500	貸付株式数 5,900株
イトーキ	12,800	384.00	4,915,200	貸付株式数 2,300株
任 天 堂	37,300	65,070.00	2,427,111,000	
三菱鉛筆	10,400	1,424.00	14,809,600	
松 風	3,100	2,003.00	6,209,300	
タカラスタンダード	13,100	1,571.00	20,580,100	
コ ク ヨ	31,900	1,843.00	58,791,700	
ナカバヤシ	5,800	598.00	3,468,400	貸付株式数 1,200株
ニ フ コ	24,100	3,990.00	96,159,000	
立川ブラインド	2,900	1,317.00	3,819,300	貸付株式数 1,100株

グローブライド	3,300	4,070.00	13,431,000	
オカムラ	23,300	1,489.00	34,693,700	貸付株式数 4,900株
バルカー	5,300	2,095.00	11,103,500	
MUTOHホールディングス	900	1,585.00	1,426,500	
伊藤忠	448,400	3,302.00	1,480,616,800	
丸紅	632,500	993.90	628,641,750	
スクロール	9,500	854.00	8,113,000	貸付株式数 3,600株
高島	1,000	1,820.00	1,820,000	
ヨンドシーホールディングス	6,000	1,932.00	11,592,000	
三陽商会	3,400	952.00	3,236,800	貸付株式数 1,300株
長瀬産業	35,000	1,658.00	58,030,000	貸付株式数 7,000株
ナイガイ	3,200	385.00	1,232,000	貸付株式数 900株
蝶理	4,200	1,696.00	7,123,200	
豊田通商	64,100	5,430.00	348,063,000	
オンワードホールディングス	39,200	360.00	14,112,000	
三共生興	9,100	527.00	4,795,700	
兼松	25,700	1,463.00	37,599,100	
美津濃	6,700	2,288.00	15,329,600	
ツカモトコーポレーション	1,300	1,387.00	1,803,100	
ルックホールディングス	2,200	1,465.00	3,223,000	貸付株式数 700株
三井物産	516,800	2,604.00	1,345,747,200	
日本紙パルプ	3,300	3,580.00	11,814,000	
東京エレクトロン	38,200	49,500.00	1,890,900,000	
カメイ	8,100	1,153.00	9,339,300	
東都水産	400	4,740.00	1,896,000	
OUGホールディングス	1,000	2,834.00	2,834,000	
スターゼン	5,000	2,142.00	10,710,000	
セイコーHD	9,400	2,254.00	21,187,600	
山善	24,800	977.00	24,229,600	貸付株式数 1,700株
椿本興業	1,200	3,485.00	4,182,000	貸付株式数 100株
住友商事	403,200	1,534.00	618,508,800	
日本ユニシス	22,200	3,215.00	71,373,000	
内田洋行	2,800	4,965.00	13,902,000	貸付株式数 500株
三菱商事	390,100	3,052.00	1,190,585,200	
第一実業	3,000	4,250.00	12,750,000	
キヤノンマーケティングJPN	15,600	2,700.00	42,120,000	



西華産業	3,200	1,835.00	5,872,000	貸付株式数	600株
佐藤商事	5,100	1,065.00	5,431,500		
菱洋エレクトロ	4,900	2,603.00	12,754,700	貸付株式数	1,900株
東京産業	5,700	608.00	3,465,600	貸付株式数	1,900株
ユアサ商事	6,500	3,100.00	20,150,000		
神鋼商事	1,400	2,439.00	3,414,600		
トルク	3,900	249.00	971,100		
阪和興業	12,900	3,300.00	42,570,000		
正栄食品	4,200	3,920.00	16,464,000	貸付株式数	1,600株
カナデン	5,300	1,073.00	5,686,900		
菱電商事	4,700	1,620.00	7,614,000	貸付株式数	1,600株
ニプロ	48,200	1,362.00	65,648,400	貸付株式数	19,100株
フルサト工業	3,100	1,910.00	5,921,000		
岩谷産業	15,600	6,330.00	98,748,000		
ナイス	2,500	2,075.00	5,187,500		
ニチモウ	1,000	2,064.00	2,064,000		
極東貿易	2,000	2,271.00	4,542,000	貸付株式数	600株
アステナホールディングス	9,900	664.00	6,573,600		
兼松エレクトロニクス	3,400	3,670.00	12,478,000		
三愛石油	15,500	1,218.00	18,879,000		
稲畑産業	15,700	1,721.00	27,019,700		
G S I クレオス	3,500	1,022.00	3,577,000	貸付株式数	1,200株
明和産業	5,900	471.00	2,778,900		
クワザワホールディングス	2,500	616.00	1,540,000		
ヤマエ久野	4,600	1,141.00	5,248,600	貸付株式数	1,100株
ゴ - ルドウィン	10,700	6,640.00	71,048,000	貸付株式数	3,100株
ユニ・チャ - ム	138,200	4,475.00	618,445,000		
デサント	10,900	2,500.00	27,250,000	貸付株式数	4,200株
キ ン グ	3,400	523.00	1,778,200	貸付株式数	300株
ワ キ タ	12,600	1,119.00	14,099,400		
ヤマトインタ - ナショナル	5,800	343.00	1,989,400	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	20,300	1,704.00	34,591,200		
サンゲツ	17,200	1,558.00	26,797,600		
ミツウロコグループ	9,800	1,231.00	12,063,800		
シナネンホールディングス	2,500	2,936.00	7,340,000	貸付株式数	900株
伊藤忠エネクス	14,500	1,011.00	14,659,500		
サンリオ	18,300	1,950.00	35,685,000	貸付株式数	6,700株
サンワ テクノス	4,200	1,178.00	4,947,600		
リョーサン	6,800	2,047.00	13,919,600	貸付株式数	2,700株
新光商事	8,600	755.00	6,493,000		

トーホー	3,000	1,706.00	5,118,000	貸付株式数	1,100株
三信電気	3,500	2,155.00	7,542,500		
東陽テクニカ	6,900	1,110.00	7,659,000		
モスフード サービス	9,000	3,065.00	27,585,000		
加賀電子	5,800	3,075.00	17,835,000	貸付株式数	1,300株
三益半導体	4,900	2,859.00	14,009,100		
ソーダニツカ	6,300	567.00	3,572,100		
立花エレテック	4,600	1,481.00	6,812,600	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,300	2,389.00	19,828,700	貸付株式数	1,700株
S R S ホールディングス	8,200	822.00	6,740,400	貸付株式数	3,000株
千 趣 会	11,800	411.00	4,849,800	貸付株式数	4,600株 (100株)
タカキユー	7,300	141.00	1,029,300	貸付株式数	200株
リテールパートナーズ	7,900	1,214.00	9,590,600	貸付株式数	3,000株
ケーヨー	11,900	758.00	9,020,200		
上新電機	7,400	2,782.00	20,586,800		
日本瓦斯	32,100	1,814.00	58,229,400		
ロイヤルホールディングス	11,100	2,246.00	24,930,600	貸付株式数	4,400株
東 天 紅	500	1,109.00	554,500	貸付株式数	200株
いなげや	7,100	1,478.00	10,493,800		
チヨダ	6,400	905.00	5,792,000	貸付株式数	1,400株
ライフコーポレーション	6,000	3,580.00	21,480,000		
リンガーハット	7,900	2,318.00	18,312,200	貸付株式数	1,200株
M r M a x H D	8,800	645.00	5,676,000		
テンアライド	5,300	343.00	1,817,900	貸付株式数	2,300株
A O K I ホールディングス	13,300	706.00	9,389,800	貸付株式数	400株
オークワ	10,000	1,119.00	11,190,000	貸付株式数	800株
コメリ	9,900	2,642.00	26,155,800		
青山商事	14,200	823.00	11,686,600		
しまむら	7,400	9,700.00	71,780,000		
はせがわ	3,300	299.00	986,700		
高 島 屋	46,900	1,303.00	61,110,700		
松 屋	14,100	984.00	13,874,400		
エイチ・ツー・オーリテイ リング	30,500	942.00	28,731,000		
近鉄百貨店	2,400	3,200.00	7,680,000		
丸井グループ	54,600	2,152.00	117,499,200		
クレディセゾン	37,400	1,414.00	52,883,600		
アクシアル リテイリング	5,200	3,895.00	20,254,000		
井 筒 屋	3,200	244.00	780,800	貸付株式数	700株

イオン	246,800	3,002.00	740,893,600	
イズミ	13,000	4,215.00	54,795,000	
フォーバル	2,200	837.00	1,841,400	
平和堂	11,400	2,307.00	26,299,800	貸付株式数 5,200株
フジ	7,700	1,983.00	15,269,100	
ヤオコー	7,300	6,460.00	47,158,000	貸付株式数 2,900株
ゼビオホールディングス	7,400	996.00	7,370,400	貸付株式数 500株
ケーズホールディングス	56,600	1,295.00	73,297,000	貸付株式数 25,200株
PALTA C	10,300	5,940.00	61,182,000	
三谷産業	9,400	387.00	3,637,800	貸付株式数 3,000株
OLYMPICグループ	3,600	791.00	2,847,600	貸付株式数 1,300株
日産東京販売HD	8,900	242.00	2,153,800	
新生銀行	52,800	1,573.00	83,054,400	
あおぞら銀行	38,400	2,482.00	95,308,800	
三菱UFJフィナンシャルG	4,395,500	608.80	2,675,980,400	
りそなホールディングス	746,700	448.10	334,596,270	貸付株式数 294,400株
三井住友トラストHD	121,600	3,662.00	445,299,200	
三井住友フィナンシャルG	444,200	3,920.00	1,741,264,000	
千葉銀行	214,100	694.00	148,585,400	
群馬銀行	130,500	357.00	46,588,500	
武蔵野銀行	9,500	1,668.00	15,846,000	貸付株式数 3,700株
千葉興業銀行	16,500	263.00	4,339,500	
筑波銀行	28,900	170.00	4,913,000	
七十七銀行	20,200	1,259.00	25,431,800	
青森銀行	4,900	2,084.00	10,211,600	貸付株式数 100株
秋田銀行	3,900	1,399.00	5,456,100	
山形銀行	7,000	863.00	6,041,000	
岩手銀行	4,200	1,749.00	7,345,800	
東邦銀行	56,700	205.00	11,623,500	貸付株式数 22,600株
東北銀行	3,100	1,025.00	3,177,500	貸付株式数 100株
みちのく銀行	4,300	973.00	4,183,900	
ふくおかフィナンシャルG	58,100	1,985.00	115,328,500	
静岡銀行	156,600	897.00	140,470,200	
十六銀行	8,200	1,939.00	15,899,800	
スルガ銀行	63,000	335.00	21,105,000	
八十二銀行	141,800	362.00	51,331,600	
山梨中央銀行	7,400	828.00	6,127,200	
大垣共立銀行	12,900	1,882.00	24,277,800	

福井銀行	5,600	1,444.00	8,086,400	
北國銀行	6,000	2,173.00	13,038,000	
清水銀行	2,500	1,516.00	3,790,000	
富山銀行	1,300	2,569.00	3,339,700	
滋賀銀行	12,900	2,057.00	26,535,300	
南都銀行	9,300	1,831.00	17,028,300	
百五銀行	58,100	304.00	17,662,400	
京都銀行	23,200	5,200.00	120,640,000	
紀陽銀行	22,500	1,464.00	32,940,000	
ほくほくフィナンシャルG	42,800	843.00	36,080,400	貸付株式数 1,500株
山陰合同銀行	39,700	539.00	21,398,300	
中国銀行	54,800	853.00	46,744,400	貸付株式数 200株
鳥取銀行	2,200	1,120.00	2,464,000	
伊予銀行	85,100	550.00	46,805,000	
百十四銀行	6,500	1,464.00	9,516,000	
四国銀行	9,300	700.00	6,510,000	貸付株式数 2,800株
阿波銀行	9,600	2,032.00	19,507,200	
大分銀行	3,700	1,700.00	6,290,000	
宮崎銀行	4,000	2,007.00	8,028,000	
佐賀銀行	3,700	1,381.00	5,109,700	
沖縄銀行	5,700	2,549.00	14,529,300	貸付株式数 500株
琉球銀行	13,500	729.00	9,841,500	
セブン銀行	215,200	231.00	49,711,200	貸付株式数 83,700株
みずほフィナンシャルG	872,500	1,624.50	1,417,376,250	
高知銀行	2,500	843.00	2,107,500	
山口フィナンシャルG	79,900	644.00	51,455,600	
芙蓉総合リース	6,600	7,110.00	46,926,000	貸付株式数 900株
みずほリース	10,000	3,475.00	34,750,000	貸付株式数 3,900株
東京センチュリー	14,900	5,960.00	88,804,000	貸付株式数 400株
SBIホールディングス	79,300	2,701.00	214,189,300	
日本証券金融	28,200	863.00	24,336,600	貸付株式数 1,700株
アイフル	109,200	378.00	41,277,600	
日本アジア投資	6,100	280.00	1,708,000	
長野銀行	2,300	1,106.00	2,543,800	
名古屋銀行	5,100	2,584.00	13,178,400	
北洋銀行	98,400	240.00	23,616,000	貸付株式数 33,800株
愛知銀行	2,200	2,803.00	6,166,600	貸付株式数 300株
中京銀行	2,600	1,463.00	3,803,800	
大光銀行	2,200	1,399.00	3,077,800	
愛媛銀行	8,900	806.00	7,173,400	

トマト銀行	2,300	1,042.00	2,396,600	貸付株式数	100株
京葉銀行	25,500	411.00	10,480,500		
栃木銀行	31,600	172.00	5,435,200		
北日本銀行	1,900	1,721.00	3,269,900		
東和銀行	12,200	529.00	6,453,800		
福島銀行	7,700	230.00	1,771,000		
大東銀行	3,000	606.00	1,818,000	貸付株式数	1,200株
リコーリース	5,000	3,400.00	17,000,000	貸付株式数	2,000株
イオンフィナンシャルサー ビス	39,200	1,318.00	51,665,600		
アコム	128,500	510.00	65,535,000	貸付株式数	50,900株
ジャックス	7,100	2,590.00	18,389,000		
オリコ	174,500	155.00	27,047,500		
オリックス	389,700	1,933.00	753,290,100		
三菱HCキャピタル	223,100	602.00	134,306,200		
ジャフコグループ	10,000	7,300.00	73,000,000		
九州リースサービス	3,000	672.00	2,016,000	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	48,200	298.00	14,363,600	貸付株式数	8,600株
大和証券G本社	479,500	638.00	305,921,000		
野村ホールディングス	982,400	585.40	575,096,960		
岡三証券グループ	53,100	427.00	22,673,700	貸付株式数	2,900株
丸三証券	19,200	629.00	12,076,800		
東洋証券	21,500	168.00	3,612,000		
東海東京HD	68,000	408.00	27,744,000	貸付株式数	500株
光世証券	1,800	634.00	1,141,200	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	302.00	5,375,600		
いちよし証券	13,300	579.00	7,700,700	貸付株式数	5,000株
松井証券	31,700	824.00	26,120,800		
SOMPOホールディング ス	113,300	4,290.00	486,057,000	貸付株式数	45,200株
日本取引所グループ	173,600	2,559.50	444,329,200		
マネックスG	58,300	810.00	47,223,000	貸付株式数	23,000株
極東証券	8,500	811.00	6,893,500	貸付株式数	3,400株
岩井コスモホールディング	7,100	1,668.00	11,842,800		
藍澤證券	11,600	1,064.00	12,342,400	貸付株式数	300株
フィデアホール	62,000	120.00	7,440,000		
池田泉州HD	73,900	160.00	11,824,000	貸付株式数	27,700株
アニコムホールディング ス	18,600	939.00	17,465,400	貸付株式数	7,200株
MS&AD	155,700	3,334.00	519,103,800		

マネーパートナーズG P	9,100	248.00	2,256,800		
スパークス・グループ	31,100	266.00	8,272,600	貸付株式数	11,900株
小林洋行	4,100	286.00	1,172,600		
第一生命H L D G S	339,600	2,165.50	735,403,800		
東京海上H D	211,800	5,165.00	1,093,947,000		
アドバンテッジリスクマネ	3,200	1,033.00	3,305,600	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	7,600	2,264.00	17,206,400	貸付株式数	2,000株
アサックス	3,900	696.00	2,714,400	貸付株式数	1,400株
N E C キャピタルソリュー ション	2,600	2,152.00	5,595,200		
T & D ホールディングス	192,400	1,451.00	279,172,400		
アドバンスクリエイト	3,400	915.00	3,111,000	貸付株式数	1,000株
三井不動産	292,700	2,748.00	804,339,600		
三菱地所	421,600	1,932.50	814,742,000		
平和不動産	11,100	4,245.00	47,119,500		
東京建物	63,300	1,717.00	108,686,100		
ダイビル	16,500	1,400.00	23,100,000		
京阪神ビルディング	10,500	1,413.00	14,836,500		
住友不動産	144,300	4,175.00	602,452,500		
太平洋興発	2,600	642.00	1,669,200	貸付株式数	700株
テーオーシー	12,100	703.00	8,506,300	貸付株式数	2,300株
東京楽天地	1,000	4,240.00	4,240,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	7,500	2,773.00	20,797,500		
フジ住宅	7,700	636.00	4,897,200		
空港施設	6,700	655.00	4,388,500		
明和地所	3,200	620.00	1,984,000		
ゴールドクレスト	5,800	1,793.00	10,399,400	貸付株式数	1,200株
リログループ	34,100	2,593.00	88,421,300		
エスリード	2,500	1,625.00	4,062,500	貸付株式数	1,000株
日神グループH L D G S	9,300	453.00	4,212,900	貸付株式数	4,100株
日本エスコン	12,500	788.00	9,850,000	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,400	345.00	9,453,000	貸付株式数	10,700株
A V A N T I A	3,600	893.00	3,214,800	貸付株式数	600株
イオンモール	32,100	1,808.00	58,036,800		
毎日コムネット	2,500	715.00	1,787,500	貸付株式数	100株
ファースト住建	2,700	1,208.00	3,261,600		
ランド	359,900	11.00	3,958,900	貸付株式数	85,300株
カチタス	16,000	3,155.00	50,480,000		
東祥	4,000	1,967.00	7,868,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	8,900	1,106.00	9,843,400	貸付株式数	1,100株

穴吹興産	1,800	2,111.00	3,799,800	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	7,800	1,013.00	7,901,400	貸付株式数	1,000株
インテリックス	1,800	772.00	1,389,600	貸付株式数	600株
ランドビジネス	2,800	362.00	1,013,600		
サンネクスタグループ	2,200	1,016.00	2,235,200	貸付株式数	100株
グランディハウス	5,200	423.00	2,199,600		
東武鉄道	67,600	3,100.00	209,560,000		
相鉄ホールディングス	21,900	2,256.00	49,406,400	貸付株式数	8,700株
東急	162,900	1,610.00	262,269,000		
京浜急行	83,700	1,494.00	125,047,800		
小田急電鉄	104,400	3,030.00	316,332,000		
京王電鉄	36,400	7,220.00	262,808,000		
京成電鉄	48,900	3,645.00	178,240,500		
富士急行	9,000	5,430.00	48,870,000	貸付株式数	3,500株
新京成電鉄	1,800	2,158.00	3,884,400	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	114,600	8,360.00	958,056,000		
西日本旅客鉄道	58,000	6,903.00	400,374,000		
東海旅客鉄道	54,200	18,000.00	975,600,000		
西武ホールディングス	78,400	1,389.00	108,897,600		
鴻池運輸	9,900	1,175.00	11,632,500	貸付株式数	1,900株
西日本鉄道	18,000	2,830.00	50,940,000	貸付株式数	7,100株
ハマキョウレックス	5,000	3,115.00	15,575,000		
サカイ引越センター	3,000	5,660.00	16,980,000	貸付株式数	1,100株
近鉄グループHLDGS	61,500	4,155.00	255,532,500		
阪急阪神HLDGS	81,900	3,705.00	303,439,500		
南海電鉄	29,200	2,464.00	71,948,800	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	27,500	3,540.00	97,350,000		
神戸電鉄	1,500	3,505.00	5,257,500	貸付株式数	500株
名古屋鉄道	51,000	2,222.00	113,322,000		
山陽電鉄	4,400	1,940.00	8,536,000		
トランコム	1,900	8,280.00	15,732,000		
日本通運	21,300	8,700.00	185,310,000		
ヤマトホールディングス	86,400	3,030.00	261,792,000		
山 九	15,700	4,810.00	75,517,000		
日 新	4,900	1,517.00	7,433,300	貸付株式数	800株
丸 運	4,300	280.00	1,204,000	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	5,100	3,330.00	16,983,000	貸付株式数	1,900株
センコーグループHLDGS	34,300	1,033.00	35,431,900	貸付株式数	9,000株
トナミホールディングス	1,500	5,000.00	7,500,000		

ニッコンホールディングス	20,700	2,359.00	48,831,300	
日石輸送	600	2,584.00	1,550,400	
福山通運	7,800	3,925.00	30,615,000	貸付株式数 2,100株
セイノーホールディングス	46,000	1,459.00	67,114,000	
エスライン	1,300	899.00	1,168,700	
神奈川中央交通	1,400	3,640.00	5,096,000	貸付株式数 600株
日立物流	13,600	3,880.00	52,768,000	
丸和運輸機関	13,300	1,571.00	20,894,300	貸付株式数 5,100株 (4,800株)
C & F ロジホールディングス	6,200	1,620.00	10,044,000	
日本郵船	51,800	5,420.00	280,756,000	
商船三井	36,800	5,010.00	184,368,000	
川崎汽船	19,200	3,540.00	67,968,000	
N S ユナイテッド海運	3,200	2,349.00	7,516,800	
明治海運	6,800	478.00	3,250,400	
飯野海運	29,300	456.00	13,360,800	
共栄タンカー	1,200	896.00	1,075,200	
九州旅客鉄道	47,700	2,645.00	126,166,500	
S G ホールディングス	116,900	2,781.00	325,098,900	
日本航空	150,900	2,612.00	394,150,800	
A N A ホールディングス	167,000	2,814.00	469,938,000	
パスコ	1,200	1,579.00	1,894,800	
西本W I S M E T T A C H D	1,500	2,811.00	4,216,500	貸付株式数 300株
シルバーライフ	1,400	2,415.00	3,381,000	貸付株式数 300株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	800	1,895.00	1,516,000	貸付株式数 200株
一家ダイニングプロジ	1,000	617.00	617,000	貸付株式数 200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	2,800	3,610.00	10,108,000	貸付株式数 1,100株
国際紙パルプ商事	13,600	252.00	3,427,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,160.00	1,624,000	
ブックオフG H D	3,600	941.00	3,387,600	貸付株式数 200株
三菱倉庫	21,400	3,445.00	73,723,000	
三井倉庫H O L D	6,700	2,375.00	15,912,500	貸付株式数 500株
住友倉庫	22,100	1,510.00	33,371,000	
渋沢倉庫	3,300	2,143.00	7,071,900	貸付株式数 600株
ヤマタネ	2,900	1,513.00	4,387,700	



東陽倉庫	9,600	323.00	3,100,800	貸付株式数	1,800株
乾汽船	4,100	1,197.00	4,907,700	貸付株式数	400株
日本トランスシティ	13,500	533.00	7,195,500	貸付株式数	3,500株
ケイヒン	1,100	1,375.00	1,512,500		
中央倉庫	3,500	1,061.00	3,713,500	貸付株式数	200株
川西倉庫	1,100	1,152.00	1,267,200	貸付株式数	200株
安田倉庫	5,000	950.00	4,750,000		
ファイズホールディングス	1,400	877.00	1,227,800	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,800	1,533.00	2,759,400		
宇徳	4,500	510.00	2,295,000		
上組	34,100	2,149.00	73,280,900		
サンリツ	1,900	751.00	1,426,900	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,400	1,327.00	1,857,800	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	1,500	1,708.00	2,562,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	11,800	2,376.00	28,036,800		
東海運	4,000	311.00	1,244,000		
エーアイティー	3,900	996.00	3,884,400		
内外トランスライン	2,400	1,930.00	4,632,000	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	1,800	972.00	1,749,600	貸付株式数	400株
日本コンセプト	2,100	1,642.00	3,448,200	貸付株式数	100株
TBSホールディングス	42,100	1,811.00	76,243,100		
日本テレビHLD S	53,000	1,336.00	70,808,000	貸付株式数	13,300株
朝日放送グループHD	5,300	708.00	3,752,400		
テレビ朝日HD	19,700	1,888.00	37,193,600	貸付株式数	7,000株
スカパーJ S A T H D	41,900	422.00	17,681,800		
テレビ東京HD	4,500	2,167.00	9,751,500		
日本BS放送	2,000	1,114.00	2,228,000	貸付株式数	800株
ビジョン	8,500	1,235.00	10,497,500		
スマートバリュー	2,100	795.00	1,669,500	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HLDGS	6,400	2,340.00	14,976,000	貸付株式数	1,000株
ワイヤレスゲート	3,100	464.00	1,438,400	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,200	1,477.00	6,203,400		
日本通信	58,700	222.00	13,031,400	貸付株式数	1,000株
クロップス	1,200	876.00	1,051,200	貸付株式数	400株
日本電信電話	748,100	2,894.00	2,165,001,400		
KDDI	512,900	3,603.00	1,847,978,700		
ソフトバンク	581,300	1,423.50	827,480,550		
光通信	7,500	20,840.00	156,300,000		
エムティーアイ	7,400	673.00	4,980,200	貸付株式数	2,500株

GMOインターネット	22,900	3,170.00	72,593,000	
ファイバーゲート	2,400	1,532.00	3,676,800	貸付株式数 800株
アйдママーケティングコ ミュ	1,700	439.00	746,300	
KADOKAWA	16,700	4,665.00	77,905,500	
学研ホールディングス	9,300	1,391.00	12,936,300	
ゼンリン	11,600	1,183.00	13,722,800	
昭文社ホールディングス	3,200	472.00	1,510,400	貸付株式数 200株
インプレスホールディング ス	8,200	205.00	1,681,000	
東京電力HD	554,700	349.00	193,590,300	
中部電力	199,300	1,373.00	273,638,900	
関西電力	246,700	1,092.00	269,396,400	
中国電力	95,600	1,034.00	98,850,400	
北陸電力	60,100	632.00	37,983,200	
東北電力	152,000	894.00	135,888,000	
四国電力	53,700	762.00	40,919,400	
九州電力	144,500	874.00	126,293,000	
北海道電力	63,100	526.00	33,190,600	貸付株式数 1,600株
沖縄電力	13,000	1,430.00	18,590,000	
電源開発	51,900	1,626.00	84,389,400	
エフオン	4,400	965.00	4,246,000	貸付株式数 1,500株
イーレックス	9,900	1,922.00	19,027,800	
レノバ	11,300	3,730.00	42,149,000	
東京瓦斯	125,400	2,192.50	274,939,500	
大阪瓦斯	117,800	2,157.00	254,094,600	
東邦瓦斯	32,200	5,880.00	189,336,000	貸付株式数 8,100株
北海道瓦斯	3,500	1,575.00	5,512,500	
広島ガス	11,600	373.00	4,326,800	貸付株式数 1,200株
西部ガスHLDGS	7,400	2,516.00	18,618,400	
静岡ガス	18,700	1,029.00	19,242,300	貸付株式数 1,900株
メタウォーター	7,300	2,097.00	15,308,100	
アイネット	3,000	1,441.00	4,323,000	貸付株式数 1,300株
松竹	4,200	13,040.00	54,768,000	貸付株式数 1,000株
東宝	37,700	4,645.00	175,116,500	
エイチ・アイ・エス	10,000	2,546.00	25,460,000	貸付株式数 3,800株
東映	2,100	21,210.00	44,541,000	貸付株式数 600株
ラックランド	1,900	2,742.00	5,209,800	貸付株式数 700株
NTTデータ	169,900	1,748.00	296,985,200	
共立メンテナンス	10,400	4,015.00	41,756,000	貸付株式数 4,000株

イチネンホールディングス	6,200	1,236.00	7,663,200	貸付株式数	500株
建設技術研究所	4,100	2,496.00	10,233,600		
スペース	3,900	918.00	3,580,200	貸付株式数	600株
長 大	2,500	1,891.00	4,727,500		
アインホールディングス	9,300	7,060.00	65,658,000		
燦ホールディングス	2,700	1,200.00	3,240,000		
ピー・シー・エー	1,000	4,115.00	4,115,000		
スバル興業	400	8,040.00	3,216,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,264.00	2,907,200		
タナベ経営	1,000	1,457.00	1,457,000		
ビジネスB太田昭和	2,300	1,770.00	4,071,000		
ナ ガ ワ	2,000	8,170.00	16,340,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	4,200	4,675.00	19,635,000		
常磐興産	2,600	1,477.00	3,840,200	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,800	2,626.00	28,360,800	貸付株式数	4,200株
D T S	13,200	2,681.00	35,389,200		
スクウェア・エニックス・ H D	27,300	5,640.00	153,972,000		
シーイーシー	6,800	1,617.00	10,995,600		
カプコン	55,100	3,310.00	182,381,000		
西尾レントオール	5,700	3,295.00	18,781,500	貸付株式数	1,300株
アイ・エス・ビー	3,100	1,480.00	4,588,000		
アゴーラ ホスピタリ ティーG	52,200	27.00	1,409,400		
日本空港ビルデング	22,300	5,560.00	123,988,000	貸付株式数	2,700株
トランス・コスモス	6,000	2,987.00	17,922,000	貸付株式数	2,300株
乃村工藝社	26,800	964.00	25,835,200	貸付株式数	2,100株
ジャステック	4,100	1,282.00	5,256,200		
S C S K	14,700	6,340.00	93,198,000		
藤田観光	2,700	2,322.00	6,269,400	貸付株式数	1,000株
K N T - C Tホールディン グス	3,800	1,441.00	5,475,800	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,500	2,348.00	15,262,000	貸付株式数	2,500株
トーカイ	6,000	2,448.00	14,688,000		
白 洋 舎	700	2,334.00	1,633,800	貸付株式数	300株
セコム	61,200	8,785.00	537,642,000		
日本システムウエア	1,900	2,308.00	4,385,200		
セントラル警備保障	2,900	3,190.00	9,251,000	貸付株式数	1,100株
アイネス	6,300	1,346.00	8,479,800	貸付株式数	1,500株
丹青社	11,700	920.00	10,764,000		

メイテック	7,600	6,300.00	47,880,000	
T K C	10,700	3,355.00	35,898,500	
富士ソフト	6,800	5,760.00	39,168,000	貸付株式数 2,700株
応用地質	7,100	1,276.00	9,059,600	
船井総研ホールディング	12,600	2,490.00	31,374,000	貸付株式数 1,600株
N S D	20,300	1,827.00	37,088,100	
進学会ホールディングス	2,600	423.00	1,099,800	貸付株式数 1,000株
丸紅建材リース	500	1,817.00	908,500	
オ オ バ	4,100	752.00	3,083,200	貸付株式数 1,800株
コナミホールディングス	23,200	7,240.00	167,968,000	
いであ	1,500	1,795.00	2,692,500	貸付株式数 500株
学 究 社	1,900	1,350.00	2,565,000	貸付株式数 700株
ベネッセホールディングス	22,700	2,685.00	60,949,500	貸付株式数 9,000株
イオンディライト	7,600	3,420.00	25,992,000	
ナック	2,700	919.00	2,481,300	貸付株式数 300株
福井コンピュータH L D S	3,000	4,185.00	12,555,000	
ダイセキ	10,500	4,420.00	46,410,000	貸付株式数 900株
ステップ	2,200	1,582.00	3,480,400	
日鉄物産	4,400	4,435.00	19,514,000	
泉州電業	1,800	3,575.00	6,435,000	
元気寿司	1,800	2,651.00	4,771,800	貸付株式数 700株 (500株)
トラスコ中山	14,700	2,881.00	42,350,700	
ヤマダホールディングス	212,400	518.00	110,023,200	貸付株式数 79,800株
オートバックスセブン	23,400	1,478.00	34,585,200	
モリト	4,500	613.00	2,758,500	貸付株式数 600株
アークランドサカモト	10,100	1,462.00	14,766,200	貸付株式数 2,200株
ニトリホールディングス	25,400	18,925.00	480,695,000	
グルメ杵屋	4,100	979.00	4,013,900	貸付株式数 1,600株
愛 眼	4,400	230.00	1,012,000	貸付株式数 1,700株
ケーユーホールディングス	3,400	960.00	3,264,000	貸付株式数 200株
吉野家ホールディングス	21,000	2,077.00	43,617,000	貸付株式数 8,400株
加藤産業	9,200	3,340.00	30,728,000	貸付株式数 3,600株
北恵	1,800	972.00	1,749,600	
イノテック	3,700	1,359.00	5,028,300	
イエローハット	12,000	1,911.00	22,932,000	
松屋フーズH L D G S	2,900	3,545.00	10,280,500	貸付株式数 100株
J B C Cホールディングス	4,200	1,390.00	5,838,000	
J Kホールディングス	5,800	792.00	4,593,600	貸付株式数 2,200株
サガミホールディングス	8,700	1,033.00	8,987,100	貸付株式数 3,500株

日 伝	5,300	2,183.00	11,569,900	
関西スーパーマーケット	4,800	1,014.00	4,867,200	
ミロク情報サービス	6,200	1,602.00	9,932,400	貸付株式数 700株
北沢産業	4,300	256.00	1,100,800	
杉本商事	3,200	2,191.00	7,011,200	
因幡電機産業	17,100	2,575.00	44,032,500	貸付株式数 3,600株
王将フードサービス	4,100	5,620.00	23,042,000	貸付株式数 1,600株
ブレナス	7,000	2,025.00	14,175,000	
ミニストップ	5,400	1,402.00	7,570,800	貸付株式数 1,800株
アークス	12,100	2,448.00	29,620,800	貸付株式数 4,100株
パローホールディングス	13,000	2,269.00	29,497,000	
東 テ ク	2,300	2,702.00	6,214,600	
ミスミグループ本社	80,400	3,730.00	299,892,000	
藤 久	1,700	826.00	1,404,200	貸付株式数 600株
アルテック	6,300	348.00	2,192,400	
ベ ル ク	3,100	5,650.00	17,515,000	
大 庄	3,100	1,107.00	3,431,700	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	2,100	1,838.00	3,859,800	貸付株式数 800株
ファーストリテイリング	8,600	84,060.00	722,916,000	
ソフトバンクグループ	507,600	8,042.00	4,082,119,200	
蔵王産業	900	1,471.00	1,323,900	
スズケン	27,300	3,505.00	95,686,500	
サンドラッグ	24,300	3,625.00	88,087,500	
サクスパーホールディング グ	5,000	635.00	3,175,000	貸付株式数 2,000株
ジェコス	4,500	883.00	3,973,500	
ヤマザワ	1,100	1,712.00	1,883,200	貸付株式数 500株
や ま や	1,200	2,289.00	2,746,800	貸付株式数 500株
グローセル	6,400	425.00	2,720,000	貸付株式数 2,000株
ベルーナ	13,900	1,066.00	14,817,400	貸付株式数 1,800株
合計			176,669,720,970	

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

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

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

- (2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

- 第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

### 【ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	588,651	1,031,400
親投資信託受益証券	379,951,039	445,597,408
未収入金	17,000	17,000
流動資産合計	380,556,690	446,645,808
資産合計	380,556,690	446,645,808
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,006,532	6,281,907
未払受託者報酬	34,152	62,066
未払委託者報酬	495,754	900,672
その他未払費用	8,469	15,443
流動負債合計	4,544,907	7,260,088
負債合計	4,544,907	7,260,088
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 333,877,680	1 285,541,229
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	42,134,103	153,844,491
(分配準備積立金)	88,664	67,088,824
元本等合計	376,011,783	439,385,720
純資産合計	376,011,783	439,385,720
負債純資産合計	380,556,690	446,645,808



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		25,242,172		227,397,369
営業収益合計		25,242,172		227,397,371
営業費用				
支払利息		19		168
受託者報酬		48,780		147,632
委託者報酬		708,447		2,142,045
その他費用		12,134		36,767
営業費用合計		769,380		2,326,612
営業利益		24,472,792		225,070,759
経常利益		24,472,792		225,070,759
当期純利益		24,472,792		225,070,759
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		30,109,772		150,092,397
期首剰余金又は期首欠損金( )		3,002,939		42,134,103
剰余金増加額又は欠損金減少額		334,954,298		197,976,113
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		334,954,298		197,976,113
剰余金減少額又は欠損金増加額		286,179,622		154,962,180
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		286,179,622		154,962,180
分配金		1 4,006,532		1 6,281,907
期末剰余金又は期末欠損金( )		42,134,103		153,844,491

## (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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	30,938,291円	333,877,680円
期中追加設定元本額	1,970,995,928円	762,009,014円
期中一部解約元本額	1,668,056,539円	810,345,465円
2. 計算期間末日における受益権の総数	333,877,680口	285,541,229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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(3,427,433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(42,713,484円)及び分配準備積立金(8円)より分配対象額は46,140,925円(1万口当たり1,381.97円)であり、うち4,006,532円(1万口当たり120円)を分配金額としております。</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(6,351,170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(67,003,681円)、投資信託約款に規定される収益調整金(86,755,667円)及び分配準備積立金(15,880円)より分配対象額は160,126,398円(1万口当たり5,607.82円)であり、うち6,281,907円(1万口当たり220円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,125,860	75,810,936
合計	5,125,860	75,810,936

## (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6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2020年6月16日 至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1262円 (11,262円)	1.5388円 (15,388円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス225・マザーファンド	116,453,431	445,597,408	
親投資信託受益証券 合計			445,597,408	
合計			445,597,408	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年6月15日現在		2021年6月15日現在	
	金額(円)		金額(円)	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		17,760,496,540		3,489,894,062
株式	2 3	156,597,158,960		188,037,771,900
派生商品評価勘定		-		39,353,550
未収配当金		963,998,450		793,699,850
未収利息		800,124		21,001
前払金		100,643,200		-
その他未収収益	4	27,137,864		3,834,687
差入委託証拠金		89,100,000		-
流動資産合計		175,539,335,138		192,364,575,050
資産合計		175,539,335,138		192,364,575,050
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		210,480,200		-
前受金		-		1,900,000
未払解約金		548,852,000		186,918,000
受入担保金		15,202,023,375		65,324,700
流動負債合計		15,961,355,575		254,142,700
負債合計		15,961,355,575		254,142,700
純資産の部				
元本等				
元本	1	57,999,406,705		50,206,993,331
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金( )		101,578,572,858		141,903,439,019
元本等合計		159,577,979,563		192,110,432,350
純資産合計		159,577,979,563		192,110,432,350
負債純資産合計		175,539,335,138		192,364,575,050

## 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6月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	65,172,307,878円	57,999,406,705円
期中追加設定元本額	16,033,323,039円	10,080,290,067円
期中一部解約元本額	23,206,224,212円	17,872,703,441円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファ ンド225	26,392,822,617円	20,492,845,846円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	494,444,637円	349,458,715円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	9,505,686,495円	7,385,744,818円
D-I's 日経225イン デックス	159,930,107円	114,837,733円

	iFree 日経225イン デックス	3,558,988,869円	5,573,145,682円
	DC・ダイワ・ストックイン デックス225（確定拠出年 金専用ファンド）	5,445,218,527円	5,431,588,581円
	ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	322,149,773円	305,581,482円
	ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	4,073,792,066円	3,793,099,418円
	ダイワ日経225インデック ス（ダイワSMA専用）	138,093,712円	116,453,431円
	ダイワ・インデックスセレクト 日経225	7,908,279,902円	6,644,237,625円
計		57,999,406,705円	50,206,993,331円
2.	期末日における受益権の総数	57,999,406,705口	50,206,993,331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 13,805,877,100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 62,996,000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 2,281,750,000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 3,274,570,000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26,566,350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3,819,950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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用 の基本方針」に従っております。



2. 金融商品の内容及びリスク	<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（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	1,271,816,979	37,566,639,983

合計	1,271,816,979	37,566,639,983
----	---------------	----------------

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2019年9月20日から2020年6月15日まで、及び2020年9月24日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15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	3,199,403,200	-	2,989,000,000	210,403,200	4,048,560,000	-	4,087,990,000	39,430,000
合計	3,199,403,200	-	2,989,000,000	210,403,200	4,048,560,000	-	4,087,990,000	39,430,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.7514円	3.8264円
(1万口当たり純資産額)	(27,514円)	(38,264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
日本水産	230,000	546.00	125,580,000
マルハニチロ	23,000	2,457.00	56,511,000
I N P E X	92,000	810.00	74,520,000
コムシスホールディングス	230,000	3,205.00	737,150,000
大成建設	46,000	3,620.00	166,520,000
大 林 組	230,000	929.00	213,670,000
清水建設	230,000	864.00	198,720,000
長谷工コーポレーション	46,000	1,511.00	69,506,000
鹿島建設	115,000	1,427.00	164,105,000
大和ハウス	230,000	3,280.00	754,400,000
積水ハウス	230,000	2,217.50	510,025,000
日揮ホールディングス	230,000	1,050.00	241,500,000
日清製粉G本社	230,000	1,694.00	389,620,000
明治ホールディングス	46,000	7,010.00	322,460,000
日本ハム	115,000	4,445.00	511,175,000
エムスリー	552,000	7,821.00	4,317,192,000
ディー・エヌ・エー	69,000	2,313.00	159,597,000
サッポロホールディングス	46,000	2,330.00	107,180,000
アサヒグループホールディ ン	230,000	5,505.00	1,266,150,000
キリンHD	230,000	2,306.00	530,380,000
宝ホールディングス	230,000	1,509.00	347,070,000
双日	23,000	349.00	8,027,000
キッコーマン	230,000	7,440.00	1,711,200,000
味 の 素	230,000	2,692.50	619,275,000
ニチレイ	115,000	2,948.00	339,020,000
日本たばこ産業	230,000	2,202.00	506,460,000
J . フロント リテイリ ング	115,000	1,116.00	128,340,000
三越伊勢丹HD	230,000	841.00	193,430,000
東洋紡	23,000	1,364.00	31,372,000
ユニチカ	23,000	385.00	8,855,000
日清紡ホールディングス	230,000	920.00	211,600,000
東急不動産HD	230,000	729.00	167,670,000
セブン&アイ・HLDGS	230,000	5,006.00	1,151,380,000
帝 人	46,000	1,762.00	81,052,000
東 レ	230,000	762.70	175,421,000
ク ラ レ	230,000	1,114.00	256,220,000
旭 化 成	230,000	1,250.50	287,615,000

SUMCO	23,000	2,664.00	61,272,000	
ネクソン	460,000	2,583.00	1,188,180,000	
王子ホールディングス	230,000	647.00	148,810,000	
日本製紙	23,000	1,262.00	29,026,000	
昭和電工	23,000	3,590.00	82,570,000	
住友化学	230,000	607.00	139,610,000	
日産化学	230,000	5,610.00	1,290,300,000	
東ソー	115,000	1,957.00	225,055,000	
トクヤマ	46,000	2,307.00	106,122,000	
デンカ	46,000	3,790.00	174,340,000	
信越化学	230,000	19,175.00	4,410,250,000	
協和キリン	230,000	3,775.00	868,250,000	
三井化学	46,000	3,770.00	173,420,000	
三菱ケミカルHLDGS	115,000	889.10	102,246,500	
宇部興産	23,000	2,323.00	53,429,000	
電通グループ	230,000	3,870.00	890,100,000	
花王	230,000	6,885.00	1,583,550,000	
武田薬品	230,000	3,800.00	874,000,000	
アステラス製薬	1,150,000	1,944.50	2,236,175,000	
大日本住友製薬	230,000	2,282.00	524,860,000	
塩野義製薬	230,000	5,837.00	1,342,510,000	
中外製薬	690,000	4,555.00	3,142,950,000	
エーザイ	230,000	11,405.00	2,623,150,000	
テルモ	920,000	4,589.00	4,221,880,000	
第一三共	690,000	2,620.00	1,807,800,000	
大塚ホールディングス	230,000	4,790.00	1,101,700,000	
DIC	23,000	2,908.00	66,884,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
Zホールディングス	92,000	524.80	48,281,600	
トレンドマイクロ	230,000	5,790.00	1,331,700,000	
サイバーエージェント	184,000	2,233.00	410,872,000	
楽天グループ	230,000	1,313.00	301,990,000	
富士フイルムHLDGS	230,000	7,880.00	1,812,400,000	
コニカミノルタ	230,000	642.00	147,660,000	
資生堂	230,000	8,160.00	1,876,800,000	
出光興産	92,000	2,729.00	251,068,000	
ENEOSホールディングス	230,000	470.80	108,284,000	
横浜ゴム	115,000	2,351.00	270,365,000	
ブリヂストン	230,000	4,997.00	1,149,310,000	

A G C	46,000	4,825.00	221,950,000	
日本板硝子	23,000	655.00	15,065,000	
日本電気硝子	69,000	2,664.00	183,816,000	
住友大阪セメント	23,000	3,040.00	69,920,000	
太平洋セメント	23,000	2,455.00	56,465,000	
東海カーボン	230,000	1,638.00	376,740,000	
T O T O	115,000	6,140.00	706,100,000	
日本碍子	230,000	1,978.00	454,940,000	
日本製鉄	23,000	1,921.50	44,194,500	
神戸製鋼所	23,000	737.00	16,951,000	
J F E ホールディングス	23,000	1,342.00	30,866,000	
大平洋金属	23,000	1,837.00	42,251,000	
日本製鋼所	46,000	2,981.00	137,126,000	
日本軽金属HD	23,000	1,861.00	42,803,000	
三井金属	23,000	3,140.00	72,220,000	
東邦亜鉛	23,000	1,980.00	45,540,000	
三菱マテリアル	23,000	2,243.00	51,589,000	
住友鉱山	115,000	4,702.00	540,730,000	
D O W A ホールディングス	46,000	4,420.00	203,320,000	
古河電工	23,000	2,854.00	65,642,000	
住友電工	230,000	1,694.50	389,735,000	
フジクラ	230,000	480.00	110,400,000	
東洋製罐グループHD	230,000	1,655.00	380,650,000	
リクルートホールディングス	690,000	5,739.00	3,959,910,000	
オークマ	46,000	5,570.00	256,220,000	
アマダ	230,000	1,141.00	262,430,000	
日本郵政	230,000	907.70	208,771,000	
小松製作所	230,000	3,042.00	699,660,000	
住友重機械	46,000	3,210.00	147,660,000	
日立建機	230,000	3,425.00	787,750,000	
クボタ	230,000	2,281.50	524,745,000	
荏原製作所	46,000	5,350.00	246,100,000	
ダイキン工業	230,000	20,455.00	4,704,650,000	
日本精工	230,000	1,028.00	236,440,000	
N T N	230,000	309.00	71,070,000	
ジェイテクト	230,000	1,213.00	278,990,000	
ミネベアミツミ	230,000	2,916.00	670,680,000	
日立	46,000	6,100.00	280,600,000	
三菱電機	230,000	1,739.00	399,970,000	

富士電機	46,000	5,160.00	237,360,000	
安川電機	230,000	5,250.00	1,207,500,000	
オムロン	230,000	8,550.00	1,966,500,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	46,000	2,968.00	136,528,000	
日本電気	23,000	5,550.00	127,650,000	
富士通	23,000	19,445.00	447,235,000	
沖電気	23,000	1,028.00	23,644,000	
セイコーエプソン	460,000	2,077.00	955,420,000	
パナソニック	230,000	1,266.50	291,295,000	
シャープ	230,000	1,924.00	442,520,000	
ソニーグループ	230,000	11,015.00	2,533,450,000	
T D K	230,000	14,060.00	3,233,800,000	
アルプスアルパイン	230,000	1,213.00	278,990,000	
横河電機	230,000	1,732.00	398,360,000	
アドバンテスト	460,000	10,300.00	4,738,000,000	
デンソー	230,000	7,805.00	1,795,150,000	
カシオ	230,000	1,906.00	438,380,000	貸付株式数 30,000株
ファナック	230,000	27,165.00	6,247,950,000	
京セラ	460,000	7,144.00	3,286,240,000	
太陽誘電	230,000	5,540.00	1,274,200,000	
日東電工	230,000	8,470.00	1,948,100,000	
三井E & S H D	23,000	520.00	11,960,000	
日立造船	46,000	715.00	32,890,000	
三菱重工業	23,000	3,383.00	77,809,000	
川崎重工業	23,000	2,481.00	57,063,000	
I H I	23,000	2,751.00	63,273,000	
コンコルディア・フィナン シャル	230,000	415.00	95,450,000	
日産自動車	230,000	563.00	129,490,000	
いすゞ自動車	115,000	1,561.00	179,515,000	
トヨタ自動車	230,000	10,075.00	2,317,250,000	
日野自動車	230,000	998.00	229,540,000	
三菱自動車工業	23,000	311.00	7,153,000	
マツダ	46,000	1,003.00	46,138,000	
本田技研	460,000	3,626.00	1,667,960,000	
スズキ	230,000	4,770.00	1,097,100,000	
S U B A R U	230,000	2,292.50	527,275,000	
ヤマハ発動機	230,000	3,250.00	747,500,000	
ニコン	230,000	1,200.00	276,000,000	
オリンパス	920,000	2,373.50	2,183,620,000	

S C R E E Nホールディングス	46,000	10,910.00	501,860,000	
キヤノン	345,000	2,623.00	904,935,000	
リコー	230,000	1,350.00	310,500,000	
シチズン時計	230,000	436.00	100,280,000	
バンダイナムコHLDGS	230,000	8,140.00	1,872,200,000	
凸版印刷	115,000	1,909.00	219,535,000	
大日本印刷	115,000	2,442.00	280,830,000	
ヤマハ	230,000	6,540.00	1,504,200,000	
伊藤忠	230,000	3,302.00	759,460,000	
丸紅	230,000	993.90	228,597,000	
豊田通商	230,000	5,430.00	1,248,900,000	
三井物産	230,000	2,604.00	598,920,000	
東京エレクトロン	230,000	49,500.00	11,385,000,000	
住友商事	230,000	1,534.00	352,820,000	
三菱商事	230,000	3,052.00	701,960,000	
高島屋	115,000	1,303.00	149,845,000	
丸井グループ	230,000	2,152.00	494,960,000	
クレディセゾン	230,000	1,414.00	325,220,000	
イオン	230,000	3,002.00	690,460,000	
新生銀行	23,000	1,573.00	36,179,000	
あおぞら銀行	23,000	2,482.00	57,086,000	
三菱UFJフィナンシャルG	230,000	608.80	140,024,000	
りそなホールディングス	23,000	448.10	10,306,300	
三井住友トラストHD	23,000	3,662.00	84,226,000	
三井住友フィナンシャルG	23,000	3,920.00	90,160,000	
千葉銀行	230,000	694.00	159,620,000	
ふくおかフィナンシャルG	46,000	1,985.00	91,310,000	
静岡銀行	230,000	897.00	206,310,000	
みずほフィナンシャルG	23,000	1,624.50	37,363,500	
大和証券G本社	230,000	638.00	146,740,000	
野村ホールディングス	230,000	585.40	134,642,000	
松井証券	230,000	824.00	189,520,000	
S O M P Oホールディングス	57,500	4,290.00	246,675,000	
日本取引所グループ	230,000	2,559.50	588,685,000	
M S & A D	69,000	3,334.00	230,046,000	
第一生命HLDGS	23,000	2,165.50	49,806,500	
東京海上HD	115,000	5,165.00	593,975,000	

T & Dホールディングス	46,000	1,451.00	66,746,000	
三井不動産	230,000	2,748.00	632,040,000	
三菱地所	230,000	1,932.50	444,475,000	
東京建物	115,000	1,717.00	197,455,000	
住友不動産	230,000	4,175.00	960,250,000	
東武鉄道	46,000	3,100.00	142,600,000	
東急	115,000	1,610.00	185,150,000	
小田急電鉄	115,000	3,030.00	348,450,000	
京王電鉄	46,000	7,220.00	332,120,000	
京成電鉄	115,000	3,645.00	419,175,000	
東日本旅客鉄道	23,000	8,360.00	192,280,000	
西日本旅客鉄道	23,000	6,903.00	158,769,000	
東海旅客鉄道	23,000	18,000.00	414,000,000	
日本通運	23,000	8,700.00	200,100,000	
ヤマトホールディングス	230,000	3,030.00	696,900,000	
日本郵船	23,000	5,420.00	124,660,000	
商船三井	23,000	5,010.00	115,230,000	
川崎汽船	23,000	3,540.00	81,420,000	
A N Aホールディングス	23,000	2,814.00	64,722,000	
三菱倉庫	115,000	3,445.00	396,175,000	
スカパー J S A T H D	23,000	422.00	9,706,000	
日本電信電話	92,000	2,894.00	266,248,000	
K D D I	1,380,000	3,603.00	4,972,140,000	
ソフトバンク	230,000	1,423.50	327,405,000	
東京電力H D	23,000	349.00	8,027,000	
中部電力	23,000	1,373.00	31,579,000	
関西電力	23,000	1,092.00	25,116,000	
東京瓦斯	46,000	2,192.50	100,855,000	
大阪瓦斯	46,000	2,157.00	99,222,000	
東 宝	23,000	4,645.00	106,835,000	
N T Tデータ	1,150,000	1,748.00	2,010,200,000	
セコム	230,000	8,785.00	2,020,550,000	
コナミホールディングス	230,000	7,240.00	1,665,200,000	
ファーストリテイリング	230,000	84,060.00	19,333,800,000	
ソフトバンクグループ	1,380,000	8,042.00	11,097,960,000	
合計			188,037,771,900	

(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  
ず。

武田薬品

50,000株 ファナック

30,000株



ファーストリテイリング

27,000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。

**【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2020年6月16日から2021年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,079,626	26,105,993
親投資信託受益証券	8,069,419,925	11,356,445,563
未収入金	-	21,130,000
流動資産合計	8,088,499,551	11,403,681,556
資産合計	8,088,499,551	11,403,681,556
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	110,985,385	149,617,707
未払解約金	-	20,712,706
未払受託者報酬	878,167	1,218,099
未払委託者報酬	16,905,594	23,449,421
その他未払費用	219,509	304,446
流動負債合計	128,988,655	195,302,379
負債合計	128,988,655	195,302,379
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 6,936,586,592	1 7,124,652,730
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,022,924,304	4,083,726,447
(分配準備積立金)	261,234,622	2,236,145,631
元本等合計	7,959,510,896	11,208,379,177
純資産合計	7,959,510,896	11,208,379,177
負債純資産合計	8,088,499,551	11,403,681,556

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		22		24
有価証券売買等損益		391,668,171		3,220,043,638
営業収益合計		391,668,193		3,220,043,662
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,224		4,294
受託者報酬		1,430,382		2,174,718
委託者報酬		27,536,776		41,865,347
その他費用		358,861		543,576
営業費用合計		29,329,243		44,587,935
<b>営業利益</b>		362,338,950		3,175,455,727
経常利益		362,338,950		3,175,455,727
<b>当期純利益</b>		362,338,950		3,175,455,727
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		2,394,538		907,301,652
期首剰余金又は期首欠損金( )		386,096,476		1,022,924,304
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,575,236,495		2,106,261,884
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,575,236,495		2,106,261,884
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,192,156,770		1,163,996,109
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,192,156,770		1,163,996,109
分配金		110,985,385		149,617,707
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,022,924,304		4,083,726,447

## (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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	2,617,621,424円	6,936,586,592円
期中追加設定元本額	12,869,207,903円	5,926,265,855円
期中一部解約元本額	8,550,242,735円	5,738,199,717円
2. 計算期間末日における受益権の総数	6,936,586,592口	7,124,652,730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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(116,328,598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(248,404,890円)、投資信託約款に規定される収益調整金(761,689,682円)及び分配準備積立金(7,486,519円)より分配対象額は1,133,909,689円(1万口当たり1,634.68円)であり、うち110,985,385円(1万口当たり160円)を分配金額としております。</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(158,520,838円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,109,633,237円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,847,580,816円)及び分配準備積立金(117,609,263円)より分配対象額は4,233,344,154円(1万口当たり5,941.83円)であり、うち149,617,707円(1万口当たり210円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	377,296,538	2,362,172,637
合計	377,296,538	2,362,172,637

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1475円 (11,475円)	1.5732円 (15,732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	4,117,936,603	11,356,445,563	
親投資信託受益証券 合計			11,356,445,563	
合計			11,356,445,563	

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6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	55,312,019	161,762,026
コール・ローン	762,067,925	1,843,049,943
株式	51,952,815,871	69,671,218,917
投資証券	1,477,281,376	1,748,776,321
派生商品評価勘定	249,970,415	108,767,111
未収入金	835,734	990,365
未収配当金	69,722,194	76,236,982
差入委託証拠金	201,733,778	705,286,060
流動資産合計	54,769,739,312	74,316,087,725
資産合計	54,769,739,312	74,316,087,725
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	99,323,100	346,246,305
未払金	1,459,901	-
未払解約金	10,750,000	21,130,000
その他未払費用	1,137	-
流動負債合計	111,534,138	367,376,305
負債合計	111,534,138	367,376,305
純資産の部		
元本等		
元本	1 27,661,024,245	26,814,400,442
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,997,180,929	47,134,310,978
元本等合計	54,658,205,174	73,948,711,420
純資産合計	54,658,205,174	73,948,711,420
負債純資産合計	54,769,739,312	74,316,087,725

## 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6月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)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	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	21,623,237,931円	27,661,024,245円
期中追加設定元本額	13,228,872,441円	6,399,270,276円
期中一部解約元本額	7,191,086,127円	7,245,894,079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	21,439,177,203円	20,363,112,482円
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 (為替ヘッジあり)	1,477,569,279円	1,111,188,228円
	i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	660,563,226円	1,222,163,129円
	ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	4,083,714,537円	4,117,936,603円
計		27,661,024,245円	26,814,400,442円
2.	期末日における受益権の総数	27,661,024,245口	26,814,400,442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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	3,480,038,509	6,733,279,694
投資証券	151,745,151	346,735,230
合計	3,631,783,660	7,080,014,924

(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6月15日まで、及び2021年1月13日から2021年6月15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

	2020年6月15日 現在	2021年6月15日 現在
--	---------------	---------------

種 類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	1,001,417,056	-	1,065,633,872	64,216,816	2,657,529,237	-	2,735,854,506	78,325,269
合計	1,001,417,056	-	1,065,633,872	64,216,816	2,657,529,237	-	2,735,854,506	78,325,269

## (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6月15日 現在				2021年6月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	53,762,204,536	-	53,675,774,037	86,430,499	70,650,034,812	-	70,965,839,275	315,804,463
アメリカ・ドル	38,386,244,034	-	38,210,169,366	176,074,668	50,399,360,536	-	50,723,337,204	323,976,668
イギリス・ポンド	2,680,408,529	-	2,696,388,992	15,980,463	3,347,763,278	-	3,341,746,511	6,016,767
イスラエル・シェケル	60,529,579	-	60,822,648	293,069	87,605,733	-	88,444,830	839,097
オーストラリア・ドル	1,188,494,961	-	1,204,413,786	15,918,825	1,655,400,035	-	1,658,293,852	2,893,817

カナダ・ドル	1,850,809,809	-	1,855,581,507	4,771,698	2,598,983,801	-	2,597,496,092	1,487,709
シンガポ ル・ドル	206,327,963	-	207,510,147	1,182,184	257,321,092	-	257,609,565	288,473
スイス・フラン	1,880,163,140	-	1,888,847,515	8,684,375	2,161,493,853	-	2,172,767,450	11,273,597
スウェーデ ン・クローナ	568,963,476	-	569,598,568	635,092	886,941,117	-	888,501,224	1,560,107
デンマーク ・クローネ	447,553,459	-	450,545,034	2,991,575	587,514,896	-	586,078,270	1,436,626
ニュージ ーランド・ドル	59,327,456	-	60,797,519	1,470,063	50,962,181	-	50,334,431	627,750
ノルウェー ・クローネ	108,169,760	-	107,821,728	348,032	154,512,827	-	155,140,666	627,839
ユーロ	5,759,200,721	-	5,799,410,148	40,209,427	7,698,269,652	-	7,677,522,994	20,746,658
香港・ドル	566,011,649	-	563,867,079	2,144,570	763,905,811	-	768,566,186	4,660,375
合計	53,762,204,536	-	53,675,774,037	86,430,499	70,650,034,812	-	70,965,839,275	315,804,463

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.9760円	2.7578円
(1万口当たり純資産額)	(19,760円)	(27,578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	160.960	208,443.200	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,220	367.550	448,411.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,271	148.580	337,425.180	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	87.530	139,522.820	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	186.420	139,069.320	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,200	48.640	301,568.000	
	ABBOTT LABORATORIES	21,545	110.480	2,380,291.600	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	34.960	138,092.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,943	173.270	336,663.610	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,729	54.150	256,075.350	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,905	68.310	471,680.550	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	443	351.790	155,842.970	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,337	146.500	1,074,870.500	
	QORVO INC	1,283	184.940	237,278.020	
	AFLAC INC	8,471	55.430	469,547.530	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,248	137.500	171,600.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	86.400	158,544.000	
	ADOBE INC	5,684	556.950	3,165,703.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,872	52.690	151,325.680	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,607	337.620	542,555.340	
	GARMIN LTD	1,527	142.680	217,872.360	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,602	299.120	778,310.240	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,391	223.170	1,872,619.470		
WR BERKLEY CORP	1,771	75.440	133,604.240		
AUTOZONE INC	291	1,385.990	403,323.090		
DOLLAR TREE INC	2,566	100.200	257,113.200		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	11.050	136,633.250		
PINNACLE WEST CAPITAL	1,508	88.080	132,824.640		



CELANESE CORP	1,297	156.470	202,941.590
DR HORTON INC	4,397	87.980	386,848.060
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	64.670	158,441.500
AUTODESK INC	2,684	280.520	752,915.680
MOODY'S CORP	1,937	347.760	673,611.120
DEVON ENERGY CORP	7,748	28.980	224,537.040
ALBEMARLE CORP	1,668	168.340	280,791.120
ATMOS ENERGY CORP	1,654	101.100	167,219.400
ALLIANT ENERGY CORP	3,614	58.570	211,671.980
CITIGROUP INC	24,865	75.160	1,868,853.400
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,030	199.170	1,001,825.100
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,918	85.130	503,799.340
ALLEGHANY CORP	146	698.710	102,011.660
DOMINO'S PIZZA INC	526	448.160	235,732.160
HESS CORP	2,112	88.670	187,271.040
DAVITA INC	1,000	121.560	121,560.000
DANAHER CORP	7,703	247.410	1,905,799.230
FORTIVE CORP	4,335	71.110	308,261.850
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	6,622	113.840	753,848.480
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,580	65.220	429,147.600
BUNGE LTD	1,838	82.620	151,855.560
TE CONNECTIVITY LTD	4,221	137.100	578,699.100
APPLE INC	201,093	130.480	26,238,614.640
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,359	120.690	405,397.710
BOEING CO/THE	6,353	245.140	1,557,374.420
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,063	120.480	248,550.240
BECTON DICKINSON AND CO	3,430	242.720	832,529.600
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	2,000	16.750	33,500.000
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	106.700	149,380.000
NISOURCE INC	4,026	26.030	104,796.780
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,708	98.710	168,596.680
BOSTON BEER COMPANY INC-A	116	1,021.880	118,538.080
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,978	49.640	495,307.920
VERIZON COMMUNICATIONS INC	49,301	57.180	2,819,031.180
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	16,359	283.530	4,638,267.270
ANSYS INC	1,038	338.500	351,363.000
TRUIST FINANCIAL CORP	17,123	56.690	970,702.870

BLACKSTONE GROUP INC/THE	8,193	95.610	783,332.730	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,284	67.290	1,835,940.360	
JPMORGAN CHASE & CO	36,629	157.570	5,771,631.530	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,658	192.630	512,010.540	
LKQ CORP	3,300	48.690	160,677.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	150.030	82,066.410	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,665	75.710	277,477.150	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,147	130.960	412,131.120	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,348	254.620	343,227.760	
DOLLAR GENERAL CORP	3,052	209.550	639,546.600	
SERVICENOW INC	2,419	509.340	1,232,093.460	
CATERPILLAR INC	6,572	219.010	1,439,333.720	
BROWN & BROWN INC	2,886	52.120	150,418.320	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,478	48.660	120,579.480	
CHARLES RIVER LABORATORIES	640	355.330	227,411.200	
CMS ENERGY CORP	3,384	60.300	204,055.200	
MOSAIC CO/THE	5,209	33.130	172,574.170	
DELTA AIR LINES INC	1,650	45.900	75,735.000	
CORNING INC	9,983	41.460	413,895.180	
CISCO SYSTEMS INC	50,461	54.170	2,733,472.370	
MORGAN STANLEY	17,009	90.720	1,543,056.480	
ZILLOW GROUP INC - A	1,016	116.600	118,465.600	
MSCI INC	1,006	490.760	493,704.560	
FAIR ISAAC CORP	398	505.600	201,228.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	333.610	150,124.500	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,780	73.990	205,692.200	
BROADCOM INC	4,876	475.830	2,320,147.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,416	166.660	235,990.560	
ARAMARK	3,173	37.640	119,431.720	
DTE ENERGY COMPANY	2,281	138.380	315,644.780	
CENTENE CORP	6,844	68.780	470,730.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,358	114.760	155,844.080	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,532	47.100	260,557.200	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,232	144.460	322,434.720	
GARTNER INC	1,174	229.620	269,573.880	
SPLUNK INC	2,029	122.390	248,329.310	
DOMINION ENERGY INC	9,740	78.270	762,349.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,768	93.400	445,331.200	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	68.840	96,376.000	

DEERE & CO	3,623	335.540	1,215,661.420	
POOL CORP	438	430.960	188,760.480	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,567	192.210	685,613.070	
VMWARE INC-CLASS A	892	160.570	143,228.440	
CABLE ONE INC	60	1,810.070	108,604.200	
BURLINGTON STORES INC	766	309.880	237,368.080	
NASDAQ INC	1,427	175.160	249,953.320	
VAIL RESORTS INC	553	322.790	178,502.870	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	894	123.150	110,096.100	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	123.790	108,192.460	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,780	77.750	293,895.000	
COGNEX CORP	2,439	80.140	195,461.460	
TELEFLEX INC	563	395.700	222,779.100	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	979	164.610	161,153.190	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	852	345.140	294,059.280	
BIO-RAD LABORATORIES-A	300	606.670	182,001.000	
CATALENT INC	2,000	109.580	219,160.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,757	303.900	533,952.300	
MOLINA HEALTHCARE INC	800	243.610	194,888.000	
IDEX CORP	1,156	220.830	255,279.480	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,715	83.410	810,328.150	
ROLLINS INC	2,685	33.640	90,323.400	
AMETEK INC	2,597	136.180	353,659.460	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,047	84.540	257,593.380	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,644	46.440	76,347.360	
HEICO CORP	535	143.520	76,783.200	
XPO LOGISTICS INC	1,060	148.450	157,357.000	
GENERAC HOLDINGS INC	716	355.090	254,244.440	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	480	328.000	157,440.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,422	108.520	371,355.440	
TYLER TECHNOLOGIES INC	509	437.050	222,458.450	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,263	383.760	2,019,728.880	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	113.290	127,791.120	
EPAM SYSTEMS INC	749	508.210	380,649.290	
RPM INTERNATIONAL INC	1,750	90.960	159,180.000	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	353	1,391.330	491,139.490	
UGI CORP	2,085	47.050	98,099.250	
CUMMINS INC	1,763	248.440	437,999.720	
ACTIVISION BLIZZARD INC	9,322	99.180	924,555.960	
CDW CORP/DE	1,792	169.300	303,385.600	
COSTAR GROUP INC	492	879.770	432,846.840	
SVB FINANCIAL GROUP	690	545.740	376,560.600	
AMERCO	70	540.870	37,860.900	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,239	250.130	309,911.070	
MERCADOLIBRE INC	556	1,432.630	796,542.280	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	163.330	136,707.210	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,801	128.610	488,846.610	
IPG PHOTONICS CORP	250	206.850	51,712.500	
DEXCOM INC	1,188	409.090	485,998.920	
NORDSON CORP	750	221.290	165,967.500	
COPART INC	2,495	125.680	313,571.600	
SEAGEN INC	1,545	156.290	241,468.050	
ALIGN TECHNOLOGY INC	963	605.770	583,356.510	
TRANSDIGM GROUP INC	698	668.910	466,899.180	
BIO-TECHNE CORP	507	449.370	227,830.590	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,203	99.620	119,842.860	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,457	92.560	227,419.920	
KINDER MORGAN INC	27,851	18.840	524,712.840	
HCA HEALTHCARE INC	3,261	207.860	677,831.460	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	454.710	190,978.200	
T-MOBILE US INC	6,753	145.260	980,940.780	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	113.580	202,853.880	
COCA-COLA CO/THE	49,697	55.550	2,760,668.350	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	61.750	159,006.250	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,946	124.850	242,958.100	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	33.920	130,625.920	
CSX CORP	9,451	97.290	919,487.790	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,166	259.830	302,961.780	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	169.140	264,365.820	
AUTOLIV INC	800	103.850	83,080.000	
AMAZON.COM INC	5,132	3,383.870	17,366,020.840	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,371	100.960	744,176.160	
EXXON MOBIL CORP	51,519	62.070	3,197,784.330	
AES CORP	8,341	25.740	214,697.340	
EVEREST RE GROUP LTD	571	254.030	145,051.130	
EOG RESOURCES INC	7,655	84.860	649,603.300	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	1,914	118.000	225,852.000	
ABIOMED INC	555	302.870	168,092.850	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,989	118.730	236,153.970	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,683	144.390	531,788.370	
FORD MOTOR CO	47,597	14.870	707,767.390	
NOVAVAX INC	975	207.710	202,517.250	
DISCOVERY INC - A	1,521	30.820	46,877.220	
EXACT SCIENCES CORP	2,219	125.010	277,397.190	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	27.760	67,068.160	
LIBERTY BROADBAND-A	595	159.030	94,622.850	
DISCOVERY INC-C	4,554	28.840	131,337.360	
FORTINET INC	1,595	231.460	369,178.700	
MARKEL CORP	177	1,203.870	213,084.990	
NEXTERA ENERGY INC	23,309	73.310	1,708,782.790	
MASIMO CORP	693	225.430	156,222.990	
FREEMPORT-MCMORAN INC	16,881	39.480	666,461.880	
INSULET CORP	769	283.950	218,357.550	
US BANCORP	16,313	58.160	948,764.080	
UNITED RENTALS INC	766	302.980	232,082.680	
F5 NETWORKS INC	659	191.730	126,350.070	
FASTENAL CO	6,716	52.730	354,134.680	
FISERV INC	6,833	109.110	745,548.630	
GENERAL ELECTRIC CO	105,048	13.470	1,414,996.560	
GENERAL MOTORS CO	15,498	60.790	942,123.420	
ZENDESK INC	1,305	141.020	184,031.100	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,875	190.840	548,665.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,884	372.920	1,448,421.280	
ALPHABET INC-CL A	3,600	2,448.910	8,816,076.000	
ALPHABET INC-CL C	3,538	2,527.040	8,940,667.520	
OWENS CORNING	1,763	96.810	170,676.030	
GENERAL MILLS INC	7,849	62.650	491,739.850	
FIRSTENERGY CORP	5,840	38.790	226,533.600	
GENUINE PARTS CO	1,770	127.610	225,869.700	
IHS MARKIT LTD	4,417	109.850	485,207.450	

FIFTH THIRD BANCORP	8,100	39.540	320,274.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,478	222.180	550,562.040	
HALLIBURTON CO	10,230	23.600	241,428.000	
HOME DEPOT INC	12,956	309.320	4,007,549.920	
ASSURANT INC	840	160.830	135,097.200	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,775	14.370	154,836.750	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	500	219.800	109,900.000	
HERSHEY CO/THE	1,725	174.670	301,305.750	
HUMANA INC	1,569	415.120	651,323.280	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,362	203.570	684,402.340	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	274.800	251,991.600	
HENRY SCHEIN INC	1,870	77.430	144,794.100	
HP INC	17,443	29.390	512,649.770	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,115	15.720	221,887.800	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,395	45.660	63,695.700	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	2,762	45.300	125,118.600	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	45.860	93,004.080	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,011	39.140	196,130.540	
KRAFT HEINZ CO/THE	8,390	42.820	359,259.800	
ENPHASE ENERGY INC	1,558	147.650	230,038.700	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,628	150.030	1,594,518.840	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	62.300	252,128.100	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	97.950	146,925.000	
ZOETIS INC	5,614	184.580	1,036,232.120	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,908	182.610	531,029.880	
CHENIERE ENERGY INC	2,484	88.820	220,628.880	
ALLEGION PLC	1,110	138.310	153,524.100	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	27.830	142,155.640	
WASTE CONNECTIONS INC	3,431	121.660	417,415.460	
JUNIPER NETWORKS INC	4,912	28.510	140,041.120	
JM SMUCKER CO/THE	1,393	136.100	189,587.300	
JOHNSON & JOHNSON	31,705	165.370	5,243,055.850	
PLUG POWER INC	6,251	30.570	191,093.070	
ABBVIE INC	21,490	115.400	2,479,946.000	

HOLOGIC INC	3,042	63.390	192,832.380	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,987	129.520	516,396.240	
KROGER CO	10,013	38.400	384,499.200	
KLA CORP	1,919	325.210	624,077.990	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,982	389.110	1,160,326.020	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	976	270.050	263,568.800	
L BRANDS INC	2,872	65.740	188,805.280	
LOWE'S COS INC	8,972	189.660	1,701,629.520	
ELI LILLY & CO	9,708	226.100	2,194,978.800	
LAM RESEARCH CORP	1,756	650.240	1,141,821.440	
LOEWS CORP	3,591	55.820	200,449.620	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,643	66.260	175,125.180	
MCDONALD'S CORP	9,035	236.980	2,141,114.300	
3M CO	6,902	201.360	1,389,786.720	
FACEBOOK INC-CLASS A	28,909	336.770	9,735,683.930	
S&P GLOBAL INC	2,923	396.370	1,158,589.510	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	767	347.310	266,386.770	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	575	242.870	139,650.250	
PHILLIPS 66	5,107	91.440	466,984.080	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,659	42.220	238,922.980	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,992	89.200	266,886.400	
METLIFE INC	9,065	63.310	573,905.150	
MARVELL TECHNOLOGY INC	8,617	53.800	463,594.600	
ARISTA NETWORKS INC	593	364.900	216,385.700	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,203	62.810	75,560.430	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,232	211.400	471,844.800	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	284	1,351.840	383,922.560	
BAKER HUGHES CO	8,446	24.740	208,954.040	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,460	281.700	411,282.000	
MERCK & CO. INC.	30,658	75.450	2,313,146.100	
DUPONT DE NEMOURS INC	6,657	81.550	542,878.350	
MASCO CORP	3,543	58.850	208,505.550	
M & T BANK CORP	1,371	152.560	209,159.760	
MARSH & MCLENNAN COS	6,453	139.630	901,032.390	
BLACK KNIGHT INC	1,644	74.160	121,919.040	
HEICO CORP-CLASS A	1,018	131.080	133,439.440	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,361	143.900	483,647.900	

WORKDAY INC-CLASS A	2,123	232.280	493,130.440
WAYFAIR INC- CLASS A	880	317.440	279,347.200
SQUARE INC - A	4,724	230.950	1,091,007.800
TRANSUNION	2,293	106.780	244,846.540
VISTRA CORP	4,285	18.390	78,801.150
NOVOCURE LTD	1,054	219.920	231,795.680
NETAPP INC	2,703	82.990	224,321.970
NIKE INC -CL B	15,087	131.360	1,981,828.320
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,993	271.520	812,659.360
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,085	155.760	480,519.600
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,749	129.010	225,638.490
ALLY FINANCIAL INC	5,094	53.410	272,070.540
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,835	372.230	683,042.050
APTIV PLC	3,232	157.470	508,943.040
NEWMONT CORP	9,252	69.830	646,067.160
MCKESSON CORP	1,850	192.910	356,883.500
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,257	104.130	339,151.410
XYLEM INC	1,972	117.270	231,256.440
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,791	100.500	1,888,495.500
NUCOR CORP	3,692	102.710	379,205.320
SUNRUN INC	1,500	46.150	69,225.000
WESTERN UNION CO	4,350	24.750	107,662.500
GODADDY INC - CLASS A	1,930	85.400	164,822.000
NEWELL BRANDS INC	4,058	27.340	110,945.720
EVERGY INC	3,243	63.920	207,292.560
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,238	28.280	289,530.640
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	191.420	51,491.980
OKTA INC	1,634	227.790	372,208.860
COUPA SOFTWARE INC	880	239.110	210,416.800
LIBERTY BROADBAND-C	1,878	162.000	304,236.000
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	33.480	163,281.960
LINDE PLC	6,108	290.910	1,776,878.280
WIX.COM LTD	785	284.930	223,670.050
EQUITABLE HOLDINGS INC	6,184	31.160	192,693.440
KKR & CO INC	6,489	55.290	358,776.810
PAYCHEX INC	3,657	104.490	382,119.930
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	916	532.420	487,696.720
ALTRIA GROUP INC	22,086	48.080	1,061,894.880
P G & E CORP	15,515	10.650	165,234.750



PFIZER INC	67,615	39.630	2,679,582.450	
CIGNA CORP	4,318	239.590	1,034,549.620	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	102.740	336,576.240	
ALTICE USA INC- A	4,147	34.840	144,481.480	
XCEL ENERGY INC	6,528	69.080	450,954.240	
STERIS PLC	897	198.370	177,937.890	
FOX CORP - CLASS B	1,530	35.960	55,018.800	
FOX CORP - CLASS A	5,267	37.680	198,460.560	
STRYKER CORP	4,086	255.690	1,044,749.340	
LYFT INC-A	3,649	58.410	213,138.090	
DOW INC	8,718	66.960	583,757.280	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,508	84.420	127,305.360	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,363	365.910	864,645.330	
PARKER HANNIFIN CORP	1,538	296.910	456,647.580	
UBER TECHNOLOGIES INC	15,186	50.770	770,993.220	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,203	162.130	357,172.390	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	29,651	134.910	4,000,216.410	
EXELON CORP	11,882	47.110	559,761.020	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,652	181.650	481,735.800	
TELADOC HEALTH INC	1,340	157.480	211,023.200	
INGERSOLL-RAND INC	4,175	47.530	198,437.750	
NVR INC	45	4,671.740	210,228.300	
CONOCOPHILLIPS	16,766	60.310	1,011,157.460	
TWILIO INC - A	1,622	343.070	556,459.540	
DOCUSIGN INC	2,252	257.260	579,349.520	
PAYCOM SOFTWARE INC	601	341.020	204,953.020	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	89.130	131,021.100	
PEPSICO INC	16,768	148.570	2,491,221.760	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	139.700	57,137.300	
DROPBOX INC-CLASS A	2,392	29.520	70,611.840	
MONGODB INC	791	346.670	274,215.970	
SNAP INC - A	11,675	63.570	742,179.750	
CORTEVA INC	8,530	43.960	374,978.800	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,355	104.420	454,749.100	
AMCOR PLC	17,457	12.150	212,102.550	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,336	233.530	545,526.080	
ROKU INC	1,292	364.860	471,399.120	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	160.480	335,724.160	
ACCENTURE PLC-CL A	7,608	285.710	2,173,681.680	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,876	44.890	263,773.640	
10X GENOMICS INC-CLASS A	818	191.170	156,377.060	
PENTAIR PLC	1,575	66.900	105,367.500	
QUALCOMM INC	13,614	137.310	1,869,338.340	
INVESCO LTD	3,700	28.770	106,449.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	819	198.590	162,645.210	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	64.240	205,118.320	
DATADOG INC - CLASS A	2,536	97.250	246,626.000	
PINTEREST INC- CLASS A	6,073	68.670	417,032.910	
AVALARA INC	1,257	140.130	176,143.410	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,197	528.750	632,913.750	
REPUBLIC SERVICES INC	2,667	109.640	292,409.880	
BOOKING HOLDINGS INC	501	2,305.040	1,154,825.040	
ROSS STORES INC	4,110	119.220	489,994.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	138.860	138,582.280	
RESMED INC	1,660	231.700	384,622.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,812	128.040	232,008.480	
ROBERT HALF INTL INC	1,499	90.680	135,929.320	
MODERNA INC	3,291	207.410	682,586.310	
HUBSPOT INC	564	537.260	303,014.640	
PERKINELMER INC	1,163	147.150	171,135.450	
CARRIER GLOBAL CORP	9,733	46.210	449,761.930	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,866	80.800	393,172.800	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,300	57.510	132,273.000	
AVANTOR INC	5,600	33.340	186,704.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	1,476	43.530	64,250.280	
DYNATRACE INC	2,339	56.160	131,358.240	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	540	601.560	324,842.400	
REGIONS FINANCIAL CORP	10,825	21.180	229,273.500	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,476	44.620	65,859.120	
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	153.590	156,815.390	
MATCH GROUP INC	3,162	143.860	454,885.320	

CHEVRON CORP	23,468	107.970	2,533,839.960	
PELTON INTERACTIVE INC-A	3,174	112.090	355,773.660	
ZSCALER INC	734	211.430	155,189.620	
EDISON INTERNATIONAL	4,985	58.680	292,519.800	
ETSY INC	1,662	170.300	283,038.600	
TESLA INC	9,117	617.690	5,631,479.730	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	363	244.200	88,644.600	
NORTONLIFELOCK INC	7,944	28.450	226,006.800	
DRAFTKINGS INC - CL A	2,394	50.620	121,184.280	
UNITY SOFTWARE INC	1,150	102.300	117,645.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,895	202.940	384,571.300	
SYNOPSIS INC	1,776	266.490	473,286.240	
CARVANA CO	700	278.690	195,083.000	
CHEWY INC - CLASS A	856	75.070	64,259.920	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,934	95.640	280,607.760	
PPD INC	1,937	46.530	90,128.610	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,674	690.610	1,156,081.140	
VIATRIS INC	13,745	15.630	214,834.350	
AIRBNB INC-CLASS A	674	149.210	100,567.540	
CBRE GROUP INC - A	3,849	87.700	337,557.300	
TWITTER INC	8,965	60.830	545,340.950	
SOUTHERN CO/THE	12,374	63.790	789,337.460	
SYSCO CORP	6,160	79.400	489,104.000	
TRAVELERS COS INC/THE	2,958	153.250	453,313.500	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	155.020	93,012.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,925	62.350	120,023.750	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	63.130	145,199.000	
SCHLUMBERGER LTD	17,899	34.050	609,460.950	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	59.630	120,810.380	
AT&T INC	86,585	29.090	2,518,757.650	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,758	57.280	100,698.240	
ON SEMICONDUCTOR CORP	4,452	38.320	170,600.640	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,595	106.620	276,678.900	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,057	273.760	836,884.320	
SEMPRA ENERGY	3,450	143.250	494,212.500	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	63.430	143,605.520	
CLARIVATE PLC	4,721	26.320	124,256.720	

OAK STREET HEALTH INC	1,654	57.200	94,608.800	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	7,216	25.000	180,400.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,606	94.660	246,683.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,039	190.260	2,100,280.140	
SALESFORCE.COM INC	10,960	246.260	2,699,009.600	
WESTROCK CO	2,618	55.270	144,696.860	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,322	66.160	550,583.520	
TERADYNE INC	2,096	131.480	275,582.080	
UNION PACIFIC CORP	8,074	222.620	1,797,433.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	8,128	62.990	511,982.720	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	18,223	88.720	1,616,744.560	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,773	201.090	1,764,162.570	
IQVIA HOLDINGS INC	2,435	244.470	595,284.450	
VOYA FINANCIAL INC	1,800	63.470	114,246.000	
AMEREN CORPORATION	2,861	85.840	245,588.240	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,354	399.160	4,532,062.640	
VERISIGN INC	1,365	220.170	300,532.050	
VALERO ENERGY CORP	4,584	81.950	375,658.800	
ULTA BEAUTY INC	635	336.790	213,861.650	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	46.930	141,165.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	992	156.370	155,119.040	
ANTHEM INC	2,998	383.510	1,149,762.980	
WALT DISNEY CO/THE	21,890	178.180	3,900,360.200	
WELLS FARGO & CO	46,832	45.150	2,114,464.800	
WASTE MANAGEMENT INC	5,034	140.250	706,018.500	
WILLIAMS COS INC	14,542	27.520	400,195.840	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,591	183.150	291,391.650	
WHIRLPOOL CORP	870	221.100	192,357.000	
WALMART INC	18,950	140.560	2,663,612.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,492	157.550	392,614.600	
WYNN RESORTS LTD	1,145	124.950	143,067.750	
WABTEC CORP	1,898	80.630	153,035.740	
TJX COMPANIES INC	14,079	65.130	916,965.270	
WATERS CORP	760	336.180	255,496.800	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	555	509.920	283,005.600	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,695	54.430	473,268.850	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,452	256.120	371,886.240	
WESTERN DIGITAL CORP	3,531	74.710	263,801.010	
WEC ENERGY GROUP INC	4,189	92.690	388,278.410	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,855	61.840	362,073.200	
VISA INC-CLASS A SHARES	20,328	234.080	4,758,378.240	
PPL CORP	10,194	29.260	298,276.440	
PULTEGROUP INC	3,556	53.530	190,352.680	
PPG INDUSTRIES INC	2,834	175.380	497,026.920	
NORTHERN TRUST CORP	2,260	116.470	263,222.200	
NVIDIA CORP	7,438	720.750	5,360,938.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,160	187.110	965,487.600	
TYSON FOODS INC-CL A	3,322	77.350	256,956.700	
NETFLIX INC	5,369	499.890	2,683,909.410	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,761	470.070	2,238,003.270	
NRG ENERGY INC	3,000	37.080	111,240.000	
GLOBE LIFE INC	1,215	102.970	125,108.550	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,953	186.180	363,609.540	
TEXTRON INC	2,831	67.150	190,101.650	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	26.310	98,636.190	
OMNICOM GROUP	2,546	82.570	210,223.220	
ORACLE CORP	23,185	82.620	1,915,544.700	
MASTERCARD INC - A	10,686	366.520	3,916,632.720	
ONEOK INC	4,566	55.440	253,139.040	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	11,062	14.850	164,270.700	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,269	464.280	589,171.320	
YUM! BRANDS INC	3,601	118.060	425,134.060	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,413	186.750	263,877.750	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,206	59.760	131,830.560	
BANK OF AMERICA CORP	93,607	41.360	3,871,585.520	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	418	424.810	177,570.580	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,649	82.480	136,009.520	
AMERICAN EXPRESS CO	8,172	163.810	1,338,655.320	
ANALOG DEVICES INC	4,429	168.440	746,020.760	
ADVANCED MICRO DEVICES	14,631	81.550	1,193,158.050	

AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	10,084	51.100	515,292.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,940	173.830	337,230.200	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,147	87.950	188,828.650	
AVERY DENNISON CORP	1,131	213.560	241,536.360	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,560	70.790	464,382.400	
EMERSON ELECTRIC CO	7,175	97.380	698,701.500	
AON PLC-CLASS A	2,640	250.060	660,158.400	
AMGEN INC	6,999	241.190	1,688,088.810	
EATON CORP PLC	5,056	146.000	738,176.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,181	236.370	515,522.970	
APPLIED MATERIALS INC	10,742	139.030	1,493,460.260	
CME GROUP INC	4,290	216.700	929,643.000	
ECOLAB INC	3,031	213.240	646,330.440	
EQUIFAX INC	1,441	228.850	329,772.850	
GILEAD SCIENCES INC	14,898	68.150	1,015,298.700	
KEURIG DR PEPPER INC	9,236	34.850	321,874.600	
HORMEL FOODS CORP	3,315	48.910	162,136.650	
STATE STREET CORP	4,152	84.790	352,048.080	
SCHWAB (CHARLES) CORP	17,178	72.010	1,236,987.780	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,568	82.770	543,633.360	
CAMPBELL SOUP CO	2,166	45.820	99,246.120	
CROWN HOLDINGS INC	1,597	100.110	159,875.670	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	58.330	193,597.270	
FEDEX CORP	2,979	292.990	872,817.210	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,487	158.710	870,841.770	
FMC CORP	1,360	118.460	161,105.600	
CERNER CORP	4,133	80.690	333,491.770	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,105	147.770	311,055.850	
CITRIX SYSTEMS INC	1,412	120.660	170,371.920	
INTEL CORP	49,124	58.190	2,858,525.560	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,231	33.630	175,918.530	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,866	64.710	314,878.860	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,768	232.430	875,796.240	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	6.750	103,275.000	
ILLUMINA INC	1,787	452.140	807,974.180	
SEALED AIR CORP	1,450	58.600	84,970.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,390	872.790	1,213,178.100	

CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,330	120.970	160,890.100
SNAP-ON INC	500	235.250	117,625.000
CARMAX INC	1,990	118.100	235,019.000
DUKE ENERGY CORP	8,987	102.530	921,437.110
TARGET CORP	6,000	233.070	1,398,420.000
DOVER CORP	1,713	150.340	257,532.420
WW GRAINGER INC	588	454.800	267,422.400
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,750	138.560	242,480.000
CINTAS CORP	1,162	353.260	410,488.120
CONAGRA BRANDS INC	5,567	37.470	208,595.490
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,500	83.430	125,145.000
CLOROX COMPANY	1,628	174.230	283,646.440
ENTERGY CORP	2,243	108.900	244,262.700
MICROSOFT CORP	85,866	259.890	22,315,714.740
INCYTE CORP	2,689	82.640	222,218.960
CVS HEALTH CORP	16,017	84.620	1,355,358.540
MEDTRONIC PLC	16,242	124.150	2,016,444.300
MICRON TECHNOLOGY INC	13,586	80.490	1,093,537.140
BLACKROCK INC	1,832	876.780	1,606,260.960
CENTERPOINT ENERGY INC	5,636	25.980	146,423.280
HASBRO INC	1,449	95.500	138,379.500
KELLOGG CO	3,690	65.390	241,289.100
KEYCORP	11,782	21.530	253,666.460
KANSAS CITY SOUTHERN	1,176	292.360	343,815.360
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	17,319	63.790	1,104,779.010
COOPER COS INC/THE	647	376.540	243,621.380
CHUBB LTD	5,452	166.460	907,539.920
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	119.400	119,400.000
ALLSTATE CORP	3,477	130.980	455,417.460
EBAY INC	8,308	65.890	547,414.120
PAYPAL HOLDINGS INC	13,365	274.930	3,674,439.450
EASTMAN CHEMICAL CO	1,492	122.100	182,173.200
XILINX INC	2,892	128.330	371,130.360
DISH NETWORK CORP-A	2,984	40.030	119,449.520
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,783	303.220	843,861.260
TRIMBLE INC	2,938	78.790	231,485.020
LENNAR CORP-A	3,394	92.040	312,383.760

	LEAR CORP	600	187.380	112,428.000	
	PROGRESSIVE CORP	7,391	93.120	688,249.920	
	PACCAR INC	4,170	91.070	379,761.900	
	BIOGEN INC	1,948	406.140	791,160.720	
	IDEXX LABORATORIES INC	1,024	592.360	606,576.640	
	STARBUCKS CORP	14,274	112.450	1,605,111.300	
	PTC INC	1,200	137.660	165,192.000	
	EVERSOURCE ENERGY	4,290	82.550	354,139.500	
	INTUIT INC	3,148	476.970	1,501,501.560	
	BORGWARNER INC	3,081	51.970	160,119.570	
	BEST BUY CO INC	2,987	114.030	340,607.610	
	BALL CORP	3,860	81.120	313,123.200	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,855	42.540	717,011.700	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,677	148.550	546,218.350	
	VULCAN MATERIALS CO	1,606	171.730	275,798.380	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,207	194.800	624,723.600	
	VF CORP	4,216	81.360	343,013.760	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	7,202	42.630	307,021.260	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	628	188.240	118,214.720	
	CARNIVAL CORP	9,986	28.750	287,097.500	
	COMCAST CORP-CLASS A	54,643	57.280	3,129,951.040	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,600	62.770	100,432.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,100	4.930	113,883.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 451,174,435.330 (49,678,817,074)	
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	3.304	829,571.620	
	UNILEVER PLC	31,630	42.950	1,358,508.500	
	BARCLAYS PLC	203,715	1.794	365,464.710	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	124,705	1.073	133,883.280	
	PRUDENTIAL PLC	31,421	14.850	466,601.850	
	NATWEST GROUP PLC	50,836	2.051	104,264.630	
	EVRAZ PLC	7,441	6.336	47,146.170	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	30.780	54,111.240	
	BAE SYSTEMS PLC	37,796	5.338	201,755.040	
	AVIVA PLC	51,081	4.169	212,956.680	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	35.360	40,310.400	



GLAXOSMITHKLINE PLC	62,903	14.074	885,296.820	
INFORMA PLC	16,200	5.300	85,860.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	64,335	1.665	107,149.940	
AUTO TRADER GROUP PLC	14,499	6.300	91,343.700	
DCC PLC	938	60.800	57,030.400	
OCADO GROUP PLC	6,234	18.935	118,040.790	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	131.950	97,643.000	
HALMA PLC	3,978	27.910	111,025.980	
ENTAIN PLC	8,805	18.115	159,502.570	
JD SPORTS FASHION PLC	6,411	9.122	58,481.140	
M&G PLC	25,964	2.442	63,404.080	
RELX PLC	24,203	19.095	462,156.280	
DIAGEO PLC	27,880	34.345	957,538.600	
RIO TINTO PLC	13,627	60.920	830,156.840	
STANDARD CHARTERED PLC	31,951	4.913	156,975.260	
TESCO PLC	86,791	2.317	201,138.140	
SMITH & NEPHEW PLC	11,297	15.495	175,047.010	
GLENCORE PLC	129,226	3.276	423,408.980	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	16.365	52,368.000	
SMITHS GROUP PLC	4,080	16.020	65,361.600	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	16,879	2.950	49,793.050	
PEARSON PLC	8,271	8.510	70,386.210	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.538	44,747.470	
NEXT PLC	1,685	80.680	135,945.800	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.673	53,930.820	
WHITBREAD PLC	1,785	32.550	58,101.750	
BUNZL PLC	3,159	22.850	72,183.150	
VODAFONE GROUP PLC	308,250	1.300	400,725.000	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,749	71.160	124,458.840	
KINGFISHER PLC	17,229	3.443	59,319.440	
WPP PLC	13,021	10.020	130,470.420	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.270	84,665.880	
SEVERN TRENT PLC	4,300	25.190	108,317.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	22,242	4.901	109,008.040	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,424	65.660	553,119.840	
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	14.480	70,705.840	
SCHRODERS PLC	1,227	35.710	43,816.170	
SSE PLC	12,460	15.795	196,805.700	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	7.312	90,434.810	
ASTRAZENECA PLC	15,659	83.480	1,307,213.320	
FERGUSON PLC	2,724	96.220	262,103.280	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.769	188,934.400	
3I GROUP PLC	13,293	12.415	165,032.590	
ASHTED GROUP PLC	5,921	50.860	301,142.060	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	6.684	77,186.830	
NATIONAL GRID PLC	45,105	9.200	414,966.000	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	865,213	0.478	413,917.890	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,806	16.075	173,706.450	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,963	45.710	89,728.730	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	27,086	27.955	757,189.130	
BHP GROUP PLC	26,934	21.520	579,619.680	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,964	22.920	113,774.880	
HSBC HOLDINGS PLC	244,846	4.394	1,075,975.740	
ANGLO AMERICAN PLC	14,645	31.125	455,825.620	
MONDI PLC	5,921	19.550	115,755.550	
WM MORRISON SUPERMARKETS	39,167	1.767	69,208.080	
COMPASS GROUP PLC	21,992	16.100	354,071.200	
PERSIMMON PLC	2,688	31.050	83,462.400	
BT GROUP PLC	102,757	1.918	197,139.300	
COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	26.360	67,850.640	
BURBERRY GROUP PLC	5,136	22.190	113,967.840	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	792	50.380	39,900.960	
INTERTEK GROUP PLC	1,897	54.200	102,817.400	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,750	77.700	291,375.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	49,526	14.584	722,287.180	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	44,623	13.936	621,866.120	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	24.650	50,261.350	
ADMIRAL GROUP PLC	1,570	31.100	48,827.000	
ANTOFAGASTA PLC	3,460	15.320	53,007.200	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	33,046	2.848	94,115.000	
EXPERIAN PLC	12,119	27.050	327,818.950	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 21,160,486.250 (3,288,127,958)	

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	16.480	197,760.000	
	AZRIELI GROUP LTD	530	241.200	127,836.000	
	ICL GROUP LTD	11,096	23.910	265,305.360	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	423.400	127,020.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	27.150	411,594.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,043	25.800	491,309.400	
	NICE LTD	800	735.500	588,400.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	101.800	191,689.400		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 2,400,914.160 (81,446,210)	
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	3.070	70,069.680	
	BHP GROUP LTD	36,548	48.950	1,789,024.600	
	SOUTH32 LTD	56,387	2.950	166,341.650	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	10,576	23.620	249,805.120	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,554	23.220	477,263.880	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	37,341	26.460	988,042.860	
	WESTPAC BANKING CORP	44,270	26.290	1,163,858.300	
	SANTOS LTD	18,270	7.670	140,130.900	
	AUSNET SERVICES	28,500	1.815	51,727.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	35,190	28.250	994,117.500	
	RIO TINTO LTD	4,169	124.940	520,874.860	
	ORIGIN ENERGY LTD	20,968	4.840	101,485.120	
	AURIZON HOLDINGS LTD	29,047	3.890	112,992.830	
	XERO LTD	1,426	134.080	191,198.080	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	953	31.370	29,895.610	
	COLES GROUP LTD	16,696	16.670	278,322.320	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,509	30.700	77,026.300	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	8,183	11.500	94,104.500	
	EVOLUTION MINING LTD	17,017	5.080	86,446.360	
	AFTERPAY LTD	3,000	103.520	310,560.000	
	REECE LTD	6,358	22.700	144,326.600	
OIL SEARCH LTD	17,345	4.100	71,114.500		
SEEK LTD	2,600	31.460	81,796.000		
TREASURY WINE ESTATES LTD	10,173	11.920	121,262.160		

	NEWCREST MINING LTD	11,981	28.330	339,421.730	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	21,856	101.360	2,215,324.160	
	AMPOL LTD	2,000	29.340	58,680.000	
	ORICA LTD	5,845	14.310	83,641.950	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	11.320	173,739.360	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	13,906	42.910	596,706.460	
	TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	5.010	86,933.520	
	CROWN RESORTS LTD	3,000	12.220	36,660.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	4.710	30,016.830	
	TELSTRA CORP LTD	35,114	3.580	125,708.120	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,733	44.540	299,887.820	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,277	151.560	648,222.120	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,163	40.700	250,834.100	
	CSL LTD	5,550	296.640	1,646,352.000	
	WESFARMERS LTD	13,798	55.000	758,890.000	
	COCHLEAR LTD	805	235.320	189,432.600	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,092	22.820	161,839.440	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	11.220	162,734.880	
	ASX LTD	2,260	74.020	167,285.200	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	16.060	97,227.240	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	5.220	141,446.340	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	35.600	185,938.800	
	AGL ENERGY LTD	8,466	9.320	78,903.120	
	BRAMBLES LTD	18,337	11.250	206,291.250	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	63.620	131,311.680	
	REA GROUP LTD	608	166.700	101,353.600	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,551	50.120	77,736.120	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,288	115.300	148,506.400	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 17,512,812.070 (1,487,012,872)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	40.990	94,277.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	250	1,809.400	452,350.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,721	82.600	307,354.600	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,300	58.050	365,715.000	

INTACT FINANCIAL CORP	1,700	167.670	285,039.000	
BCE INC	900	60.770	54,693.000	
FRANCO-NEVADA CORP	2,200	184.780	406,516.000	
SUNCOR ENERGY INC	17,348	30.630	531,369.240	
METRO INC/CN	3,000	58.450	175,350.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,941	91.210	359,458.610	
BANK OF NOVA SCOTIA	15,075	80.840	1,218,663.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,700	144.380	822,966.000	
TORONTO-DOMINION BANK	21,820	86.930	1,896,812.600	
GREAT-WEST LIFE CO INC	3,900	36.280	141,492.000	
ROYAL BANK OF CANADA	17,210	126.410	2,175,516.100	
TC ENERGY CORP	11,304	64.160	725,264.640	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,375	40.460	257,932.500	
BARRICK GOLD CORP	21,848	28.110	614,147.280	
CAE INC	2,300	38.470	88,481.000	
THOMSON REUTERS CORP	2,284	119.530	273,006.520	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	42.090	75,762.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,034	85.680	88,593.120	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	3,206	21.660	69,441.960	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	68.790	107,312.400	
HYDRO ONE LTD	4,800	30.810	147,888.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,489	75.990	189,139.110	
WSP GLOBAL INC	1,200	140.790	168,948.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	107.510	104,714.740	
PARKLAND CORP	2,800	39.950	111,860.000	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	32.380	74,474.000	
EMERA INC	2,731	57.420	156,814.020	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	35.940	35,940.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,306	62.560	269,383.360	
IVANHOE MINES LTD-CL A	14,261	8.770	125,068.970	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,900	86.150	249,835.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	7,000	19.660	137,620.000	
B2GOLD CORP	16,400	5.950	97,580.000	
AIR CANADA	1,700	28.340	48,178.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	9.420	139,010.940	
BANK OF MONTREAL	8,200	126.500	1,037,300.000	
POWER CORP OF CANADA	6,300	39.500	248,850.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,295	1,585.830	2,053,649.850	
NUTRIEN LTD	6,906	77.410	534,593.460	

CANOPY GROWTH CORP	2,000	30.460	60,920.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,193	52.200	166,674.600	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	52.000	79,664.000	
CAMECO CORP	2,800	23.410	65,548.000	
FIRSTSERVICE CORP	422	208.470	87,974.340	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,405	40.200	96,681.000	
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	1,560	92.260	143,925.600	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,000	85.830	85,830.000	
TELUS CORP	600	27.640	16,584.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	27.990	123,156.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	743	202.730	150,628.390	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	15,200	45.530	692,056.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	555.760	166,728.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,100	117.230	363,413.000	
WESTON (GEORGE) LTD	901	119.090	107,300.090	
PAN AMERICAN SILVER CORP	1,218	38.180	46,503.240	
BLACKBERRY LTD	6,400	17.070	109,248.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,266	63.520	461,536.320	
ENBRIDGE INC	24,132	49.430	1,192,844.760	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,913	60.210	958,121.730	
MANULIFE FINANCIAL CORP	22,184	24.590	545,504.560	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,300	38.260	164,518.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,045	97.900	787,605.500	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	68.260	75,086.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,800	43.020	120,456.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,793	134.770	1,185,032.610	
CGI INC - CLASS A	2,800	110.500	309,400.000	
ONEX CORPORATION	1,600	85.660	137,056.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,800	36.130	245,684.000	
IGM FINANCIAL INC	300	44.690	13,407.000	
TMX GROUP LTD	794	131.340	104,283.960	
OPEN TEXT CORP	3,210	60.600	194,526.000	
SAPUTO INC	2,900	36.700	106,430.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	28.050	176,715.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	10,013	45.290	453,488.770	
YAMANA GOLD INC	11,900	6.150	73,185.000	

	FORTIS INC	6,200	56.670	351,354.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	72.310	97,980.050	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	12.750	84,150.000	
	CENOVUS ENERGY INC	14,100	12.170	171,597.000	
	DOLLARAMA INC	3,529	55.420	195,577.180	
	ATCO LTD -CLASS I	800	45.620	36,496.000	
	ALTAGAS LTD	4,700	25.230	118,581.000	
	KEYERA CORP	2,200	34.790	76,538.000	
	INTER PIPELINE LTD	4,800	20.150	96,720.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 28,615,069.720 (2,594,814,522)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	12,900	25.980	335,142.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	23,300	29.660	691,078.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,750	5.130	91,057.500	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	5.180	89,614.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	7.390	22,170.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	7.580	39,416.000	
	CAPITALAND LTD	33,400	3.760	125,584.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	44,700	12.230	546,681.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.885	39,825.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	19.000	60,800.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	128,400	2.330	299,172.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.890	54,849.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	16,800	10.710	179,928.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	4.770	75,366.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 2,650,682.500 (219,980,141)	
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	14.615	621,926.710	
	ROCHE HOLDING AG-BR	280	365.800	102,424.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	130	865.500	112,515.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	64.380	112,922.520	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	8,619	341.700	2,945,112.300	

SIKA AG-REG	1,690	293.800	496,522.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	92,900.000	92,900.000	
ABB LTD-REG	22,139	31.030	686,973.170	
SWISS RE AG	3,666	84.800	310,876.800	
NESTLE SA-REG	34,247	113.820	3,897,993.540	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	234	1,395.000	326,430.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	202	266.500	53,833.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,122	9.574	288,388.020	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	61.520	165,119.680	
SGS SA-REG	65	2,817.000	183,105.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	259.000	120,953.000	
VIFOR PHARMA AG	665	137.550	91,470.750	
TEMENOS AG - REG	793	150.550	119,386.150	
ALCON INC	5,853	63.840	373,655.520	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	500	322.500	161,250.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,792	371.500	665,728.000	
BALOISE HOLDING AG - REG	611	147.300	90,000.300	
CLARIANT AG-REG	1,568	19.335	30,317.280	
NOVARTIS AG-REG	25,866	83.840	2,168,605.440	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	56	2,106.000	117,936.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,087	115.100	700,613.700	
SWISSCOM AG-REG	276	525.000	144,900.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	784	82.900	64,993.600	
GEBERIT AG-REG	456	669.600	305,337.600	
GIVAUDAN-REG	113	4,230.000	477,990.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	1,403.500	155,788.500	
SONOVA HOLDING AG-REG	672	326.400	219,340.800	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,165	115.900	250,923.500	
LONZA GROUP AG-REG	913	664.600	606,779.800	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	62.500	28,125.000	
HOLCIM LTD	6,587	56.560	372,560.720	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	381	457.300	174,231.300	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	318.800	204,032.000	
SWISS PRIME SITE-REG	946	93.800	88,734.800	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	17	8,750.000	148,750.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 18,279,445.500	



				(2,237,952,512)	
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	406.700	527,489.900	
	ERICSSON LM-B SHS	38,464	109.420	4,208,730.880	
	VOLVO AB-B SHS	18,873	225.800	4,261,523.400	
	SKF AB-B SHARES	4,000	219.300	877,200.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	236.300	614,380.000	
	SWEDISH MATCH AB	21,880	78.100	1,708,828.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	116.450	818,177.700	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	21,779	108.850	2,370,644.150	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	15,482	94.520	1,463,358.640	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	154.560	1,672,493.760	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	10,352	209.800	2,171,849.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	8,201	139.550	1,144,449.550	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	244.400	906,479.600	
	SANDVIK AB	14,657	221.100	3,240,662.700	
	INVESTOR AB-B SHS	21,928	195.800	4,293,502.400	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	8,575	514.200	4,409,265.000	
	VOLVO AB-A SHS	3,923	232.800	913,274.400	
	SECURITAS AB-B SHS	2,500	133.100	332,750.000	
	TELIA CO AB	36,421	36.755	1,338,653.850	
	ALFA LAVAL AB	4,840	299.000	1,447,160.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,813	439.400	2,114,832.200	
	ASSA ABLOY AB-B	11,135	261.500	2,911,802.500	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,400	341.200	477,680.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	671	580.400	389,448.400	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	553.000	524,244.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	924	278.400	257,241.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,716	89.640	1,498,422.240	
	LUNDIN ENERGY AB	1,900	307.900	585,010.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,260	291.100	2,113,386.000	
	EMBRACER GROUP AB	3,545	243.200	862,144.000	
	BOLIDEN AB	3,171	346.500	1,098,751.500	
	EPIROC AB-A	8,660	180.050	1,559,233.000	
	EPIROC AB-B	4,015	159.600	640,794.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	117.300	633,420.000	
	NORDEA BANK ABP	37,392	94.420	3,530,552.640	

	EQT AB	1,960	323.100	633,276.000	
	EVOLUTION AB	2,064	1,590.000	3,281,760.000	
	SINCH AB	640	1,497.000	958,080.000	
	KINNEVIK AB - B	3,641	324.100	1,180,048.100	
	HEXAGON AB-B SHS	27,076	123.500	3,343,886.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	324.100	421,330.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 67,736,215.710 (895,472,773)	
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	516.300	11,019,907.200	
	DANSKE BANK A/S	7,236	115.450	835,396.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	17,610.000	686,790.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,785	224.300	2,867,675.500	
	GN STORE NORD A/S	1,159	521.200	604,070.800	
	CARLSBERG AS-B	1,232	1,138.000	1,402,016.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,981	453.300	1,351,287.300	
	COLOPLAST-B	1,519	989.200	1,502,594.800	
	DSV PANALPINA A/S	2,798	1,446.500	4,047,307.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	143	2,995.000	428,285.000	
	DEMANT A/S	1,314	343.800	451,753.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	18,340.000	1,210,440.000	
	PANDORA A/S	1,637	847.200	1,386,866.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	562.600	710,001.200	
	GENMAB A/S	919	2,703.000	2,484,057.000	
	ORSTED A/S	2,246	868.200	1,949,977.200	
	AMBU A/S-B	2,091	234.900	491,175.900	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 33,429,600.700 (600,061,333)	
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	5.340	80,100.000	
	MERCURY NZ LTD	3,294	6.430	21,180.420	
	A2 MILK CO LTD	7,000	6.290	44,030.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	4.800	80,928.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.430	98,737.270	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	9,200	29.130	267,996.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	13.050	57,667.950	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 650,639.640 (51,166,301)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	13,050	54.320	708,876.000	
	DNB ASA	12,838	189.000	2,426,382.000	
	ORKLA ASA	7,483	87.960	658,204.680	
	TELENOR ASA	8,746	144.050	1,259,861.300	
	EQUINOR ASA	14,248	192.160	2,737,895.680	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,756	471.100	1,298,351.600	
	MOWI ASA	4,677	229.500	1,073,371.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	190.450	380,900.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	349.800	594,660.000	
	ADEVINTA ASA	4,582	162.000	742,284.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 11,880,786.760 (157,064,001)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	11,583	53.210	616,331.430	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	28.320	50,976.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	25,558	11.568	295,654.940	
	COMMERZBANK AG	9,689	6.430	62,300.270	
	VOLKSWAGEN AG	420	296.800	124,656.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	2,272	230.100	522,787.200	
	SIEMENS AG-REG	9,095	135.740	1,234,555.300	
	E.ON SE	30,006	10.168	305,101.000	
	UNIPER SE	2,066	30.690	63,405.540	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,729	94.790	353,471.910	
	GEA GROUP AG	1,300	34.000	44,200.000	
	CONTINENTAL AG	1,474	128.720	189,733.280	
	BASF SE	11,283	67.240	758,668.920	
	ALLIANZ SE-REG	5,014	216.650	1,086,283.100	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,141	92.880	198,856.080	
	RWE AG	7,526	31.090	233,983.340	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	10.680	18,156.000	

BRENNTAG SE	2,121	76.140	161,492.940	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	45.160	218,348.600	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	34.560	33,143.040	
SAP SE	12,283	119.920	1,472,977.360	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,704	233.900	398,565.600	
ZALANDO SE	2,025	95.460	193,306.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,128	74.680	158,919.040	
KION GROUP AG	600	89.780	53,868.000	
COVESTRO AG	1,945	53.620	104,290.900	
RATIONAL AG	74	705.400	52,199.600	
SARTORIUS AG-VORZUG	388	414.600	160,864.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,102	97.200	204,314.400	
DELIVERY HERO SE	1,503	111.150	167,058.450	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	154.150	86,324.000	
BECHTLE AG	273	156.200	42,642.600	
NEMETSCHKE SE	1,139	61.900	70,504.100	
SCOUT24 AG	1,460	67.000	97,820.000	
AROUNDTOWN SA	16,064	7.074	113,636.730	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	2,894	48.720	140,995.680	
KNORR-BREMSE AG	549	102.650	56,354.850	
HELLOFRESH SE	1,814	83.780	151,976.920	
TEAMVIEWER AG	1,461	32.390	47,321.790	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	25.430	120,334.760	
BEIERSDORF AG	1,275	100.300	127,882.500	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	700	42.900	30,030.000	
MERCK KGAA	1,692	154.150	260,821.800	
ADIDAS AG	2,188	293.000	641,084.000	
PUMA SE	1,295	93.260	120,771.700	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	80.300	105,273.300	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,860	17.788	655,665.680	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,561	68.980	176,657.780	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,926	78.920	783,359.920	
QIAGEN N.V.	2,521	39.230	98,898.830	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,497	34.215	564,444.850	
HANNOVER RUECK SE	644	142.600	91,834.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	11,348	56.900	645,701.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,404	137.500	330,550.000	

LANXESS AG	1,529	60.700	92,810.300	
MTU AERO ENGINES AG	666	208.000	138,528.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,796	51.760	248,240.960	
SYMRISE AG	1,656	112.400	186,134.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.266	14,139.840	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	900	79.650	71,685.000	
VONOVIA SE	6,249	53.640	335,196.360	
LEG IMMOBILIEN SE	1,073	120.750	129,564.750	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	11,420	44.450	507,619.000	
NN GROUP NV	3,100	40.540	125,674.000	
ARCELORMITTAL	8,031	26.925	216,234.670	
HEINEKEN NV	3,123	98.220	306,741.060	
AEGON NV	17,967	3.745	67,286.410	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	13,893	24.795	344,476.930	
AKZO NOBEL N.V.	2,504	106.450	266,550.800	
KONINKLIJKE DSM NV	2,230	151.900	338,737.000	
WOLTERS KLUWER	3,300	80.960	267,168.000	
ING GROEP NV	45,601	11.210	511,187.210	
KONINKLIJKE KPN NV	37,607	2.676	100,636.330	
ASML HOLDING NV	4,851	577.700	2,802,422.700	
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	10.718	43,193.540	
ADYEN NV	215	1,931.600	415,294.000	
JUST EAT TAKEAWAY	1,400	73.890	103,446.000	
PROSUS NV	5,999	85.290	511,654.710	
INPOST SA	5,791	15.312	88,671.790	
ASM INTERNATIONAL NV	602	271.400	163,382.800	
VOPAK	630	39.850	25,105.500	
RANDSTAD NV	2,020	64.600	130,492.000	
HEINEKEN HOLDING NV	1,285	83.450	107,233.250	
TOTALENERGIES SE	29,962	40.885	1,224,996.370	
MICHELIN (CGDE)	2,146	129.100	277,048.600	
AIR LIQUIDE SA	5,529	140.860	778,814.940	
KERING	888	744.000	660,672.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,338	130.100	824,573.800	
BOUYGUES SA	2,721	33.490	91,126.290	
BNP PARIBAS	13,400	56.450	756,430.000	

NATIXIS	7,674	4.002	30,711.340	
THALES SA	1,404	86.100	120,884.400	
DANONE	7,551	59.480	449,133.480	
CARREFOUR SA	8,022	17.195	137,938.290	
SUEZ	2,950	20.070	59,206.500	
VIVENDI	8,930	29.190	260,666.700	
L'OREAL	2,956	384.550	1,136,729.800	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,975	56.740	395,761.500	
LEGRAND SA	3,459	88.000	304,392.000	
PERNOD RICARD SA	2,744	177.350	486,648.400	
EURAZEO SE	560	73.600	41,216.000	
SOCIETE GENERALE SA	11,065	26.380	291,894.700	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,296	672.600	2,216,889.600	
ACCOR SA	1,850	34.680	64,158.000	
CAPGEMINI SE	1,981	158.500	313,988.500	
VALEO SA	3,703	28.220	104,498.660	
PUBLICIS GROUPE	2,918	56.480	164,808.640	
BUREAU VERITAS SA	3,227	26.140	84,353.780	
EIFFAGE	945	90.940	85,938.300	
SODEXO SA	1,248	81.240	101,387.520	
IPSEN	276	91.220	25,176.720	
ORPEA	524	108.000	56,592.000	
AMUNDI SA	437	74.950	32,753.150	
TELEPERFORMANCE	701	321.000	225,021.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	59.840	58,463.680	
FAURECIA	1,041	45.500	47,365.500	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	87.130	128,952.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	399	384.600	153,455.400	
SEB SA	216	153.700	33,199.200	
ESSILORLUXOTTICA	3,215	148.500	477,427.500	
DASSAULT AVIATION SA	22	1,024.000	22,528.000	
WORLDLINE SA	3,135	78.970	247,570.950	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	878	49.300	43,285.400	
AXA SA	24,318	22.475	546,547.050	
EDENRED	3,007	50.180	150,891.260	
RENAULT SA	2,554	36.835	94,076.590	
HERMES INTERNATIONAL	365	1,196.000	436,540.000	
STMICROELECTRONICS NV	8,575	31.565	270,669.870	

REMY COINTREAU	253	165.900	41,972.700	
ATOS SE	946	54.420	51,481.320	
DASSAULT SYSTEMES SE	1,633	194.450	317,536.850	
WENDEL	201	116.700	23,456.700	
ORANGE	25,792	10.450	269,526.400	
ALSTOM	2,961	45.460	134,607.060	
CNP ASSURANCES	1,349	14.565	19,648.180	
SANOFI	13,326	88.890	1,184,548.140	
VINCI SA	6,318	96.010	606,591.180	
AIRBUS SE	7,402	112.400	831,984.800	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,351	26.150	192,228.650	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	12.458	181,998.920	
BIOMERIEUX	457	91.880	41,989.160	
ENGIE	21,099	12.308	259,686.490	
EDF	6,760	11.985	81,018.600	
SAFRAN SA	3,931	123.100	483,906.100	
ILIAD SA	219	134.950	29,554.050	
ARKEMA	838	108.400	90,839.200	
ADP	350	126.600	44,310.000	
SCOR SE	1,535	27.980	42,949.300	
GETLINK SE	4,973	13.000	64,649.000	
BOLLORE	7,300	4.388	32,032.400	
UCB SA	1,921	83.440	160,288.240	
KBC GROUP NV	3,011	68.020	204,808.220	
COLRUYT SA	350	51.860	18,151.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	94.280	107,384.920	
SOLVAY SA	873	112.300	98,037.900	
UMICORE	2,270	49.500	112,365.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,926	64.610	576,708.860	
AGEAS	1,654	49.360	81,641.440	
PROXIMUS	2,269	17.370	39,412.530	
ELIA GROUP SA/NV	700	93.500	65,450.000	
SOFINA	239	352.000	84,128.000	
ARGENX SE	516	263.400	135,914.400	
PRYSMIAN SPA	4,145	29.260	121,282.700	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,944	17.150	221,989.600	
MEDIOBANCA SPA	9,971	9.960	99,311.160	
TENARIS SA	4,700	9.744	45,796.800	
UNICREDIT SPA	29,471	10.740	316,518.540	

TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.450	48,826.350	
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.495	23,992.130	
INTESA SANPAOLO	191,098	2.450	468,190.100	
ATLANTIA SPA	6,027	15.735	94,834.840	
POSTE ITALIANE SPA	7,727	12.015	92,839.900	
MONCLER SPA	2,435	57.120	139,087.200	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	47.710	61,307.350	
ENI SPA	28,190	10.728	302,422.320	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	8,500	11.145	94,732.500	
DIASORIN SPA	277	150.750	41,757.750	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	9.654	23,304.750	
NEXI SPA	3,553	17.495	62,159.730	
AMPLIFON SPA	1,750	40.850	71,487.500	
ENEL SPA	98,337	8.102	796,726.370	
SNAM SPA	24,300	5.040	122,472.000	
TERNA SPA	19,900	6.548	130,305.200	
EXOR NV	1,088	69.620	75,746.560	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	14.290	167,064.390	
FINECOBANK SPA	5,972	13.925	83,160.100	
STELLANTIS NV	24,803	16.968	420,857.300	
FERRARI NV	1,722	168.250	289,726.500	
TELEFONICA SA	57,039	4.112	234,544.360	
ENDESA SA	3,760	22.290	83,810.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	83,583	5.343	446,583.960	
IBERDROLA SA	72,039	10.820	779,461.980	
REPSOL SA	17,685	11.472	202,882.320	
GRIFOLS SA	2,795	23.540	65,794.300	
BANCO SANTANDER SA	207,370	3.437	712,834.370	
AMADEUS IT GROUP SA	5,400	65.500	353,700.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,978	21.860	86,959.080	
CAIXABANK SA	46,859	2.804	131,392.630	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,583	25.570	91,617.310	
AENA SME SA	866	143.100	123,924.600	
CELLNEX TELECOM SA	7,160	52.200	373,752.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	12,417	31.790	394,736.430	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	3,293	25.930	85,387.490	



	ENAGAS SA	3,675	19.750	72,581.250	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,147	17.090	87,962.230	
	FERROVIAL SA	6,055	25.340	153,433.700	
	UPM-KYMMENE OYJ	6,525	32.500	212,062.500	
	NOKIA OYJ	65,261	4.529	295,567.060	
	WARTSILA OYJ ABP	4,116	12.180	50,132.880	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,853	15.085	133,547.500	
	ELISA OYJ	1,734	50.520	87,601.680	
	SAMPO OYJ-A SHS	6,809	38.860	264,597.740	
	FORTUM OYJ	4,400	24.280	106,832.000	
	KESKO OYJ-B SHS	2,010	29.940	60,179.400	
	KONE OYJ-B	3,796	67.580	256,533.680	
	NESTE OYJ	5,778	55.400	320,101.200	
	ORION OYJ-CLASS B	1,763	37.930	66,870.590	
	VERBUND AG	1,216	76.450	92,963.200	
	OMV AG	1,209	50.740	61,344.660	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,489	33.710	117,614.190	
	VOESTALPINE AG	1,800	36.240	65,232.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	20.660	22,726.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,055	46.320	141,507.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,600	78.480	125,568.000	
	JERONIMO MARTINS	2,900	15.880	46,052.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	27,576	4.599	126,822.020	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,183	9.876	70,939.300	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,383	19.400	85,030.200	
	KERRY GROUP PLC-A	1,822	106.400	193,860.800	
	CRH PLC	9,200	42.750	393,300.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,785	159.700	285,064.500	
	ユーロ 小計			ユーロ 57,564,362.480 (7,681,964,173)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,500	48.650	1,143,275.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	23,000	62.450	1,436,350.000	
	MTR CORP	16,500	43.400	716,100.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	122.000	2,318,000.000	
	SINO LAND CO	34,000	12.460	423,640.000	

CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	37,552	59.800	2,245,609.600	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8,000	57.750	462,000.000	
CLP HOLDINGS LTD	17,000	78.650	1,337,050.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	38.300	787,639.500	
HONG KONG & CHINA GAS	172,027	12.320	2,119,372.640	
HANG SENG BANK LTD	8,000	159.200	1,273,600.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	17,500	42.200	738,500.000	
WH GROUP LTD	169,500	7.170	1,215,315.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,900	468.200	6,976,180.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	37,000	19.760	731,120.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	8,600	15.600	134,160.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	26,000	30.150	783,900.000	
SJM HOLDINGS LTD	10,000	8.810	88,100.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	23.750	190,000.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	28,552	52.550	1,500,407.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	48.100	264,550.000	
AIA GROUP LTD	150,000	95.600	14,340,000.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	45.200	904,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	26.250	504,000.000	
ESR CAYMAN LTD	18,000	24.350	438,300.000	
SANDS CHINA LTD	29,000	33.950	984,550.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	61,000	15.520	946,720.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	19,000	140.700	2,673,300.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,000	27.700	1,246,500.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	13.140	220,752.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 49,142,991.340 (697,339,047)	
合計			69,671,218,917 [69,671,218,917]	

## (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	アメリカ・ドル 359,658.590	

SIMON PROPERTY GROUP INC	4,233	564,174.240	
BOSTON PROPERTIES INC	1,468	182,076.040	
VORNADO REALTY TRUST	2,128	106,548.960	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,280	409,612.800	
EQUITY RESIDENTIAL	4,406	356,489.460	
EQUINIX INC	1,081	890,733.190	
AMERICAN TOWER CORP	5,297	1,435,169.180	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,701	118,406.670	
INVITATION HOMES INC	6,976	263,762.560	
VICI PROPERTIES INC	5,464	179,328.480	
VENTAS INC	4,401	259,482.960	
WEYERHAEUSER CO	8,683	299,823.990	
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	133,265.170	
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	1,005,502.160	
IRON MOUNTAIN INC	3,474	159,595.560	
VEREIT INC	2,726	133,437.700	
SUN COMMUNITIES INC	1,214	215,606.400	
PROLOGIS INC	8,863	1,118,156.080	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	318,937.440	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	159,118.630	
DUKE REALTY CORP	4,971	246,064.500	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	771	243,173.400	
WELLTOWER INC	4,901	398,010.210	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	227,120.200	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,714	294,105.260	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	149,214.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	145,377.600	
REALTY INCOME CORP	4,587	323,842.200	
PUBLIC STORAGE	1,857	547,127.910	
REGENCY CENTERS CORP	1,939	129,602.760	
UDR INC	2,629	131,765.480	
WP CAREY INC	2,702	210,053.480	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	81,777.560	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	554,356.950	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	287,412.180	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	188,876.090	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 12,826,766.040 (1,412,355,209)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	73,979.870	
	SEGRO PLC	13,286	145,614.560	
	BRITISH LAND CO PLC	14,580	75,057.840	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 294,652.270 (45,786,016)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	4,303	54,863.250	
	TRANSURBAN GROUP	33,406	478,373.920	
	SYDNEY AIRPORT	9,129	55,139.160	
	APA GROUP	14,243	134,596.350	
	SCENTRE GROUP	64,017	185,649.300	
	DEXUS	13,949	149,672.770	
	GPT GROUP	30,647	150,476.770	
	MIRVAC GROUP	61,117	181,517.490	
	STOCKLAND	18,729	89,711.910	
	GOODMAN GROUP	20,198	416,482.760	
	VICINITY CENTRES	50,371	84,371.420	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,980,855.100 (168,194,407)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,600	91,312.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	30,492.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 121,804.000 (11,045,187)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	90,585.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	51,660	111,069.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46,000	92,920.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,600	80,840.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 375,414.000 (31,155,608)	
ユーロ			ユーロ	

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	140,290.120	
	GECINA SA	578	78,434.600	
	KLEPIERRE	2,394	59,754.240	
	COVIVIO	353	28,656.540	
ユーロ 小計			ユーロ 307,135.500 (40,987,232)	
香港・ドル	LINK REIT	26,000	1,998,100.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000	409,760.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000	358,360.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,766,220.000 (39,252,662)	
投資証券 合計			1,748,776,321 [1,748,776,321]	
合計			1,748,776,321 [1,748,776,321]	

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 599銘柄	97.2%	2.8%	71.6%
	投資証券 37銘柄			
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	98.6%	1.4%	4.7%
	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 52銘柄	89.8%	10.2%	2.3%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.6%	0.4%	3.6%
	投資証券 2銘柄			
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	87.6%	12.4%	0.4%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.1%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100%	-%	1.3%
デンマーク・クローネ	株式 17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	10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	231銘柄	99.5%	0.5%	10.8%
	投資証券	4銘柄			
香港・ドル	株式	30銘柄	94.7%	5.3%	1.0%
	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。

**【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,302,446	12,445,572
親投資信託受益証券	223,460,271	10,934,759,474
未収入金	10,000	14,061,000
流動資産合計	232,772,717	10,961,266,046
資産合計	232,772,717	10,961,266,046
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	-	90,954,802
未払解約金	-	13,234,778
未払受託者報酬	453,283	587,291
未払委託者報酬	8,726,564	11,306,243
その他未払費用	113,264	146,742
流動負債合計	9,293,111	116,229,856
負債合計	9,293,111	116,229,856
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 194,514,017	1 6,496,771,590
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	28,965,589	4,348,264,600
(分配準備積立金)	79	1,357,970,775
元本等合計	223,479,606	10,845,036,190
純資産合計	223,479,606	10,845,036,190
負債純資産合計	232,772,717	10,961,266,046



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年6月18日	至 2020年6月15日	自 2020年6月16日	至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		12		1
有価証券売買等損益		1,643,943,625		1,952,298,603
営業収益合計		1,643,943,613		1,952,298,604
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,966		1,522
受託者報酬		771,373		1,135,671
委託者報酬		14,850,477		21,863,492
その他費用		193,241		283,781
営業費用合計		15,817,057		23,284,466
営業利益又は営業損失（ ）		1,659,760,670		1,929,014,138
経常利益又は経常損失（ ）		1,659,760,670		1,929,014,138
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,659,760,670		1,929,014,138
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（ ）		1,642,987,843		473,630,745
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,910,263		28,965,589
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,389,146,835		3,718,735,679
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,389,146,835		3,718,735,679
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,345,318,682		763,865,259
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,345,318,682		763,865,259
分配金		1 -		1 90,954,802
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,965,589		4,348,264,600

## (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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	14,626,454円	194,514,017円
期中追加設定元本額	15,442,007,002円	9,570,631,213円
期中一部解約元本額	15,262,119,439円	3,268,373,640円
2. 計算期間末日における受益権の総数	194,514,017口	6,496,771,590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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(55,295,423円)及び分配準備積立金(79円)より分配対象額は55,295,502円(1万口当たり2,842.75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(93,397,007円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,355,528,534円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,990,293,825円)及び分配準備積立金(36円)より分配対象額は4,439,219,402円(1万口当たり6,832.96円)であり、うち90,954,802円(1万口当たり140円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	18,259,219	1,484,915,875
合計	18,259,219	1,484,915,875

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1489円 (11,489円)	1.6693円 (16,693円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,907,948,694	10,934,759,474	
親投資信託受益証券 合計			10,934,759,474	
合計			10,934,759,474	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	619,339,923	662,159,876
コール・ローン	145,274,253	8,158,697,235
株式	125,564,531,893	201,785,972,970
投資証券	3,486,620,478	5,049,312,781
派生商品評価勘定	7,810,526	391,639,689
未収入金	13,724,812	2,491,192
未収配当金	164,924,746	218,573,259
差入委託証拠金	250,215,025	3,528,706,733
流動資産合計	130,252,441,656	219,797,553,735
資産合計	130,252,441,656	219,797,553,735
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,391,754	3,280,730
未払金	437,400	-
未払解約金	190,283,100	32,017,600
その他未払費用	6,291	-
流動負債合計	207,118,545	35,298,330
負債合計	207,118,545	35,298,330
純資産の部		
元本等		
元本	1 50,896,184,101	58,443,353,703
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	79,149,139,010	161,318,901,702
元本等合計	130,045,323,111	219,762,255,405
純資産合計	130,045,323,111	219,762,255,405
負債純資産合計	130,252,441,656	219,797,553,735

## 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6月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)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	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	44,938,531,796円	50,896,184,101円
期中追加設定元本額	17,213,607,793円	13,926,974,113円
期中一部解約元本額	11,255,955,488円	6,379,804,511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	455,035,857円	378,035,245円
V A		



ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	9,724,653円	4,553,077円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	123,970,830円	78,014,296円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	16,165,872円	9,555,264円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	436,705,325円	269,933,131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)	16,848,205円	27,694,930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)	554,243,792円	506,476,980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)	2,237,678,030円	2,470,931,463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)	643,296,020円	500,461,177円
D-I's 外国株式インデッ クス	8,065,683円	12,196,484円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	5,547,826円	18,951,092円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,611,943,894円	3,126,181,449円
iFree 8資産バランス	977,106,331円	1,044,616,449円
iFree 年金バランス	37,228,086円	129,863,166円
DCダイワ外国株式インデッ クス	32,298,766,795円	35,907,675,092円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	567,653,416円	529,092,010円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	988,544,589円	938,183,739円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	744,909,989円	716,131,197円

大和DC海外株式インデックスファンド	1,548,942,585円	1,633,383,245円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	2,773,012円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	13,532,746円	11,421,297円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,121,165円	8,707,246円
ダイワつみたてインデックス外国株式	331,490,248円	611,470,307円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,497,968円	1,807,454円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,899,391円	2,040,718円
ダイワつみたてインデックスバランス70	2,287,321円	2,696,909円
ダイワ世界バランスファンド40VA	186,973,164円	123,939,186円
ダイワ世界バランスファンド60VA	315,943,780円	229,713,162円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,678,662,952円	1,753,739,188円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	123,631,857円	90,149,674円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	- 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	234,082,341円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	782,872,861円	856,500,290円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	179,126,306円	240,351,471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)	87,456,566円	2,907,948,694円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,757,935,593円	2,741,850,536円
ダイワライフスタイル25	19,967,520円	14,046,221円
ダイワライフスタイル50	65,250,374円	54,532,158円

ダイワライフスタイル75	54,383,499円	44,797,112円
計	50,896,184,101円	58,443,353,703円
2. 期末日における受益権の総数	50,896,184,101口	58,443,353,703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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	5,809,361,573	26,636,268,559
投資証券	436,536,397	828,971,804
合計	6,245,897,970	27,465,240,363

（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6月15日まで、及び2020年12月1日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15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	789,370,269	-	779,890,465	9,479,804	12,525,829,422	-	12,879,379,634	353,550,212
合計	789,370,269	-	779,890,465	9,479,804	12,525,829,422	-	12,879,379,634	353,550,212

## （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6月15日 現在				2021年6月15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	414,623,346	-	413,794,200	829,146	-	-	-	-
アメリカ・ドル	299,613,720	-	300,244,000	630,280	-	-	-	-
イギリス・ポンド	36,810,126	-	36,215,100	595,026	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	10,453,128	-	10,227,000	226,128	-	-	-	-
カナダ・ドル	14,357,700	-	14,157,000	200,700	-	-	-	-
スイス・フラン	19,282,488	-	19,160,700	121,788	-	-	-	-
ユーロ	34,106,184	-	33,790,400	315,784	-	-	-	-
買 建	163,413,570	-	163,483,000	69,430	8,119,494,215	-	8,154,302,962	34,808,747
アメリカ・ドル	139,049,950	-	139,347,000	297,050	5,771,242,030	-	5,806,756,925	35,514,895
イギリス・ポンド	-	-	-	-	320,530,562	-	320,043,042	487,520
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	274,572,279	-	275,060,772	488,493
カナダ・ドル	-	-	-	-	360,916,227	-	360,789,786	126,441
スイス・フラン	-	-	-	-	330,269,958	-	331,884,757	1,614,799
ユーロ	24,363,620	-	24,136,000	227,620	1,061,963,159	-	1,059,767,680	2,195,479
合計	578,036,916	-	577,277,200	898,576	8,119,494,215	-	8,154,302,962	34,808,747

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2,5551円	3,7603円
(1万口当たり純資産額)	(25,551円)	(37,603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	4,050	160.960	651,888.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,430	367.550	1,260,696.500	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,600	148.580	980,628.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,750	87.530	415,767.500	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,150	186.420	400,803.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	20,600	48.640	1,001,984.000	
	ABBOTT LABORATORIES	61,416	110.480	6,785,239.680	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	34.960	462,625.680	

VERISK ANALYTICS INC	5,500	173.270	952,985.000
LAS VEGAS SANDS CORP	12,150	54.150	657,922.500
AMPHENOL CORP-CL A	21,100	68.310	1,441,341.000
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,530	351.790	538,238.700
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	21,562	146.500	3,158,833.000
QORVO INC	3,850	184.940	712,019.000
AFLAC INC	22,550	55.430	1,249,946.500
DARDEN RESTAURANTS INC	4,600	137.500	632,500.000
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,750	86.400	496,800.000
ADOBE INC	16,620	556.950	9,256,509.000
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,650	52.690	403,078.500
LULULEMON ATHLETICA INC	4,360	337.620	1,472,023.200
GARMIN LTD	5,350	142.680	763,338.000
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,750	299.120	2,318,180.000
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	24,150	223.170	5,389,555.500
WR BERKLEY CORP	4,875	75.440	367,770.000
AUTOZONE INC	790	1,385.990	1,094,932.100
DOLLAR TREE INC	8,321	100.200	833,764.200
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	39,550	11.050	437,027.500
PINNACLE WEST CAPITAL	3,800	88.080	334,704.000
CELANESE CORP	3,950	156.470	618,056.500
DR HORTON INC	12,166	87.980	1,070,364.680
DENTSPLY SIRONA INC	7,500	64.670	485,025.000
AUTODESK INC	7,720	280.520	2,165,614.400
MOODY'S CORP	5,820	347.760	2,023,963.200
DEVON ENERGY CORP	22,400	28.980	649,152.000
ALBEMARLE CORP	4,130	168.340	695,244.200
ATMOS ENERGY CORP	4,550	101.100	460,005.000
ALLIANT ENERGY CORP	8,500	58.570	497,845.000
CITIGROUP INC	72,273	75.160	5,432,038.680
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,650	199.170	2,917,840.500
AMERICAN ELECTRIC POWER	17,450	85.130	1,485,518.500
ALLEGHANY CORP	480	698.710	335,380.800
DOMINO'S PIZZA INC	1,370	448.160	613,979.200
HESS CORP	9,800	88.670	868,966.000
DAVITA INC	2,750	121.560	334,290.000

DANAHER CORP	22,200	247.410	5,492,502.000	
FORTIVE CORP	11,300	71.110	803,543.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	19,700	113.840	2,242,648.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	19,650	65.220	1,281,573.000	
BUNGE LTD	4,800	82.620	396,576.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,375	137.100	1,559,512.500	
APPLE INC	584,700	130.480	76,291,656.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,800	120.690	1,303,452.000	
BOEING CO/THE	19,210	245.140	4,709,139.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,365	120.480	646,375.200	
BECTON DICKINSON AND CO	9,939	242.720	2,412,394.080	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	16.750	127,300.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,600	106.700	490,820.000	
NISOURCE INC	13,900	26.030	361,817.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,650	98.710	459,001.500	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	320	1,021.880	327,001.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,421	49.640	1,460,458.440	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	143,504	57.180	8,205,558.720	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	47,550	283.530	13,481,851.500	
ANSYS INC	3,080	338.500	1,042,580.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	46,917	56.690	2,659,724.730	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	24,000	95.610	2,294,640.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,900	67.290	5,241,891.000	
JPMORGAN CHASE & CO	105,870	157.570	16,681,935.900	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,050	192.630	1,550,671.500	
LKQ CORP	10,250	48.690	499,072.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,830	150.030	274,554.900	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,962	75.710	829,933.020	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,850	130.960	1,289,956.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,140	254.620	1,054,126.800	
DOLLAR GENERAL CORP	8,650	209.550	1,812,607.500	
SERVICENOW INC	6,810	509.340	3,468,605.400	
CATERPILLAR INC	18,950	219.010	4,150,239.500	
BROWN & BROWN INC	8,550	52.120	445,626.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,300	48.660	403,878.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,800	355.330	639,594.000	
CMS ENERGY CORP	10,200	60.300	615,060.000	



MOSAIC CO/THE	12,800	33.130	424,064.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	45.900	263,925.000	
CORNING INC	27,100	41.460	1,123,566.000	
CISCO SYSTEMS INC	146,250	54.170	7,922,362.500	
MORGAN STANLEY	49,102	90.720	4,454,533.440	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	116.600	244,860.000	
MSCI INC	2,930	490.760	1,437,926.800	
FAIR ISAAC CORP	1,000	505.600	505,600.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,200	333.610	400,332.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,200	73.990	606,718.000	
BROADCOM INC	14,182	475.830	6,748,221.060	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,150	166.660	691,639.000	
ARAMARK	7,800	37.640	293,592.000	
DTE ENERGY COMPANY	6,820	138.380	943,751.600	
CENTENE CORP	20,487	68.780	1,409,095.860	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,700	114.760	424,612.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,000	47.100	706,500.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,850	144.460	989,551.000	
GARTNER INC	3,150	229.620	723,303.000	
SPLUNK INC	5,710	122.390	698,846.900	
DOMINION ENERGY INC	27,641	78.270	2,163,461.070	
MONSTER BEVERAGE CORP	13,950	93.400	1,302,930.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,650	68.840	320,106.000	
DEERE & CO	10,400	335.540	3,489,616.000	
POOL CORP	1,420	430.960	611,963.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,234	192.210	1,967,077.140	
VMWARE INC-CLASS A	2,830	160.570	454,413.100	
CABLE ONE INC	200	1,810.070	362,014.000	
BURLINGTON STORES INC	2,280	309.880	706,526.400	
NASDAQ INC	3,950	175.160	691,882.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	322.790	438,994.400	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,450	123.150	301,717.500	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	123.790	325,567.700	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,100	77.750	940,775.000	
COGNEX CORP	6,200	80.140	496,868.000	
TELEFLEX INC	1,600	395.700	633,120.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,900	164.610	477,369.000	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,620	345.140	904,266.800	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	606.670	479,269.300	
CATALENT INC	5,950	109.580	652,001.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,850	303.900	1,473,915.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	243.610	487,220.000	
IDEX CORP	2,610	220.830	576,366.300	
COLGATE-PALMOLIVE CO	27,800	83.410	2,318,798.000	
ROLLINS INC	7,387	33.640	248,498.680	
AMETEK INC	8,125	136.180	1,106,462.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,500	84.540	718,590.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,550	46.440	257,742.000	
HEICO CORP	1,400	143.520	200,928.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	148.450	460,195.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,220	355.090	788,299.800	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,310	328.000	429,680.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,450	108.520	1,025,514.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,400	437.050	611,870.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	15,410	383.760	5,913,741.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	113.290	317,212.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,000	508.210	1,016,420.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,600	90.960	418,416.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,000	1,391.330	1,391,330.000	
UGI CORP	7,050	47.050	331,702.500	
CUMMINS INC	5,050	248.440	1,254,622.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	27,100	99.180	2,687,778.000	
CDW CORP/DE	5,100	169.300	863,430.000	
COSTAR GROUP INC	1,410	879.770	1,240,475.700	
SVB FINANCIAL GROUP	1,790	545.740	976,874.600	
AMERCO	340	540.870	183,895.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,500	250.130	875,455.000	
MERCADOLIBRE INC	1,580	1,432.630	2,263,555.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,620	163.330	427,924.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,766	128.610	1,256,005.260	
IPG PHOTONICS CORP	1,300	206.850	268,905.000	
DEXCOM INC	3,420	409.090	1,399,087.800	
NORDSON CORP	1,910	221.290	422,663.900	

COPART INC	7,550	125.680	948,884.000	
SEAGEN INC	4,750	156.290	742,377.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,660	605.770	1,611,348.200	
TRANSDIGM GROUP INC	1,780	668.910	1,190,659.800	
BIO-TECHNE CORP	1,400	449.370	629,118.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,350	99.620	333,727.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,400	92.560	684,944.000	
KINDER MORGAN INC	71,681	18.840	1,350,470.040	
HCA HEALTHCARE INC	9,550	207.860	1,985,063.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,300	454.710	591,123.000	
T-MOBILE US INC	21,877	145.260	3,177,853.020	
ZILLOW GROUP INC - C	5,450	113.580	619,011.000	
COCA-COLA CO/THE	141,900	55.550	7,882,545.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	6,900	61.750	426,075.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,800	124.850	724,130.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	10,350	33.920	351,072.000	
CSX CORP	26,100	97.290	2,539,269.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,460	259.830	899,011.800	
EXPEDIA GROUP INC	4,925	169.140	833,014.500	
AUTOLIV INC	2,950	103.850	306,357.500	
AMAZON.COM INC	14,900	3,383.870	50,419,663.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21,940	100.960	2,215,062.400	
EXXON MOBIL CORP	146,705	62.070	9,105,979.350	
AES CORP	23,500	25.740	604,890.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	254.030	342,940.500	
EOG RESOURCES INC	20,500	84.860	1,739,630.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,750	118.000	678,500.000	
ABIOMED INC	1,610	302.870	487,620.700	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,430	118.730	644,703.900	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,590	144.390	1,529,090.100	
FORD MOTOR CO	137,323	14.870	2,041,993.010	
NOVAVAX INC	2,600	207.710	540,046.000	
DISCOVERY INC - A	5,290	30.820	163,037.800	
EXACT SCIENCES CORP	5,950	125.010	743,809.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	27.760	156,483.120	
LIBERTY BROADBAND-A	850	159.030	135,175.500	
DISCOVERY INC-C	10,389	28.840	299,618.760	

FORTINET INC	4,800	231.460	1,111,008.000	
MARKEL CORP	480	1,203.870	577,857.600	
NEXTERA ENERGY INC	68,180	73.310	4,998,275.800	
MASIMO CORP	1,800	225.430	405,774.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	50,908	39.480	2,009,847.840	
INSULET CORP	2,340	283.950	664,443.000	
US BANCORP	49,850	58.160	2,899,276.000	
UNITED RENTALS INC	2,570	302.980	778,658.600	
F5 NETWORKS INC	2,100	191.730	402,633.000	
FASTENAL CO	20,250	52.730	1,067,782.500	
FISERV INC	21,133	109.110	2,305,821.630	
GENERAL ELECTRIC CO	305,250	13.470	4,111,717.500	
GENERAL MOTORS CO	45,300	60.790	2,753,787.000	
ZENDESK INC	4,150	141.020	585,233.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,550	190.840	1,631,682.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,100	372.920	4,512,332.000	
ALPHABET INC-CL A	10,450	2,448.910	25,591,109.500	
ALPHABET INC-CL C	10,237	2,527.040	25,869,308.480	
OWENS CORNING	3,650	96.810	353,356.500	
GENERAL MILLS INC	21,500	62.650	1,346,975.000	
FIRSTENERGY CORP	18,668	38.790	724,131.720	
GENUINE PARTS CO	5,100	127.610	650,811.000	
IHS MARKIT LTD	13,284	109.850	1,459,247.400	
FIFTH THIRD BANCORP	25,100	39.540	992,454.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,380	222.180	1,639,688.400	
HALLIBURTON CO	31,200	23.600	736,320.000	
HOME DEPOT INC	37,400	309.320	11,568,568.000	
ASSURANT INC	2,050	160.830	329,701.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,900	14.370	515,883.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,410	219.800	309,918.000	
HERSHEY CO/THE	5,190	174.670	906,537.300	
HUMANA INC	4,530	415.120	1,880,493.600	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,600	203.570	1,954,272.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,580	274.800	708,984.000	
HENRY SCHEIN INC	5,100	77.430	394,893.000	
HP INC	47,300	29.390	1,390,147.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	45,700	15.720	718,404.000	

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	45.660	272,955.480	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,000	45.300	317,100.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	45.860	135,287.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,400	39.140	563,616.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	23,603	42.820	1,010,680.460	
ENPHASE ENERGY INC	4,340	147.650	640,801.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	31,050	150.030	4,658,431.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,200	62.300	822,360.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,900	97.950	479,955.000	
ZOETIS INC	16,250	184.580	2,999,425.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,229	182.610	1,502,697.690	
CHENIERE ENERGY INC	8,450	88.820	750,529.000	
ALLEGION PLC	3,100	138.310	428,761.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	27.830	361,038.590	
WASTE CONNECTIONS INC	9,237	121.660	1,123,773.420	
JUNIPER NETWORKS INC	11,300	28.510	322,163.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,870	136.100	526,707.000	
JOHNSON & JOHNSON	91,200	165.370	15,081,744.000	
PLUG POWER INC	17,600	30.570	538,032.000	
ABBVIE INC	61,372	115.400	7,082,328.800	
HOLOGIC INC	9,150	63.390	580,018.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,650	129.520	1,508,908.000	
KROGER CO	26,400	38.400	1,013,760.000	
KLA CORP	5,310	325.210	1,726,865.100	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,830	389.110	3,435,841.300	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	270.050	750,739.000	
L BRANDS INC	8,500	65.740	558,790.000	
LOWE'S COS INC	24,900	189.660	4,722,534.000	
ELI LILLY & CO	29,185	226.100	6,598,728.500	
LAM RESEARCH CORP	4,920	650.240	3,199,180.800	
LOEWS CORP	8,300	55.820	463,306.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	66.260	440,562.740	
MCDONALD'S CORP	25,950	236.980	6,149,631.000	
3M CO	20,170	201.360	4,061,431.200	
FACEBOOK INC-CLASS A	83,600	336.770	28,153,972.000	

S&P GLOBAL INC	8,400	396.370	3,329,508.000
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,210	347.310	767,555.100
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,820	242.870	442,023.400
PHILLIPS 66	15,400	91.440	1,408,176.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	42.220	677,631.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,750	89.200	780,500.000
METLIFE INC	26,150	63.310	1,655,556.500
MARVELL TECHNOLOGY INC	28,300	53.800	1,522,540.000
ARISTA NETWORKS INC	2,020	364.900	737,098.000
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	62.810	301,488.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,958	211.400	1,259,521.200
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	800	1,351.840	1,081,472.000
BAKER HUGHES CO	25,473	24.740	630,202.020
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,010	281.700	1,129,617.000
MERCK & CO. INC.	87,821	75.450	6,626,094.450
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	81.550	1,692,244.050
MASCO CORP	9,100	58.850	535,535.000
M & T BANK CORP	4,439	152.560	677,213.840
MARSH & MCLENNAN COS	17,800	139.630	2,485,414.000
BLACK KNIGHT INC	5,600	74.160	415,296.000
HEICO CORP-CLASS A	2,500	131.080	327,700.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	9,722	143.900	1,398,995.800
WORKDAY INC-CLASS A	6,350	232.280	1,474,978.000
WAYFAIR INC- CLASS A	2,580	317.440	818,995.200
SQUARE INC - A	13,700	230.950	3,164,015.000
TRANSUNION	6,500	106.780	694,070.000
VISTRA CORP	15,650	18.390	287,803.500
NOVOCURE LTD	3,250	219.920	714,740.000
NETAPP INC	7,900	82.990	655,621.000
NIKE INC -CL B	44,100	131.360	5,792,976.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,650	271.520	2,348,648.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9,500	155.760	1,479,720.000
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,400	129.010	567,644.000
ALLY FINANCIAL INC	13,200	53.410	705,012.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,530	372.230	2,058,431.900
APTIV PLC	9,500	157.470	1,495,965.000
NEWMONT CORP	27,461	69.830	1,917,601.630

MCKESSON CORP	5,450	192.910	1,051,359.500	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9,450	104.130	984,028.500	
XYLEM INC	6,370	117.270	747,009.900	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	54,200	100.500	5,447,100.000	
NUCOR CORP	10,650	102.710	1,093,861.500	
SUNRUN INC	6,100	46.150	281,515.000	
WESTERN UNION CO	14,046	24.750	347,638.500	
GODADDY INC - CLASS A	6,000	85.400	512,400.000	
NEWELL BRANDS INC	13,442	27.340	367,504.280	
EVERGY INC	7,750	63.920	495,380.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	32,924	28.280	931,090.720	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	900	191.420	172,278.000	
OKTA INC	4,280	227.790	974,941.200	
COUPA SOFTWARE INC	2,550	239.110	609,730.500	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	162.000	907,200.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,005	33.480	502,367.400	
LINDE PLC	17,846	290.910	5,191,579.860	
WIX.COM LTD	2,030	284.930	578,407.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	31.160	414,428.000	
KKR & CO INC	18,300	55.290	1,011,807.000	
PAYCHEX INC	11,450	104.490	1,196,410.500	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,480	532.420	1,320,401.600	
ALTRIA GROUP INC	64,700	48.080	3,110,776.000	
P G & E CORP	52,300	10.650	556,995.000	
PFIZER INC	193,613	39.630	7,672,883.190	
CIGNA CORP	12,360	239.590	2,961,332.400	
DELL TECHNOLOGIES -C	9,351	102.740	960,721.740	
ALTICE USA INC- A	10,900	34.840	379,756.000	
XCEL ENERGY INC	19,000	69.080	1,312,520.000	
STERIS PLC	3,030	198.370	601,061.100	
SEA LTD-ADR	600	277.070	166,242.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	35.960	195,370.680	
FOX CORP - CLASS A	11,549	37.680	435,166.320	
STRYKER CORP	11,570	255.690	2,958,333.300	
LYFT INC-A	9,200	58.410	537,372.000	
DOW INC	26,068	66.960	1,745,513.280	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,550	84.420	299,691.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,200	365.910	2,634,552.000	

PARKER HANNIFIN CORP	4,540	296.910	1,347,971.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	42,350	50.770	2,150,109.500	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,250	162.130	1,175,442.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	85,467	134.910	11,530,352.970	
EXELON CORP	34,372	47.110	1,619,264.920	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,800	181.650	1,416,870.000	
TELADOC HEALTH INC	4,750	157.480	748,030.000	
INGERSOLL-RAND INC	13,158	47.530	625,399.740	
NVR INC	120	4,671.740	560,608.800	
CONOCOPHILLIPS	46,252	60.310	2,789,458.120	
TWILIO INC - A	5,650	343.070	1,938,345.500	
DOCUSIGN INC	6,600	257.260	1,697,916.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,810	341.020	617,246.200	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	4,750	89.130	423,367.500	
PEPSICO INC	47,900	148.570	7,116,503.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	139.700	209,550.000	
DROPBOX INC-CLASS A	10,500	29.520	309,960.000	
MONGODB INC	1,920	346.670	665,606.400	
SNAP INC - A	33,000	63.570	2,097,810.000	
CORTEVA INC	26,218	43.960	1,152,543.280	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,000	104.420	1,461,880.000	
AMCOR PLC	54,000	12.150	656,100.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,330	233.530	1,478,244.900	
ROKU INC	3,850	364.860	1,404,711.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,400	160.480	1,027,072.000	
ACCENTURE PLC-CL A	22,000	285.710	6,285,620.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	16,700	44.890	749,663.000	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,600	191.170	497,042.000	
PENTAIR PLC	5,925	66.900	396,382.500	
QUALCOMM INC	39,450	137.310	5,416,879.500	
INVESCO LTD	13,000	28.770	374,010.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	198.590	466,686.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,650	64.240	619,916.000	
DATADOG INC - CLASS A	6,200	97.250	602,950.000	
PINTEREST INC- CLASS A	18,800	68.670	1,290,996.000	



AVALARA INC	3,050	140.130	427,396.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,700	528.750	1,956,375.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,900	109.640	866,156.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,400	2,305.040	3,227,056.000	
ROSS STORES INC	12,550	119.220	1,496,211.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,250	138.860	451,295.000	
RESMED INC	5,150	231.700	1,193,255.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	128.040	605,629.200	
ROBERT HALF INTL INC	3,900	90.680	353,652.000	
MODERNA INC	11,150	207.410	2,312,621.500	
HUBSPOT INC	1,500	537.260	805,890.000	
PERKINELMER INC	3,930	147.150	578,299.500	
CARRIER GLOBAL CORP	29,087	46.210	1,344,110.270	
OTIS WORLDWIDE CORP	14,568	80.800	1,177,094.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	57.510	333,558.000	
AVANTOR INC	18,400	33.340	613,456.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,700	43.530	248,121.000	
DYNATRACE INC	6,100	56.160	342,576.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,500	601.560	902,340.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	33,835	21.180	716,625.300	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,900	44.620	263,258.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,680	153.590	411,621.200	
MATCH GROUP INC	9,020	143.860	1,297,617.200	
CHEVRON CORP	66,818	107.970	7,214,339.460	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	8,850	112.090	991,996.500	
ZSCALER INC	2,850	211.430	602,575.500	
EDISON INTERNATIONAL	13,450	58.680	789,246.000	
ETSY INC	4,450	170.300	757,835.000	
TESLA INC	26,670	617.690	16,473,792.300	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,000	244.200	244,200.000	
NORTONLIFELOCK INC	20,550	28.450	584,647.500	
DRAFTKINGS INC - CL A	6,250	50.620	316,375.000	
UNITY SOFTWARE INC	2,100	102.300	214,830.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,672	202.940	1,151,075.680	
SYNOPSIS INC	5,360	266.490	1,428,386.400	
CARVANA CO	2,480	278.690	691,151.200	
CHEWY INC - CLASS A	2,900	75.070	217,703.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	7,950	95.640	760,338.000	

PPD INC	4,400	46.530	204,732.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,785	690.610	3,304,568.850	
VIATRIS INC	43,321	15.630	677,107.230	
AIRBNB INC-CLASS A	2,150	149.210	320,801.500	
CBRE GROUP INC - A	11,800	87.700	1,034,860.000	
TWITTER INC	28,050	60.830	1,706,281.500	
SOUTHERN CO/THE	36,950	63.790	2,357,040.500	
SYSCO CORP	18,000	79.400	1,429,200.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,703	153.250	1,333,734.750	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	155.020	310,040.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	62.350	268,105.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,200	63.130	454,536.000	
SCHLUMBERGER LTD	49,152	34.050	1,673,625.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,400	59.630	322,002.000	
AT&T INC	247,791	29.090	7,208,240.190	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,050	57.280	289,264.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	14,600	38.320	559,472.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,500	106.620	799,650.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8,970	273.760	2,455,627.200	
SEMPRA ENERGY	11,170	143.250	1,600,102.500	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	63.430	412,295.000	
CLARIVATE PLC	12,500	26.320	329,000.000	
OAK STREET HEALTH INC	3,600	57.200	205,920.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,000	25.000	475,000.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	94.660	752,547.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	31,900	190.260	6,069,294.000	
SALESFORCE.COM INC	31,821	246.260	7,836,239.460	
WESTROCK CO	9,330	55.270	515,669.100	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	25,334	66.160	1,676,097.440	
TERADYNE INC	5,700	131.480	749,436.000	
UNION PACIFIC CORP	22,830	222.620	5,082,414.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	22,938	62.990	1,444,864.620	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	52,879	88.720	4,691,424.880	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	25,000	201.090	5,027,250.000	
IQVIA HOLDINGS INC	6,744	244.470	1,648,705.680	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	63.470	276,094.500	

AMEREN CORPORATION	8,900	85.840	763,976.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	32,916	399.160	13,138,750.560	
VERISIGN INC	3,500	220.170	770,595.000	
VALERO ENERGY CORP	14,392	81.950	1,179,424.400	
ULTA BEAUTY INC	1,890	336.790	636,533.100	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	46.930	464,043.840	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,650	156.370	414,380.500	
ANTHEM INC	8,500	383.510	3,259,835.000	
WALT DISNEY CO/THE	62,862	178.180	11,200,751.160	
WELLS FARGO & CO	144,822	45.150	6,538,713.300	
WASTE MANAGEMENT INC	14,850	140.250	2,082,712.500	
WILLIAMS COS INC	42,750	27.520	1,176,480.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,050	183.150	741,757.500	
WHIRLPOOL CORP	2,220	221.100	490,842.000	
WALMART INC	54,450	140.560	7,653,492.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,350	157.550	1,157,992.500	
WYNN RESORTS LTD	3,700	124.950	462,315.000	
WABTEC CORP	6,211	80.630	500,792.930	
TJX COMPANIES INC	41,800	65.130	2,722,434.000	
WATERS CORP	2,230	336.180	749,681.400	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,890	509.920	963,748.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	25,900	54.430	1,409,737.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,543	256.120	1,163,553.160	
WESTERN DIGITAL CORP	10,800	74.710	806,868.000	
WEC ENERGY GROUP INC	11,130	92.690	1,031,639.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	17,850	61.840	1,103,844.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	58,900	234.080	13,787,312.000	
PPL CORP	27,000	29.260	790,020.000	
PULTEGROUP INC	9,450	53.530	505,858.500	
PPG INDUSTRIES INC	8,350	175.380	1,464,423.000	
NORTHERN TRUST CORP	7,000	116.470	815,290.000	
NVIDIA CORP	21,470	720.750	15,474,502.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	14,513	187.110	2,715,527.430	
TYSON FOODS INC-CL A	10,450	77.350	808,307.500	
NETFLIX INC	15,370	499.890	7,683,309.300	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13,670	470.070	6,425,856.900	
NRG ENERGY INC	8,650	37.080	320,742.000	
GLOBE LIFE INC	3,425	102.970	352,672.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,150	186.180	1,145,007.000	
TEXTRON INC	8,000	67.150	537,200.000	
NEWS CORP - CLASS A	13,137	26.310	345,634.470	
OMNICOM GROUP	7,600	82.570	627,532.000	
ORACLE CORP	66,333	82.620	5,480,432.460	
MASTERCARD INC - A	30,750	366.520	11,270,490.000	
ONEOK INC	15,700	55.440	870,408.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	32,952	14.850	489,337.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,620	464.280	1,680,693.600	
YUM! BRANDS INC	10,350	118.060	1,221,921.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,050	186.750	756,337.500	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,500	59.760	388,440.000	
BANK OF AMERICA CORP	269,301	41.360	11,138,289.360	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,640	424.810	696,688.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,400	82.480	527,872.000	
AMERICAN EXPRESS CO	23,800	163.810	3,898,678.000	
ANALOG DEVICES INC	12,649	168.440	2,130,597.560	
ADVANCED MICRO DEVICES	42,450	81.550	3,461,797.500	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,422	51.100	1,554,564.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,680	173.830	987,354.400	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,100	87.950	712,395.000	
AVERY DENNISON CORP	2,930	213.560	625,730.800	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	18,300	70.790	1,295,457.000	
EMERSON ELECTRIC CO	21,050	97.380	2,049,849.000	
AON PLC-CLASS A	7,820	250.060	1,955,469.200	
AMGEN INC	19,750	241.190	4,763,502.500	
EATON CORP PLC	13,636	146.000	1,990,856.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,850	236.370	1,382,764.500	
APPLIED MATERIALS INC	31,900	139.030	4,435,057.000	
CME GROUP INC	12,250	216.700	2,654,575.000	
ECOLAB INC	9,050	213.240	1,929,822.000	
EQUIFAX INC	4,300	228.850	984,055.000	

GILEAD SCIENCES INC	43,950	68.150	2,995,192.500	
KEURIG DR PEPPER INC	24,700	34.850	860,795.000	
HORMEL FOODS CORP	10,550	48.910	516,000.500	
STATE STREET CORP	12,463	84.790	1,056,737.770	
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,090	72.010	3,751,000.900	
BAXTER INTERNATIONAL INC	17,500	82.770	1,448,475.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,000	45.820	320,740.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,750	100.110	475,522.500	
CARDINAL HEALTH INC	10,400	58.330	606,632.000	
FEDEX CORP	8,800	292.990	2,578,312.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,704	158.710	2,492,381.840	
FMC CORP	4,400	118.460	521,224.000	
CERNER CORP	10,850	80.690	875,486.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,713	147.770	1,287,520.010	
CITRIX SYSTEMS INC	4,350	120.660	524,871.000	
INTEL CORP	141,200	58.190	8,216,428.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	13,400	33.630	450,642.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,650	64.710	818,581.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,050	232.430	2,568,351.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	6.750	233,550.000	
ILLUMINA INC	5,000	452.140	2,260,700.000	
SEALED AIR CORP	5,400	58.600	316,440.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,030	872.790	3,517,343.700	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	120.970	489,928.500	
SNAP-ON INC	1,930	235.250	454,032.500	
CARMAX INC	5,800	118.100	684,980.000	
DUKE ENERGY CORP	26,928	102.530	2,760,927.840	
TARGET CORP	17,400	233.070	4,055,418.000	
DOVER CORP	4,950	150.340	744,183.000	
WW GRAINGER INC	1,580	454.800	718,584.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,430	138.560	613,820.800	
CINTAS CORP	3,330	353.260	1,176,355.800	
CONAGRA BRANDS INC	17,300	37.470	648,231.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,050	83.430	421,321.500	
CLOROX COMPANY	4,430	174.230	771,838.900	
ENTERGY CORP	7,070	108.900	769,923.000	
MICROSOFT CORP	249,500	259.890	64,842,555.000	

INCYTE CORP	6,580	82.640	543,771.200	
CVS HEALTH CORP	45,619	84.620	3,860,279.780	
MEDTRONIC PLC	46,898	124.150	5,822,386.700	
MICRON TECHNOLOGY INC	39,050	80.490	3,143,134.500	
BLACKROCK INC	5,300	876.780	4,646,934.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	19,500	25.980	506,610.000	
HASBRO INC	4,400	95.500	420,200.000	
KELLOGG CO	8,800	65.390	575,432.000	
KEYCORP	34,000	21.530	732,020.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,250	292.360	950,170.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	48,811	63.790	3,113,653.690	
COOPER COS INC/THE	1,770	376.540	666,475.800	
CHUBB LTD	15,419	166.460	2,566,646.740	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	119.400	322,380.000	
ALLSTATE CORP	10,650	130.980	1,394,937.000	
EBAY INC	23,550	65.890	1,551,709.500	
PAYPAL HOLDINGS INC	38,600	274.930	10,612,298.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,800	122.100	586,080.000	
XILINX INC	8,650	128.330	1,110,054.500	
DISH NETWORK CORP-A	8,200	40.030	328,246.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,070	303.220	2,446,985.400	
TRIMBLE INC	8,550	78.790	673,654.500	
LENNAR CORP-A	9,700	92.040	892,788.000	
LEAR CORP	2,150	187.380	402,867.000	
PROGRESSIVE CORP	20,550	93.120	1,913,616.000	
PACCAR INC	12,237	91.070	1,114,423.590	
BIOGEN INC	5,370	406.140	2,180,971.800	
IDEXX LABORATORIES INC	3,030	592.360	1,794,850.800	
STARBUCKS CORP	41,000	112.450	4,610,450.000	
PTC INC	3,820	137.660	525,861.200	
EVERSOURCE ENERGY	12,110	82.550	999,680.500	
INTUIT INC	9,550	476.970	4,555,063.500	
BORGWARNER INC	8,200	51.970	426,154.000	
BEST BUY CO INC	8,250	114.030	940,747.500	
BALL CORP	11,534	81.120	935,638.080	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	48,897	42.540	2,080,078.380	
ELECTRONIC ARTS INC	9,970	148.550	1,481,043.500	
VULCAN MATERIALS CO	4,700	171.730	807,131.000	

	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,150	194.800	1,782,420.000	
	VF CORP	11,800	81.360	960,048.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	20,025	42.630	853,665.750	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,050	188.240	385,892.000	
	CARNIVAL CORP	28,900	28.750	830,875.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	158,690	57.280	9,089,763.200	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,900	62.770	495,883.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	4.930	198,679.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,309,497,043.520 (144,188,719,463)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	709,500	3.304	2,344,188.000	
	UNILEVER PLC	91,360	42.950	3,923,912.000	
	BARCLAYS PLC	606,300	1.794	1,087,702.200	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,500	1.073	300,071.200	
	PRUDENTIAL PLC	91,000	14.850	1,351,350.000	
	NATWEST GROUP PLC	166,791	2.051	342,088.340	
	EVRAZ PLC	17,400	6.336	110,246.400	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,464	30.780	198,961.920	
	BAE SYSTEMS PLC	112,500	5.338	600,525.000	
	AVIVA PLC	137,566	4.169	573,512.650	
	AVEVA GROUP PLC	3,800	35.360	134,368.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	175,500	14.074	2,469,987.000	
	INFORMA PLC	52,700	5.300	279,310.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	165,600	1.665	275,806.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	6.300	200,970.000	
	DCC PLC	3,400	60.800	206,720.000	
	OCADO GROUP PLC	16,300	18.935	308,640.500	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,600	131.950	343,070.000	
	HALMA PLC	12,900	27.910	360,039.000	
	ENTAIN PLC	20,000	18.115	362,300.000	
	JD SPORTS FASHION PLC	17,200	9.122	156,898.400	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	21,000	7.216	151,536.000	
	M&G PLC	91,700	2.442	223,931.400	
	RELX PLC	67,446	19.095	1,287,881.370	
	DIAGEO PLC	81,500	34.345	2,799,117.500	

RIO TINTO PLC	39,100	60.920	2,381,972.000	
STANDARD CHARTERED PLC	91,800	4.913	451,013.400	
TESCO PLC	269,684	2.317	624,992.670	
SMITH & NEPHEW PLC	30,650	15.495	474,921.750	
GLENCORE PLC	348,225	3.276	1,140,959.210	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,450	16.365	203,744.250	
SMITHS GROUP PLC	13,183	16.020	211,191.660	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	46,583	2.950	137,419.850	
PEARSON PLC	25,763	8.510	219,243.130	
SAINSBURY (J) PLC	59,525	2.538	151,074.450	
NEXT PLC	4,650	80.680	375,162.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,700	1.673	213,642.100	
WHITBREAD PLC	6,861	32.550	223,325.550	
BUNZL PLC	11,905	22.850	272,029.250	
VODAFONE GROUP PLC	935,183	1.300	1,215,737.900	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,711	71.160	335,234.760	
KINGFISHER PLC	73,711	3.443	253,786.970	
WPP PLC	42,900	10.020	429,858.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,827	10.270	234,433.290	
SEVERN TRENT PLC	8,583	25.190	216,205.770	
RENTOKIL INITIAL PLC	64,000	4.901	313,664.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	24,900	65.660	1,634,934.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	17,950	14.480	259,916.000	
SCHRODERS PLC	4,150	35.710	148,196.500	
SSE PLC	36,300	15.795	573,358.500	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,000	7.312	248,608.000	
ASTRAZENECA PLC	45,700	83.480	3,815,036.000	
FERGUSON PLC	7,837	96.220	754,076.140	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	208,000	2.769	575,952.000	
3I GROUP PLC	33,191	12.415	412,066.260	
ASHTED GROUP PLC	15,650	50.860	795,959.000	
SAGE GROUP PLC/THE	37,214	6.684	248,738.370	
NATIONAL GRID PLC	123,634	9.200	1,137,432.800	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,468,465	0.478	1,180,913.650	
IMPERIAL BRANDS PLC	33,000	16.075	530,475.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	45.710	189,696.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	78,360	27.955	2,190,553.800	
BHP GROUP PLC	73,627	21.520	1,584,453.040	



	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,150	22.920	278,478.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	708,650	4.394	3,114,162.420	
	ANGLO AMERICAN PLC	45,383	31.125	1,412,545.870	
	MONDI PLC	16,600	19.550	324,530.000	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	80,500	1.767	142,243.500	
	COMPASS GROUP PLC	62,139	16.100	1,000,437.900	
	PERSIMMON PLC	11,200	31.050	347,760.000	
	BT GROUP PLC	311,100	1.918	596,845.350	
	COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	26.360	188,474.000	
	BURBERRY GROUP PLC	14,289	22.190	317,072.910	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,436	50.380	324,245.680	
	INTERTEK GROUP PLC	5,500	54.200	298,100.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	11,399	77.700	885,702.300	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	142,900	14.584	2,084,053.600	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	129,218	13.936	1,800,782.040	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	24.650	140,505.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,600	31.100	205,260.000	
	ANTOFAGASTA PLC	14,100	15.320	216,012.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	77,862	2.848	221,750.970	
	EXPERIAN PLC	31,954	27.050	864,355.700	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 61,516,428.440 (9,559,037,815)	
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	40,100	16.480	660,848.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,400	241.200	337,680.000	
	ICL GROUP LTD	28,100	23.910	671,871.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	423.400	402,230.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	27.150	1,197,315.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	25.800	1,449,960.000	
	NICE LTD	2,400	735.500	1,765,200.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	101.800	549,720.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 7,034,824.000 (238,642,335)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	

MEDIBANK PRIVATE LTD	88,800	3.070	272,616.000	
BHP GROUP LTD	100,000	48.950	4,895,000.000	
SOUTH32 LTD	160,100	2.950	472,295.000	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	32,050	23.620	757,021.000	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,500	23.220	1,311,930.000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	111,350	26.460	2,946,321.000	
WESTPAC BANKING CORP	124,548	26.290	3,274,366.920	
SANTOS LTD	62,900	7.670	482,443.000	
AUSNET SERVICES	65,000	1.815	117,975.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	96,250	28.250	2,719,062.500	
RIO TINTO LTD	12,700	124.940	1,586,738.000	
ORIGIN ENERGY LTD	59,000	4.840	285,560.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.890	233,400.000	
XERO LTD	4,550	134.080	610,064.000	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	31.370	106,658.000	
COLES GROUP LTD	45,045	16.670	750,900.150	
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	30.700	165,780.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	37,000	11.500	425,500.000	
EVOLUTION MINING LTD	59,500	5.080	302,260.000	
AFTERPAY LTD	7,300	103.520	755,696.000	
REECE LTD	10,500	22.700	238,350.000	
OIL SEARCH LTD	64,200	4.100	263,220.000	
SEEK LTD	11,700	31.460	368,082.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	11.920	280,120.000	
NEWCREST MINING LTD	27,000	28.330	764,910.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	59,750	101.360	6,056,260.000	
AMPOL LTD	7,950	29.340	233,253.000	
ORICA LTD	13,100	14.310	187,461.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	49,150	11.320	556,378.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	43,100	42.910	1,849,421.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	5.010	364,542.630	
CROWN RESORTS LTD	13,400	12.220	163,748.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	4.710	143,655.000	
TELSTRA CORP LTD	143,500	3.580	513,730.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,950	44.540	665,873.000	
MACQUARIE GROUP LTD	11,634	151.560	1,763,249.040	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	19,350	40.700	787,545.000	

	CSL LTD	15,350	296.640	4,553,424.000	
	WESFARMERS LTD	38,600	55.000	2,123,000.000	
	COCHLEAR LTD	2,200	235.320	517,704.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	22.820	371,966.000	
	SUNCORP GROUP LTD	43,657	11.220	489,831.540	
	ASX LTD	6,700	74.020	495,934.000	
	COMPUTERSHARE LTD	18,200	16.060	292,292.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	80,336	5.220	419,353.920	
	SONIC HEALTHCARE LTD	15,150	35.600	539,340.000	
	AGL ENERGY LTD	21,500	9.320	200,380.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	11.250	567,000.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,150	63.620	391,263.000	
	REA GROUP LTD	1,800	166.700	300,060.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	50.120	220,528.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	115.300	253,660.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 49,407,120.700 (4,195,158,618)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	9,100	40.990	373,009.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	1,809.400	1,266,580.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,687	82.600	800,146.200	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15,400	58.050	893,970.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,850	167.670	813,199.500	
	BCE INC	4,930	60.770	299,596.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,700	184.780	1,238,026.000	
	SUNCOR ENERGY INC	52,230	30.630	1,599,804.900	
	METRO INC/CN	8,600	58.450	502,670.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	11,600	91.210	1,058,036.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	42,100	80.840	3,403,364.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,550	144.380	2,245,109.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	62,800	86.930	5,459,204.000	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	9,800	36.280	355,544.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	49,250	126.410	6,225,692.500	
	TC ENERGY CORP	32,750	64.160	2,101,240.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,829	40.460	761,821.340	
	BARRICK GOLD CORP	60,800	28.110	1,709,088.000	

CAE INC	9,500	38.470	365,465.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,912	119.530	706,661.360	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,900	42.090	248,331.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,800	85.680	239,904.000	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,800	21.660	168,948.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,050	68.790	347,389.500	
HYDRO ONE LTD	11,300	30.810	348,153.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	75.990	452,900.400	
NORTHLAND POWER INC	7,900	41.850	330,615.000	
WSP GLOBAL INC	3,900	140.790	549,081.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800	107.510	301,028.000	
PARKLAND CORP	5,100	39.950	203,745.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	32.380	194,280.000	
EMERA INC	8,300	57.420	476,586.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	35.940	172,512.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,200	62.560	763,232.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	8.770	197,325.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,200	86.150	706,430.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	20,100	19.660	395,166.000	
B2GOLD CORP	34,700	5.950	206,465.000	
AIR CANADA	5,500	28.340	155,870.000	
KINROSS GOLD CORP	43,200	9.420	406,944.000	
BANK OF MONTREAL	22,500	126.500	2,846,250.000	
POWER CORP OF CANADA	19,100	39.500	754,450.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,900	1,585.830	6,184,737.000	
NUTRIEN LTD	19,519	77.410	1,510,965.790	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	30.460	225,404.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	52.200	459,360.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,200	52.000	218,400.000	
CAMECO CORP	14,000	23.410	327,740.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	208.470	291,858.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	40.200	261,300.000	
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	3,500	92.260	322,910.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,900	85.830	163,077.000	
TELUS CORP	10,800	27.640	298,512.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	16,100	27.990	450,639.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,000	202.730	405,460.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	40,500	45.530	1,843,965.000	

FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	555.760	500,184.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,600	117.230	1,125,408.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	119.090	302,131.330	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	38.180	267,260.000	
BLACKBERRY LTD	17,800	17.070	303,846.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	20,050	63.520	1,273,576.000	
ENBRIDGE INC	70,200	49.430	3,469,986.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	44,525	60.210	2,680,850.250	
MANULIFE FINANCIAL CORP	66,300	24.590	1,630,317.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	38.260	401,730.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	23,400	97.900	2,290,860.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,700	68.260	252,562.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,000	43.020	301,140.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,650	134.770	3,322,080.500	
CGI INC - CLASS A	7,900	110.500	872,950.000	
ONEX CORPORATION	2,600	85.660	222,716.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,000	36.130	578,080.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	44.690	138,539.000	
TMX GROUP LTD	1,900	131.340	249,546.000	
OPEN TEXT CORP	9,400	60.600	569,640.000	
SAPUTO INC	8,700	36.700	319,290.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,400	28.050	572,220.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	29,500	45.290	1,336,055.000	
YAMANA GOLD INC	32,300	6.150	198,645.000	
FORTIS INC	15,800	56.670	895,386.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	72.310	274,778.000	
LUNDIN MINING CORP	22,100	12.750	281,775.000	
CENOVUS ENERGY INC	43,900	12.170	534,263.000	
DOLLARAMA INC	10,200	55.420	565,284.000	
ATCO LTD -CLASS I	2,900	45.620	132,298.000	
ALTAGAS LTD	9,100	25.230	229,593.000	
KEYERA CORP	7,400	34.790	257,446.000	
INTER PIPELINE LTD	14,300	20.150	288,145.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 82,246,739.670 (7,458,134,352)	
シンガポール・ ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	44,000	25.980	1,143,120.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	67,400	29.660	1,999,084.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	5.130	248,676.750	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.180	291,634.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.390	126,369.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.580	122,038.000	
	CAPITALAND LTD	102,400	3.760	385,024.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	125,900	12.230	1,539,757.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.885	184,965.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	19.000	188,100.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	312,150	2.330	727,309.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.890	219,785.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	10.710	337,365.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.770	354,888.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,868,115.250 (652,974,885)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	124,650	14.615	1,821,759.750	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,100	365.800	402,380.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	865.500	242,340.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	64.380	331,557.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	24,130	341.700	8,245,221.000	
	SIKA AG-REG	4,810	293.800	1,413,178.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	92,900.000	371,600.000	
	ABB LTD-REG	62,700	31.030	1,945,581.000	
	SWISS RE AG	10,450	84.800	886,160.000	
	NESTLE SA-REG	98,900	113.820	11,256,798.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	780	1,395.000	1,088,100.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,380	266.500	367,770.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	84,370	9.574	807,758.380	
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	61.520	455,248.000	
	SGS SA-REG	200	2,817.000	563,400.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	259.000	178,710.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	137.550	199,447.500	
	TEMENOS AG - REG	2,300	150.550	346,265.000	
	ALCON INC	17,280	63.840	1,103,155.200	

	SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	322.500	312,825.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,192	371.500	1,928,828.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	147.300	231,261.000	
	CLARIANT AG-REG	6,650	19.335	128,577.750	
	NOVARTIS AG-REG	76,250	83.840	6,392,800.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	120	2,106.000	252,720.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	17,710	115.100	2,038,421.000	
	SWISSCOM AG-REG	870	525.000	456,750.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,010	82.900	83,729.000	
	GEBERIT AG-REG	1,300	669.600	870,480.000	
	GIVAUDAN-REG	310	4,230.000	1,311,300.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	1,403.500	477,190.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,922	326.400	627,340.800	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,000	115.900	695,400.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,600	664.600	1,727,960.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	62.500	95,000.000	
	HOLCIM LTD	17,790	56.560	1,006,202.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,110	457.300	507,603.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,800	318.800	573,840.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,510	93.800	235,438.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	8,750.000	297,500.000	
	スイス・フラン 小計			スイス・フラン 52,277,594.780 (6,400,345,929)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	3,520	406.700	1,431,584.000	
	ERICSSON LM-B SHS	108,330	109.420	11,853,468.600	
	VOLVO AB-B SHS	53,150	225.800	12,001,270.000	
	SKF AB-B SHARES	13,300	219.300	2,916,690.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	236.300	1,795,880.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	78.100	4,787,530.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	116.450	1,956,360.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	59,200	108.850	6,443,920.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,850	94.520	5,184,422.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,100	154.560	5,270,496.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	209.800	5,916,360.000	

	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	139.550	3,195,695.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	244.400	3,140,540.000	
	SANDVIK AB	42,000	221.100	9,286,200.000	
	INVESTOR AB-B SHS	67,600	195.800	13,236,080.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,000	514.200	12,855,000.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	232.800	1,862,400.000	
	SECURITAS AB-B SHS	10,950	133.100	1,457,445.000	
	TELIA CO AB	100,200	36.755	3,682,851.000	
	ALFA LAVAL AB	11,000	299.000	3,289,000.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,100	439.400	6,195,540.000	
	ASSA ABLOY AB-B	37,050	261.500	9,688,575.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	3,900	341.200	1,330,680.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	3,600	580.400	2,089,440.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	553.000	1,437,800.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	278.400	1,447,680.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	44,800	89.640	4,015,872.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	307.900	2,324,645.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,000	291.100	6,695,300.000	
	EMBRACER GROUP AB	10,000	243.200	2,432,000.000	
	BOLIDEN AB	10,400	346.500	3,603,600.000	
	EPIROC AB-A	24,950	180.050	4,492,247.500	
	EPIROC AB-B	13,500	159.600	2,154,600.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	117.300	1,659,795.000	
	NORDEA BANK ABP	119,600	94.420	11,292,632.000	
	EQT AB	9,100	323.100	2,940,210.000	
	EVOLUTION AB	6,350	1,590.000	10,096,500.000	
	SINCH AB	1,800	1,497.000	2,694,600.000	
	KINNEVIK AB - B	8,300	324.100	2,690,030.000	
	HEXAGON AB-B SHS	71,400	123.500	8,817,900.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	324.100	1,847,370.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 201,510,208.100 (2,663,964,951)	
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	63,700	516.300	32,888,310.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	115.450	3,001,700.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	17,610.000	2,113,200.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	37,450	224.300	8,400,035.000	



	GN STORE NORD A/S	4,550	521.200	2,371,460.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,138.000	4,438,200.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	453.300	3,558,405.000	
	COLOPLAST-B	4,500	989.200	4,451,400.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,660	1,446.500	11,080,190.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	2,995.000	898,500.000	
	DEMANT A/S	3,875	343.800	1,332,225.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	220	18,340.000	4,034,800.000	
	TRYG A/S	13,200	152.000	2,006,400.000	
	PANDORA A/S	3,800	847.200	3,219,360.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,750	562.600	2,109,750.000	
	GENMAB A/S	2,460	2,703.000	6,649,380.000	
	ORSTED A/S	7,050	868.200	6,120,810.000	
	AMBU A/S-B	6,300	234.900	1,479,870.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 100,153,995.000 (1,797,764,210)	
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	47,500	5.340	253,650.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	6.430	147,890.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	6.290	164,798.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	68,789	4.800	330,187.200	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,700	7.430	339,551.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	22,200	29.130	646,686.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	13.050	215,325.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,098,087.200 (164,993,578)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	50,700	54.320	2,754,024.000	
	DNB ASA	33,950	189.000	6,416,550.000	
	ORKLA ASA	26,950	87.960	2,370,522.000	
	TELENOR ASA	25,400	144.050	3,658,870.000	
	EQUINOR ASA	36,723	192.160	7,056,691.680	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	402.100	1,125,880.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	471.100	3,137,526.000	
	MOWI ASA	16,600	229.500	3,809,700.000	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	190.450	1,399,807.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	349.800	1,276,770.000	
	ADEVINTA ASA	10,600	162.000	1,717,200.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 34,723,541.180 (459,045,215)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	33,870	53.210	1,802,222.700	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	28.320	198,240.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	71,250	11.568	824,220.000	
	COMMERZBANK AG	32,935	6.430	211,772.050	
	VOLKSWAGEN AG	1,110	296.800	329,448.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,300	230.100	1,449,630.000	
	SIEMENS AG-REG	26,350	135.740	3,576,749.000	
	E.ON SE	76,100	10.168	773,784.800	
	UNIPER SE	6,650	30.690	204,088.500	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,250	94.790	1,066,387.500	
	GEA GROUP AG	5,050	34.000	171,700.000	
	CONTINENTAL AG	3,710	128.720	477,551.200	
	BASF SE	31,670	67.240	2,129,490.800	
	ALLIANZ SE-REG	14,190	216.650	3,074,263.500	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,050	92.880	561,924.000	
	RWE AG	21,800	31.090	677,762.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	10.680	103,062.000	
	BRENNTAG SE	5,350	76.140	407,349.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	14,050	45.160	634,498.000	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	34.560	114,739.200	
	SAP SE	35,892	119.920	4,304,168.640	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,760	233.900	1,113,364.000	
	ZALANDO SE	5,750	95.460	548,895.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	74.680	365,932.000	
	KION GROUP AG	2,400	89.780	215,472.000	
	COVESTRO AG	6,700	53.620	359,254.000	
	RATIONAL AG	190	705.400	134,026.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	414.600	501,666.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,300	97.200	515,160.000	
	DELIVERY HERO SE	5,450	111.150	605,767.500	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	154.150	215,810.000	

BECHTLE AG	950	156.200	148,390.000
NEMETSCHKE SE	2,000	61.900	123,800.000
SCOUT24 AG	3,600	67.000	241,200.000
AROUNDTOWN SA	32,500	7.074	229,905.000
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,950	48.720	436,044.000
KNORR-BREMSE AG	2,500	102.650	256,625.000
HELLOFRESH SE	5,700	83.780	477,546.000
TEAMVIEWER AG	5,350	32.390	173,286.500
SIEMENS ENERGY AG	13,125	25.430	333,768.750
BEIERSDORF AG	3,290	100.300	329,987.000
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,350	42.900	100,815.000
MERCK KGAA	4,400	154.150	678,260.000
ADIDAS AG	6,640	293.000	1,945,520.000
PUMA SE	3,310	93.260	308,690.600
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	80.300	273,020.000
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	114,900	17.788	2,043,841.200
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	68.980	498,035.600
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	29,550	78.920	2,332,086.000
QIAGEN N.V.	7,698	39.230	301,992.540
INFINEON TECHNOLOGIES AG	44,300	34.215	1,515,724.500
HANNOVER RUECK SE	2,000	142.600	285,200.000
DEUTSCHE POST AG-REG	34,200	56.900	1,945,980.000
DEUTSCHE BOERSE AG	6,410	137.500	881,375.000
LANXESS AG	2,800	60.700	169,960.000
MTU AERO ENGINES AG	1,790	208.000	372,320.000
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,400	51.760	590,064.000
SYMRISE AG	4,400	112.400	494,560.000
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.266	76,590.800
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	79.650	155,317.500
VONOVIA SE	18,200	53.640	976,248.000
LEG IMMOBILIEN SE	2,300	120.750	277,725.000
KONINKLIJKE PHILIPS NV	31,410	44.450	1,396,174.500
NN GROUP NV	9,900	40.540	401,346.000
ARCELORMITTAL	24,300	26.925	654,277.500
HEINEKEN NV	8,800	98.220	864,336.000
AEGON NV	58,244	3.745	218,123.780

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37,383	24.795	926,911.480	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	106.450	695,970.100	
KONINKLIJKE DSM NV	5,850	151.900	888,615.000	
WOLTERS KLUWER	9,300	80.960	752,928.000	
ING GROEP NV	134,150	11.210	1,503,821.500	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.676	324,197.400	
ASML HOLDING NV	14,410	577.700	8,324,657.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	10.718	139,869.900	
ADYEN NV	690	1,931.600	1,332,804.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,250	73.890	314,032.500	
PROSUS NV	16,500	85.290	1,407,285.000	
JDE PEET'S NV	2,600	31.500	81,900.000	
INPOST SA	7,000	15.312	107,184.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,600	271.400	434,240.000	
VOPAK	2,300	39.850	91,655.000	
RANDSTAD NV	4,000	64.600	258,400.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,950	83.450	329,627.500	
TOTALENERGIES SE	85,950	40.885	3,514,065.750	
MICHELIN (CGDE)	5,700	129.100	735,870.000	
AIR LIQUIDE SA	16,327	140.860	2,299,821.220	
KERING	2,580	744.000	1,919,520.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,550	130.100	2,413,355.000	
BOUYGUES SA	8,200	33.490	274,618.000	
BNP PARIBAS	38,800	56.450	2,190,260.000	
NATIXIS	29,550	4.002	118,259.100	
THALES SA	3,500	86.100	301,350.000	
DANONE	22,700	59.480	1,350,196.000	
CARREFOUR SA	21,200	17.195	364,534.000	
SUEZ	11,225	20.070	225,285.750	
VIVENDI	27,891	29.190	814,138.290	
L'OREAL	8,660	384.550	3,330,203.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17,200	56.740	975,928.000	
LEGRAND SA	9,067	88.000	797,896.000	
PERNOD RICARD SA	7,087	177.350	1,256,879.450	
EURAZEO SE	1,254	73.600	92,294.400	
SOCIETE GENERALE SA	27,950	26.380	737,321.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,570	672.600	6,436,782.000	

ACCOR SA	6,150	34.680	213,282.000	
CAPGEMINI SE	5,470	158.500	866,995.000	
VALEO SA	7,700	28.220	217,294.000	
PUBLICIS GROUPE	7,500	56.480	423,600.000	
BUREAU VERITAS SA	9,700	26.140	253,558.000	
EIFFAGE	2,740	90.940	249,175.600	
SODEXO SA	2,950	81.240	239,658.000	
IPSEN	1,150	91.220	104,903.000	
ORPEA	1,800	108.000	194,400.000	
AMUNDI SA	1,950	74.950	146,152.500	
TELEPERFORMANCE	2,000	321.000	642,000.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	59.840	179,520.000	
FAURECIA	3,857	45.500	175,493.500	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,400	87.130	383,372.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	384.600	384,600.000	
SEB SA	997	153.700	153,238.900	
ESSILORLUXOTTICA	9,850	148.500	1,462,725.000	
DASSAULT AVIATION SA	100	1,024.000	102,400.000	
WORLDLINE SA	8,064	78.970	636,814.080	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	49.300	172,550.000	
AXA SA	66,700	22.475	1,499,082.500	
EDENRED	8,300	50.180	416,494.000	
RENAULT SA	6,400	36.835	235,744.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,090	1,196.000	1,303,640.000	
STMICROELECTRONICS NV	23,600	31.565	744,934.000	
REMY COINTREAU	750	165.900	124,425.000	
ATOS SE	3,200	54.420	174,144.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	4,500	194.450	875,025.000	
WENDEL	930	116.700	108,531.000	
ORANGE	67,600	10.450	706,420.000	
ALSTOM	9,700	45.460	440,962.000	
CNP ASSURANCES	5,850	14.565	85,205.250	
SANOFI	38,975	88.890	3,464,487.750	
VINCI SA	18,350	96.010	1,761,783.500	
AIRBUS SE	20,200	112.400	2,270,480.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18,300	26.150	478,545.000	
CREDIT AGRICOLE SA	39,100	12.458	487,107.800	
BIOMERIEUX	1,340	91.880	123,119.200	
ENGIE	61,823	12.308	760,917.480	

EDF	20,250	11.985	242,696.250	
SAFRAN SA	11,920	123.100	1,467,352.000	
ILIAD SA	490	134.950	66,125.500	
ARKEMA	2,220	108.400	240,648.000	
ADP	910	126.600	115,206.000	
SCOR SE	5,550	27.980	155,289.000	
GETLINK SE	14,200	13.000	184,600.000	
BOLLORE	28,600	4.388	125,496.800	
UCB SA	4,530	83.440	377,983.200	
KBC GROUP NV	8,650	68.020	588,373.000	
COLRUYT SA	1,600	51.860	82,976.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,800	94.280	358,264.000	
SOLVAY SA	2,450	112.300	275,135.000	
UMICORE	7,000	49.500	346,500.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	26,150	64.610	1,689,551.500	
AGEAS	6,290	49.360	310,474.400	
PROXIMUS	4,950	17.370	85,981.500	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	93.500	98,175.000	
SOFINA	550	352.000	193,600.000	
ARGENX SE	1,520	263.400	400,368.000	
PRYSMIAN SPA	8,850	29.260	258,951.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	37,243	17.150	638,717.450	
MEDIOBANCA SPA	20,665	9.960	205,823.400	
TENARIS SA	15,700	9.744	152,980.800	
UNICREDIT SPA	73,956	10.740	794,287.440	
TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.450	154,791.900	
TELECOM ITALIA-RSP	203,950	0.495	101,138.800	
INTESA SANPAOLO	571,737	2.450	1,400,755.650	
ATLANTIA SPA	17,257	15.735	271,538.890	
POSTE ITALIANE SPA	17,700	12.015	212,665.500	
MONCLER SPA	6,600	57.120	376,992.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,450	47.710	164,599.500	
ENI SPA	87,800	10.728	941,918.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	11.145	217,327.500	
DIASORIN SPA	850	150.750	128,137.500	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	9.654	108,124.800	
NEXI SPA	14,650	17.495	256,301.750	
AMPLIFON SPA	4,300	40.850	175,655.000	

ENEL SPA	281,134	8.102	2,277,747.660	
SNAM SPA	70,100	5.040	353,304.000	
TERNA SPA	49,000	6.548	320,852.000	
EXOR NV	3,780	69.620	263,163.600	
CNH INDUSTRIAL NV	34,200	14.290	488,718.000	
FINECOBANK SPA	20,700	13.925	288,247.500	
STELLANTIS NV	69,300	16.968	1,175,882.400	
FERRARI NV	4,295	168.250	722,633.750	
TELEFONICA SA	167,227	4.112	687,637.420	
ENDESA SA	10,350	22.290	230,701.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	225,700	5.343	1,205,915.100	
IBERDROLA SA	207,434	10.820	2,244,435.880	
REPSOL SA	49,400	11.472	566,716.800	
GRIFOLS SA	9,800	23.540	230,692.000	
BANCO SANTANDER SA	599,750	3.437	2,061,640.620	
AMADEUS IT GROUP SA	15,050	65.500	985,775.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	21.860	205,484.000	
CAIXABANK SA	150,500	2.804	422,002.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	25.570	226,959.320	
AENA SME SA	2,600	143.100	372,060.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,005	52.200	939,861.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	37,700	31.790	1,198,483.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	25.930	199,661.000	
ENAGAS SA	7,950	19.750	157,012.500	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	17.090	237,551.000	
FERROVIAL SA	16,270	25.340	412,281.800	
UPM-KYMMENE OYJ	18,050	32.500	586,625.000	
NOKIA OYJ	191,300	4.529	866,397.700	
WARTSILA OYJ ABP	14,700	12.180	179,046.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,700	15.085	297,174.500	
ELISA OYJ	4,600	50.520	232,392.000	
SAMPO OYJ-A SHS	17,300	38.860	672,278.000	
FORTUM OYJ	14,950	24.280	362,986.000	
KESKO OYJ-B SHS	9,200	29.940	275,448.000	
KONE OYJ-B	11,800	67.580	797,444.000	
NESTE OYJ	14,700	55.400	814,380.000	

	ORION OYJ-CLASS B	3,600	37.930	136,548.000	
	VERBUND AG	2,250	76.450	172,012.500	
	OMV AG	5,300	50.740	268,922.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	9,450	33.710	318,559.500	
	VOESTALPINE AG	4,250	36.240	154,020.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	20.660	90,904.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	46.320	398,352.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,400	78.480	423,792.000	
	JERONIMO MARTINS	8,500	15.880	134,980.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	92,100	4.599	423,567.900	
	GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	9.876	165,423.000	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	19.400	213,400.000	
	KERRY GROUP PLC-A	5,300	106.400	563,920.000	
	CRH PLC	26,700	42.750	1,141,425.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	5,810	159.700	927,857.000	
ユーロ 小計				ユーロ 164,560,762.940 (21,960,633,813)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	48.650	2,554,125.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	62.450	5,183,350.000	
	MTR CORP	58,500	43.400	2,538,900.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	49,500	122.000	6,039,000.000	
	SINO LAND CO	126,000	12.460	1,569,960.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	102,169	59.800	6,109,706.200	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	57.750	1,068,375.000	
	CLP HOLDINGS LTD	62,000	78.650	4,876,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	38.300	2,125,918.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	422,475	12.320	5,204,892.000	
	HANG SENG BANK LTD	28,800	159.200	4,584,960.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	42.200	2,468,700.000	
	WH GROUP LTD	361,000	7.170	2,588,370.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,500	468.200	20,834,900.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	19.760	1,541,280.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	15.600	705,744.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	62,000	30.150	1,869,300.000	
	SJM HOLDINGS LTD	71,000	8.810	625,510.000	



SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	23.750	907,250.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	52.550	4,790,930.950	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	48.100	1,130,350.000	
AIA GROUP LTD	447,000	95.600	42,733,200.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	45.200	2,847,600.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	60,900	26.250	1,598,625.000	
ESR CAYMAN LTD	75,000	24.350	1,826,250.000	
SANDS CHINA LTD	86,800	33.950	2,946,860.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	15.520	1,272,640.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	52,000	140.700	7,316,400.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	132,000	27.700	3,656,400.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	13.140	709,560.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 144,225,356.250 (2,046,557,806)	
合計			201,785,972,970 [201,785,972,970]	

## (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	4,887	1,046,844.270	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,557	1,540,316.960	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,250	651,157.500	
		VORNADO REALTY TRUST	5,397	270,227.790	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,800	1,216,038.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	12,700	1,027,557.000	
		EQUINIX INC	3,148	2,593,920.520	
		AMERICAN TOWER CORP	15,450	4,186,023.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	24,943	440,742.810	
		INVITATION HOMES INC	20,000	756,200.000	
		VICI PROPERTIES INC	18,900	620,298.000	
		VENTAS INC	13,250	781,220.000	
		WEYERHAEUSER CO	26,464	913,801.920	
AGNC INVESTMENT CORP	18,100	319,103.000			

	CROWN CASTLE INTL CORP	14,750	2,906,930.000	
	IRON MOUNTAIN INC	10,260	471,344.400	
	VEREIT INC	8,150	398,942.500	
	SUN COMMUNITIES INC	3,720	660,672.000	
	PROLOGIS INC	25,252	3,185,792.320	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,650	899,914.500	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,450	466,405.500	
	DUKE REALTY CORP	13,150	650,925.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,310	728,574.000	
	WELLTOWER INC	14,750	1,197,847.500	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19,000	670,700.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,050	694,939.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,150	470,598.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	47,600	442,680.000	
	REALTY INCOME CORP	13,150	928,390.000	
	PUBLIC STORAGE	5,550	1,635,196.500	
	REGENCY CENTERS CORP	5,700	380,988.000	
	UDR INC	10,550	528,766.000	
	WP CAREY INC	6,050	470,327.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,300	313,657.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,900	1,607,067.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,650	743,721.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,350	447,089.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 37,264,917.990 (4,103,240,120)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,562	169,316.530	
	SEGRO PLC	40,600	444,976.000	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	152,123.400	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 766,415.930 (119,093,371)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	23,500	299,625.000	
	TRANSURBAN GROUP	91,500	1,310,280.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	256,700.000	
	APA GROUP	38,100	360,045.000	

	SCENTRE GROUP	170,922	495,673.800	
	DEXUS	36,150	387,889.500	
	GPT GROUP	63,160	310,115.600	
	MIRVAC GROUP	136,100	404,217.000	
	STOCKLAND	78,000	373,620.000	
	GOODMAN GROUP	55,300	1,140,286.000	
	VICINITY CENTRES	123,273	206,482.270	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 5,544,934.170 (470,820,361)
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	165,503.000	カナダ・ドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	102,366.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 267,869.000 (24,290,361)
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	369,765.000	シンガポール・ドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	175,032	376,318.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	104,800	211,696.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	166,625.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 1,124,404.800 (93,314,354)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	368,552.000	ユーロ
	GECINA SA	1,600	217,120.000	
	KLEPIERRE	7,150	178,464.000	
	COVIVIO	1,750	142,065.000	
ユーロ 小計				ユーロ 906,201.000 (120,932,524)
香港・ドル	LINK REIT	79,500	6,109,575.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	724,960.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,454,520.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 8,289,055.000 (117,621,690)
投資証券 合計				5,049,312,781

		[5,049,312,781]	
合計		5,049,312,781	[5,049,312,781]

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 600銘柄 投資証券 37銘柄	97.2%	2.8%	71.6%
イギリス・ポンド	株式 83銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	4.7%
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 52銘柄 投資証券 11銘柄	89.9%	10.1%	2.3%
カナダ・ドル	株式 89銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.6%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資証券 4銘柄	87.5%	12.5%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.1%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100%	-%	1.3%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 232銘柄 投資証券 4銘柄	99.5%	0.5%	10.7%
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 3銘柄	94.6%	5.4%	1.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



### 【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	25,210,357	9,942,684
親投資信託受益証券	18,576,559,929	5,769,237,461
未収入金	-	1,453,855
流動資産合計	18,601,770,286	5,780,634,000
資産合計	18,601,770,286	5,780,634,000
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,336,315
未払受託者報酬	508,160	312,474
未払委託者報酬	6,352,498	3,906,446
その他未払費用	254,074	156,177
流動負債合計	7,114,732	5,711,412
負債合計	7,114,732	5,711,412
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	18,167,937,521	5,663,399,869
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	426,718,033	111,522,719
(分配準備積立金)	53,177,639	34,839,429
元本等合計	18,594,655,554	5,774,922,588
純資産合計	18,594,655,554	5,774,922,588
負債純資産合計	18,601,770,286	5,780,634,000

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		34		40
有価証券売買等損益		120,950,147		41,364,114
営業収益合計		120,950,113		41,364,074
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,983		3,782
受託者報酬		781,356		842,566
委託者報酬		9,768,041		10,533,128
その他費用		391,772		421,193
営業費用合計		10,945,152		11,800,669
営業損失( )		131,895,265		53,164,743
経常損失( )		131,895,265		53,164,743
当期純損失( )		131,895,265		53,164,743
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		71,372,831		49,983,678
期首剰余金又は期首欠損金( )		179,204,975		426,718,033
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,043,717,615		168,371,067
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,043,717,615		168,371,067
剰余金減少額又は欠損金増加額		735,682,123		480,385,316
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		735,682,123		480,385,316
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		426,718,033		111,522,719



## (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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	4,937,687,762円	18,167,937,521円
期中追加設定元本額	32,014,941,813円	8,663,614,937円
期中一部解約元本額	18,784,692,054円	21,168,152,589円
2. 計算期間末日における受益権の総数	18,167,937,521口	5,663,399,869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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(49,051,353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(539,632,677円)及び分配準備積立金(4,126,286円)より分配対象額は592,810,316円(1万口当たり326.29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(29,795,612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(185,291,340円)及び分配準備積立金(5,043,817円)より分配対象額は220,130,769円(1万口当たり388.69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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	53,780,611	2,019,926
合計	53,780,611	2,019,926

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0235円 (10,235円)	1.0197円 (10,197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	4,066,279,575	5,769,237,461	
親投資信託受益証券 合計			5,769,237,461	
合計			5,769,237,461	

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6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	620,052,568	304,913,534
国債証券	87,708,826,340	81,001,185,060
地方債証券	4,340,851,300	3,815,467,800
特殊債券	3,306,333,300	2,888,176,200
社債券	2,671,610,000	2,683,079,000
未収利息	224,798,960	215,492,780
前払費用	16,895,375	3,779,003
流動資産合計	98,889,367,843	90,912,093,377
資産合計	98,889,367,843	90,912,093,377
負債の部		
流動負債		
未払金	376,905,600	-
未払解約金	3,772,285	16,874,656
その他未払費用	1,044	-
流動負債合計	380,678,929	16,874,656
負債合計	380,678,929	16,874,656
純資産の部		
元本等		
元本	1 69,278,918,714	64,064,308,423
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,229,770,200	26,830,910,298
元本等合計	98,508,688,914	90,895,218,721
純資産合計	98,508,688,914	90,895,218,721
負債純資産合計	98,889,367,843	90,912,093,377

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日
-----	------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	55,985,054,926円	69,278,918,714円
期中追加設定元本額	33,429,197,062円	15,470,151,442円
期中一部解約元本額	20,135,333,274円	20,684,761,733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)	94,250,066円	59,409,262円
ダイワ国内重視バランスファ		
ンド50VA(一般投資家私		
募)	543,945,103円	477,014,134円
ダイワ国際分散バランスファ		
ンド30VA(一般投資家私		
募)	68,129,248円	56,254,222円
ダイワ国際分散バランスファ		
ンド50VA(一般投資家私		
募)	733,380,244円	695,670,689円
DCダイワ日本債券インデッ		
クス	7,907,898,882円	9,122,815,494円
ダイワ・バランスファンド3		
5VA	10,244,117,584円	10,384,022,114円
ダイワ・バランスファンド2		
5VA(適格機関投資家専		
用)	1,837,765,507円	1,740,356,884円

ダイワ国内バランスファンド 25VA（適格機関投資家専用）	242,209,209円	230,835,703円
ダイワ国内バランスファンド 30VA（適格機関投資家専用）	351,662,678円	324,077,667円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	78,373,970円	63,627,153円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	23,424,297,601円	25,768,859,542円
ダイワ日本債券インデックス （ダイワSMA専用）	13,064,603,650円	4,066,279,575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	1,590,741,522円	2,048,833,424円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,114,983,405円	1,025,561,005円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,929,593,267円	6,819,991,193円
ダイワライフスタイル25	428,801,797円	475,535,380円
ダイワライフスタイル50	504,023,654円	552,857,495円
ダイワライフスタイル75	120,141,327円	152,307,487円
計	69,278,918,714円	64,064,308,423円
2. 期末日における受益権の総数	69,278,918,714口	64,064,308,423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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	789,513,120	303,600,170
地方債証券	21,563,600	10,120,400
特殊債証券	16,998,900	6,333,600
社債証券	23,128,800	7,647,600
合計	851,204,420	312,406,570

(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6月15日まで、及び2020年12月1日から2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4219円	1.4188円



(1万口当たり純資産額)	(14,219円)	(14,188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 1 5 2年国債	750,000,000	751,942,500	
	4 1 7 2年国債	100,000,000	100,304,000	
	4 2 1 2年国債	600,000,000	602,298,000	
	4 2 3 2年国債	100,000,000	100,251,000	
	4 2 4 2年国債	500,000,000	501,315,000	
	1 3 3 5年国債	550,000,000	551,529,000	
	1 3 4 5年国債	950,000,000	953,230,000	
	1 3 5 5年国債	1,550,000,000	1,556,277,500	
	1 3 6 5年国債	950,000,000	954,398,500	
	1 3 7 5年国債	800,000,000	804,264,000	
	1 3 8 5年国債	1,200,000,000	1,207,260,000	
	1 3 9 5年国債	900,000,000	905,976,000	
	1 4 0 5年国債	700,000,000	705,075,000	
	1 4 1 5年国債	920,000,000	927,084,000	
	1 4 2 5年国債	850,000,000	857,046,500	
	1 4 3 5年国債	700,000,000	706,209,000	
	1 4 4 5年国債	700,000,000	706,629,000	
	1 4 5 5年国債	870,000,000	878,569,500	
	1 4 6 5年国債	480,000,000	484,790,400	
	1 4 7 5年国債	818,000,000	822,695,320	
	1 4 0年国債	70,000,000	101,269,700	
	2 4 0年国債	110,000,000	154,079,200	
	3 4 0年国債	150,000,000	211,194,000	
	4 4 0年国債	180,000,000	254,003,400	
	5 4 0年国債	125,000,000	170,662,500	
	6 4 0年国債	105,000,000	141,223,950	
	7 4 0年国債	121,000,000	156,581,260	
	8 4 0年国債	230,000,000	278,525,400	
	9 4 0年国債	220,000,000	199,872,200	

1 0	4 0 年国債	275,000,000	292,402,000	
1 1	4 0 年国債	320,000,000	329,836,800	
1 2	4 0 年国債	430,000,000	400,725,600	
1 3	4 0 年国債	430,000,000	399,517,300	
3 2 5	1 0 年国債	310,000,000	313,605,300	
3 2 6	1 0 年国債	30,000,000	30,372,600	
3 2 7	1 0 年国債	450,000,000	456,268,500	
3 2 8	1 0 年国債	350,000,000	354,473,000	
3 2 9	1 0 年国債	500,000,000	509,375,000	
3 3 0	1 0 年国債	612,000,000	624,986,640	
3 3 1	1 0 年国債	365,000,000	371,088,200	
3 3 2	1 0 年国債	250,000,000	254,630,000	
3 3 3	1 0 年国債	700,000,000	714,343,000	
3 3 4	1 0 年国債	900,000,000	920,133,000	
3 3 5	1 0 年国債	690,000,000	704,358,900	
3 3 6	1 0 年国債	275,000,000	281,160,000	
3 3 7	1 0 年国債	400,000,000	406,140,000	
3 3 8	1 0 年国債	580,000,000	591,721,800	
3 3 9	1 0 年国債	590,000,000	602,726,300	
3 4 0	1 0 年国債	760,000,000	777,259,600	
3 4 1	1 0 年国債	500,000,000	509,525,000	
3 4 2	1 0 年国債	1,030,000,000	1,040,588,400	
3 4 3	1 0 年国債	780,000,000	788,252,400	
3 4 4	1 0 年国債	820,000,000	828,888,800	
3 4 5	1 0 年国債	830,000,000	839,428,800	
3 4 6	1 0 年国債	700,000,000	708,106,000	
3 4 7	1 0 年国債	500,000,000	506,045,000	
3 4 8	1 0 年国債	500,000,000	506,140,000	
3 4 9	1 0 年国債	1,050,000,000	1,063,062,000	
3 5 0	1 0 年国債	500,000,000	506,285,000	
3 5 1	1 0 年国債	800,000,000	810,152,000	
3 5 2	1 0 年国債	750,000,000	759,577,500	
3 5 3	1 0 年国債	580,000,000	587,221,000	
3 5 4	1 0 年国債	600,000,000	607,242,000	
3 5 5	1 0 年国債	690,000,000	698,038,500	
3 5 6	1 0 年国債	510,000,000	515,487,600	
3 5 7	1 0 年国債	620,000,000	626,342,600	
3 5 8	1 0 年国債	660,000,000	666,362,400	
3 5 9	1 0 年国債	980,000,000	988,379,000	

360	10年国債	980,000,000	987,702,800
361	10年国債	633,000,000	637,196,790
362	10年国債	694,000,000	697,705,960
1	30年国債	16,000,000	19,734,400
2	30年国債	24,000,000	29,038,560
3	30年国債	30,000,000	36,174,900
4	30年国債	36,000,000	45,758,520
5	30年国債	28,000,000	33,962,600
6	30年国債	24,000,000	29,805,600
7	30年国債	55,000,000	68,224,750
8	30年国債	27,000,000	32,189,400
9	30年国債	43,000,000	49,333,900
10	30年国債	45,000,000	50,113,350
11	30年国債	40,000,000	47,454,800
12	30年国債	60,000,000	74,222,400
13	30年国債	75,000,000	92,097,000
14	30年国債	82,000,000	105,097,760
15	30年国債	50,000,000	64,912,000
16	30年国債	250,000,000	325,762,500
17	30年国債	130,000,000	168,181,000
18	30年国債	80,000,000	102,701,600
19	30年国債	57,000,000	73,413,720
21	30年国債	60,000,000	77,714,400
22	30年国債	170,000,000	225,566,200
24	30年国債	92,000,000	122,794,240
25	30年国債	150,000,000	196,212,000
26	30年国債	180,000,000	238,674,600
27	30年国債	150,000,000	202,269,000
28	30年国債	170,000,000	230,227,600
29	30年国債	200,000,000	268,714,000
30	30年国債	220,000,000	292,949,800
31	30年国債	300,000,000	395,607,000
32	30年国債	285,000,000	382,492,800
33	30年国債	280,000,000	361,740,400
34	30年国債	270,000,000	360,312,300
35	30年国債	250,000,000	324,975,000
36	30年国債	310,000,000	404,292,700
37	30年国債	320,000,000	412,444,800
38	30年国債	200,000,000	254,264,000

39	30年国債	230,000,000	297,684,400	
40	30年国債	180,000,000	229,404,600	
41	30年国債	170,000,000	213,436,700	
42	30年国債	205,000,000	257,635,800	
43	30年国債	200,000,000	251,604,000	
44	30年国債	200,000,000	251,850,000	
45	30年国債	200,000,000	243,100,000	
46	30年国債	140,000,000	170,272,200	
47	30年国債	400,000,000	495,916,000	
48	30年国債	130,000,000	155,483,900	
49	30年国債	120,000,000	143,582,400	
50	30年国債	200,000,000	211,586,000	
51	30年国債	240,000,000	225,813,600	
52	30年国債	260,000,000	256,547,200	
53	30年国債	250,000,000	252,230,000	
54	30年国債	310,000,000	327,115,100	
55	30年国債	260,000,000	274,164,800	
56	30年国債	140,000,000	147,354,200	
57	30年国債	230,000,000	241,904,800	
58	30年国債	370,000,000	388,855,200	
59	30年国債	200,000,000	204,886,000	
60	30年国債	210,000,000	225,288,000	
61	30年国債	200,000,000	204,240,000	
62	30年国債	200,000,000	193,628,000	
63	30年国債	230,000,000	216,372,500	
64	30年国債	220,000,000	206,619,600	
65	30年国債	200,000,000	187,520,000	
66	30年国債	235,000,000	219,964,700	
67	30年国債	230,000,000	226,639,700	
68	30年国債	200,000,000	196,814,000	
69	30年国債	259,000,000	261,558,920	
70	30年国債	205,000,000	206,525,200	
58	20年国債	200,000,000	205,110,000	
59	20年国債	45,000,000	46,240,650	
60	20年国債	10,000,000	10,230,200	
61	20年国債	100,000,000	101,983,000	
62	20年国債	95,000,000	96,770,800	
63	20年国債	130,000,000	135,044,000	
64	20年国債	90,000,000	94,146,300	

6 5	2 0 年国債	175,000,000	183,953,000	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	193,998,400	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	58,091,000	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	127,741,200	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	116,791,400	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	89,347,010	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	133,803,750	
7 2	2 0 年国債	105,000,000	112,672,350	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	129,018,000	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	78,743,640	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	86,738,400	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	54,910,680	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	140,458,500	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	65,992,240	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	54,294,000	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	57,765,230	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	95,296,320	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	102,342,780	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	64,131,760	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	89,223,200	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	61,077,500	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	112,143,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	87,078,420	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	22,439,600	
9 1	2 0 年国債	60,000,000	67,636,200	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	347,897,500	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	112,163,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	146,564,600	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	57,256,500	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	62,317,200	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	45,783,600	
9 8	2 0 年国債	320,000,000	364,252,800	
9 9	2 0 年国債	100,000,000	114,346,000	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	179,076,150	
1 0 1	2 0 年国債	350,000,000	409,122,000	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	198,526,000	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	11,537,000	
1 0 5	2 0 年国債	126,000,000	146,012,580	
1 0 6	2 0 年国債	150,000,000	174,919,500	

107	20年国債	90,000,000	104,708,700	
108	20年国債	300,000,000	344,502,000	
109	20年国債	55,000,000	63,378,150	
110	20年国債	260,000,000	303,659,200	
111	20年国債	200,000,000	236,098,000	
112	20年国債	150,000,000	175,867,500	
113	20年国債	310,000,000	364,693,300	
114	20年国債	70,000,000	82,653,200	
115	20年国債	180,000,000	214,072,200	
116	20年国債	200,000,000	238,748,000	
117	20年国債	200,000,000	236,994,000	
118	20年国債	95,000,000	112,069,600	
119	20年国債	93,000,000	108,035,310	
120	20年国債	317,000,000	362,540,220	
121	20年国債	200,000,000	234,872,000	
122	20年国債	200,000,000	233,022,000	
123	20年国債	200,000,000	239,382,000	
124	20年国債	300,000,000	356,226,000	
125	20年国債	130,000,000	157,296,100	
126	20年国債	110,000,000	130,958,300	
127	20年国債	250,000,000	295,200,000	
128	20年国債	250,000,000	296,070,000	
129	20年国債	100,000,000	117,431,000	
130	20年国債	140,000,000	164,847,200	
131	20年国債	150,000,000	175,092,000	
132	20年国債	40,000,000	46,803,600	
133	20年国債	430,000,000	507,627,900	
134	20年国債	130,000,000	153,851,100	
135	20年国債	92,000,000	107,897,600	
136	20年国債	180,000,000	209,183,400	
138	20年国債	100,000,000	115,373,000	
139	20年国債	370,000,000	430,913,100	
140	20年国債	400,000,000	471,540,000	
141	20年国債	200,000,000	236,284,000	
142	20年国債	240,000,000	286,272,000	
143	20年国債	210,000,000	246,178,800	
144	20年国債	240,000,000	278,563,200	
145	20年国債	420,000,000	498,275,400	
146	20年国債	280,000,000	332,861,200	

147	20年国債	300,000,000	353,643,000	
148	20年国債	380,000,000	443,942,600	
149	20年国債	402,000,000	470,356,080	
150	20年国債	180,000,000	208,580,400	
151	20年国債	330,000,000	374,154,000	
152	20年国債	380,000,000	431,170,800	
153	20年国債	430,000,000	494,461,300	
154	20年国債	550,000,000	625,399,500	
155	20年国債	350,000,000	388,391,500	
156	20年国債	200,000,000	204,560,000	
157	20年国債	300,000,000	297,612,000	
158	20年国債	400,000,000	414,092,000	
159	20年国債	280,000,000	293,974,800	
160	20年国債	360,000,000	383,108,400	
161	20年国債	320,000,000	335,433,600	
162	20年国債	350,000,000	366,565,500	
163	20年国債	290,000,000	303,447,300	
164	20年国債	390,000,000	401,165,700	
165	20年国債	300,000,000	308,214,000	
166	20年国債	350,000,000	370,846,000	
167	20年国債	300,000,000	307,425,000	
168	20年国債	320,000,000	321,865,600	
169	20年国債	300,000,000	295,953,000	
170	20年国債	190,000,000	187,083,500	
171	20年国債	300,000,000	294,828,000	
172	20年国債	100,000,000	99,912,000	
173	20年国債	410,000,000	408,913,500	
174	20年国債	320,000,000	318,857,600	
175	20年国債	430,000,000	435,809,300	
176	20年国債	200,000,000	202,548,000	
27	メキシコ国債	100,000,000	99,254,400	
11	フィリピン共和国	100,000,000	102,153,400	
国債証券 合計			81,001,185,060	
地方債証券	713	東京都公債	100,000,000	100,968,200
	751	東京都公債	100,000,000	101,683,300
	16	東京都20年	100,000,000	114,889,400
	24-6	北海道公債	100,000,000	101,000,000
	222	神奈川県公債	100,000,000	100,291,100
	31	神奈川県20年	100,000,000	110,085,900

4 2 0	大阪府公債	200,000,000	201,663,200	
2 4 - 5	京都府公債	100,000,000	101,028,900	
2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	101,653,700	
3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	204,213,600	
1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	116,276,900	
2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	101,763,700	
2 1 - 5	愛知県公債	100,000,000	117,874,400	
2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	101,225,200	
2 9 - 5	広島県公債	100,000,000	101,492,800	
4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	115,927,200	
2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	101,144,600	
2 2 - 1	福岡県 1 5 年	100,000,000	107,397,900	
1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	116,676,900	
2 8 - 2	新潟県公債	100,000,000	100,988,500	
1 1 7	共同発行地方	100,000,000	101,079,200	
1 2 6	共同発行地方	100,000,000	101,857,900	
1 3 1	共同発行地方	100,000,000	101,789,200	
1 6 8	共同発行地方	100,000,000	101,154,400	
2 7 - 1	滋賀県公債	100,000,000	102,114,600	
2 5 - 6	大阪市公債	200,000,000	203,419,000	
1 1	名古屋市 2 0 年	100,000,000	117,483,000	
2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	116,330,800	
2 4 - 1 0	神戸市公債	100,000,000	101,068,300	
2 4 - 3	横浜市公債	100,000,000	101,099,100	
4	川崎市公債 3 0 年	100,000,000	131,082,000	
2 3 - 4	福岡市 2 0 年	100,000,000	117,900,900	
2 4 - 4	福井県公債	100,000,000	100,844,000	
地方債証券 合計			3,815,467,800	
特殊債券	4 7	日本政策投資 C O	100,000,000	107,643,600
	1 9	政保政策投資 C	100,000,000	101,120,400
	2 4 7	道路機構	200,000,000	195,657,600
	8 6	政保道路機構	100,000,000	115,918,600
	1 6 8	政保道路機構	100,000,000	100,921,800
	1 7 3	政保道路機構	100,000,000	101,038,100
	1 7 5	政保道路機構	100,000,000	101,058,000
	1 8 6	政保道路機構	100,000,000	101,120,200
	1 9 0	政保道路機構	100,000,000	101,137,500
	2 2 3	政保道路機構	100,000,000	115,280,700
	2 3 6	政保道路機構	100,000,000	101,102,900



	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	203,313,000	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	195,243,000	
	2 9 8 政保道路機構	100,000,000	103,358,700	
	3 9 政保地方公共団	100,000,000	100,911,100	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	108,158,400	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	108,511,700	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	101,567,000	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	101,856,300	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	118,007,600	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,791,800	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	101,779,900	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	101,343,300	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	100,293,700	
	1 9 利付商工債	100,000,000	100,041,300	
特殊債券 合計			2,888,176,200	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,203,500	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	102,420,200	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	101,873,300	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	100,954,500	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	102,156,200	
	5 野村不動産HD	100,000,000	102,825,200	
	2 3 森ビル	100,000,000	102,320,000	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,499,000	
	4 JXホールディングス	100,000,000	101,658,000	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,431,300	
	1 5 デンソー	100,000,000	100,685,500	
	7 凸版印刷	100,000,000	107,182,500	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	101,751,600	
	1 6 NTTファイナンス	100,000,000	100,368,300	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,804,100	
	1 7 5 オリックス	100,000,000	102,390,000	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	106,932,500	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	115,925,200	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	115,310,500	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	101,740,900	
	3 7 2 中国電力	100,000,000	101,398,700	
	4 8 2 九州電力	100,000,000	100,421,700	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	105,398,000	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	102,341,400	

	30 大阪瓦斯	100,000,000	101,108,600	
	4 ファーストリテイリング	100,000,000	102,978,300	
社債券	合計		2,683,079,000	
合計			90,387,908,060	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	46,445,254	48,894,787
親投資信託受益証券	22,280,531,520	8,156,375,483
未収入金	-	21,672,582
流動資産合計	22,326,976,774	8,226,942,852
資産合計	22,326,976,774	8,226,942,852
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	21,054,386
未払受託者報酬	1,375,393	1,315,571
未払委託者報酬	24,757,879	23,681,173
その他未払費用	515,805	493,266
流動負債合計	26,649,077	46,544,396
負債合計	26,649,077	46,544,396
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 20,288,495,945	1 7,628,232,231
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,011,831,752	552,166,225
（分配準備積立金）	321,279,837	179,840,741
元本等合計	22,300,327,697	8,180,398,456
純資産合計	22,300,327,697	8,180,398,456
負債純資産合計	22,326,976,774	8,226,942,852

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年6月18日 至 2020年6月15日		自 2020年6月16日 至 2021年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		55		74
有価証券売買等損益		386,053,552		234,243,536
<b>営業収益合計</b>		<b>386,053,607</b>		<b>234,243,462</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,962		9,909
受託者報酬		2,281,657		2,864,963
委託者報酬		41,071,404		51,571,012
その他費用		859,143		1,074,361
<b>営業費用合計</b>		<b>44,221,166</b>		<b>55,520,245</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>341,832,441</b>		<b>289,763,707</b>
経常利益又は経常損失（ ）		341,832,441		289,763,707
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>341,832,441</b>		<b>289,763,707</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（ ）		49,895,512		115,745,209
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>511,941,034</b>		<b>2,011,831,752</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,544,245,353		721,236,643
<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>2,544,245,353</b>		<b>721,236,643</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,336,291,564		2,006,883,672
<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>1,336,291,564</b>		<b>2,006,883,672</b>
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>2,011,831,752</b>		<b>552,166,225</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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	12,238,138,887円	20,288,495,945円
期中追加設定元本額	31,728,087,266円	7,679,681,362円
期中一部解約元本額	23,677,730,208円	20,339,945,076円
2. 計算期間末日における受益権の総数	20,288,495,945口	7,628,232,231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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(199,240,253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(92,696,676円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,690,551,915円)及び分配準備積立金(29,342,908円)より分配対象額は2,011,831,752円(1万口当たり991.61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(115,845,432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(532,061,344円)及び分配準備積立金(63,995,309円)より分配対象額は711,902,085円(1万口当たり933.25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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	323,631,353	147,861,510
合計	323,631,353	147,861,510

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日



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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0992円 (10,992円)	1.0724円 (10,724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	7,844,177,230	8,156,375,483	
親投資信託受益証券 合計			8,156,375,483	
合計			8,156,375,483	

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6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	744,081,788	585,273,779
コール・ローン	1,270,076,588	749,846,397
国債証券	111,031,651,188	116,454,613,580
派生商品評価勘定	248,659,459	134,796,464
未収利息	606,778,700	691,495,343
前払費用	92,992,972	29,810,030
差入委託証拠金	223,121,835	237,113,427
流動資産合計	114,217,362,530	118,882,949,020
資産合計	114,217,362,530	118,882,949,020
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	454,690,602	374,559,238
未払金	-	568,829,600
未払解約金	36,450,567	21,672,582
その他未払費用	3,204	-
流動負債合計	491,144,373	965,061,420
負債合計	491,144,373	965,061,420
純資産の部		
元本等		
元本	1 107,167,679,077	113,403,229,819
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,558,539,080	4,514,657,781
元本等合計	113,726,218,157	117,917,887,600
純資産合計	113,726,218,157	117,917,887,600
負債純資産合計	114,217,362,530	118,882,949,020

## 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6月16日 至 2021年6月15日
-----	------------------------------

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</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>国債証券</p> <p>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）、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。 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>(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>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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首 期首元本額	2019年6月18日 88,872,666,940円	2020年6月16日 107,167,679,077円

期中追加設定元本額	53,233,783,948円	34,627,106,696円
期中一部解約元本額	34,938,771,811円	28,391,555,954円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	82,592,446,809円	94,364,692,141円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	3,579,631,514円	4,709,710,877円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	- 円	3,285,353,528円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	- 円	3,199,296,043円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	20,995,600,754円	7,844,177,230円
計	107,167,679,077円	113,403,229,819円
2. 期末日における受益権の総数	107,167,679,077口	113,403,229,819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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	4,244,459,271	4,298,639,986
合計	4,244,459,271	4,298,639,986

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年6月18日から2020年6月15日まで、及び2020年6月16日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15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	112,349,851,437	-	112,555,882,580	206,031,143	116,938,071,741	-	117,178,715,915	240,644,174
アメリカ・ド ル	51,904,631,034	-	51,671,797,020	232,834,014	51,747,944,458	-	52,088,205,785	340,261,327
イギリス・ポ ンド	7,542,106,252	-	7,596,332,590	54,226,338	7,719,962,066	-	7,714,590,918	5,371,148
イスラエル ・シェケル	446,436,019	-	447,765,960	1,329,941	498,198,315	-	502,113,444	3,915,129
オーストラ リア・ドル	2,303,090,590	-	2,352,923,460	49,832,870	2,491,004,803	-	2,497,789,516	6,784,713
カナダ・ド ル	2,199,734,552	-	2,220,353,940	20,619,388	2,399,964,713	-	2,403,422,009	3,457,296
シンガポー ル・ドル	454,531,642	-	458,367,780	3,836,138	544,529,471	-	545,715,484	1,186,013
スウェーデ ン・クローナ	333,587,420	-	334,906,040	1,318,620	433,970,644	-	434,658,191	687,547
デンマーク・ クローネ	500,505,562	-	503,913,750	3,408,188	591,353,762	-	590,124,200	1,229,562
ノルウェー・ クローネ	173,462,217	-	173,155,360	306,857	219,958,872	-	221,197,040	1,238,168

ポーランド・ズロチ	598,471,230	-	603,246,000	4,774,770	746,507,359	-	736,314,451	10,192,908
マレーシア・リンギット	497,259,416	-	504,903,600	7,644,184	520,856,000	-	531,630,960	10,774,960
メキシコ・ペソ	775,416,428	-	759,897,840	15,518,588	891,123,406	-	896,401,917	5,278,511
ユーロ	44,620,619,075	-	44,928,319,240	307,700,165	48,132,697,872	-	48,016,552,000	116,145,872
買建	-	-	-	-	172,604,900	-	173,486,300	881,400
ユーロ	-	-	-	-	172,604,900	-	173,486,300	881,400
合計	112,349,851,437	-	112,555,882,580	206,031,143	117,110,676,641	-	117,352,202,215	239,762,774

(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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.0612円	1.0398円
(1万口当たり純資産額)	(10,612円)	(10,398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	34,000,000.000	34,727,600.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	11,000,000.000	11,339,020.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	15,520,000.000	15,993,360.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	11,310,000.000	11,876,744.100	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	13,905,000.000	14,754,456.450	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	15,000,000.000	16,000,050.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	9,580,000.000	10,195,515.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,300,000.000	3,734,280.000	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	7,450,000.000	9,800,177.000	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	800,000.000	1,038,312.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,700,000.000	3,474,549.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,975,526.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,534,054.100	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	830,000.000	1,023,680.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,934,111.100	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,966,850.000	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	3,279,083.100			
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,170,000.000	2,546,603.500			



2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	4,500,000.000	5,087,790.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,393,337.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,268,634.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,270,930.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	3,919,104.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,940,000.000	4,642,580.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	7,810,000.000	8,295,313.400	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	10,300,000.000	10,929,227.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	428,186.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	15,673,187.400	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	25,220,000.000	25,757,690.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	13,800,000.000	14,757,858.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,400,000.000	1,623,944.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	12,497,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	9,165,000.000	9,540,490.050	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	1,136,029.700	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,944,925.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	5,000,000.000	5,133,550.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,850,000.000	6,196,144.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,330,000.000	2,649,279.900	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,670,000.000	5,010,022.700	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,500,000.000	4,073,125.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	3,550,000.000	3,835,384.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,621,587.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	13,500,000.000	14,485,500.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	12,200,000.000	12,877,588.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,310,000.000	3,687,009.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	7,334,670.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	13,300,000.000	14,267,309.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,698,225.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	5,373,450.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,300,000.000	7,013,916.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,752,765.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,300,000.000	7,136,955.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	2,312,204.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	4,000,000.000	4,389,840.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	3,746,720.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	2,288,900.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,212,160.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	2,122,722.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	5,568,318.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,800,000.000	2,909,900.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,537,260.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	2,393,650.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	2,698,342.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	11,800,000.000	9,981,030.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	5,500,000.000	5,108,950.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,800,000.000	1,475,568.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	6,900,000.000	6,537,474.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	3,320,516.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	6,500,000.000	6,305,000.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	2,300,000.000	2,242,569.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	3,809,597.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,738,790.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,900,000.000	1,825,615.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,000,000.000	5,026,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	1,700,000.000	1,719,448.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	1,000,000.000	1,040,420.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 469,818,303.660 (51,731,693,416)	

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	1,451,020.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	960,000.000	1,394,121.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,175,000.000	1,244,137.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	251,307.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	950,000.000	998,117.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	720,000.000	784,353.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000	1,265,891.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	350,000.000	367,020.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	861,760.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	597,000.000	714,238.860	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	800,000.000	820,056.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000	889,648.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	934,141.500	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	600,000.000	609,576.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	400,000.000	400,508.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20230131	1,200,000.000	1,201,272.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	500,000.000	482,125.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	250,000.000	194,952.500	
	0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,219,608.000	

0.25% United Kingdom Gilt 20310731	500,000.000	470,675.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	750,000.000	685,170.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	513,000.000	715,942.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,300,000.000	1,760,733.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,503,161.250	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	1,312,814.550	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	950,000.000	1,494,882.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,568,241.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	1,270,199.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	2,000,000.000	2,482,020.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,474,234.860	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,240,679.550	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	843,000.000	1,446,765.030	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,702,717.900	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	430,536.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	407,000.000	758,253.210	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,531,470.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	1,149,078.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,080,000.000	2,123,721.600	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,175,000.000	1,637,104.000	

	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,490,000.000	2,611,138.500	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	908,900.000	1,679,056.410	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,500,000.000	1,625,535.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	490,000.000	714,714.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 49,472,698.920 (7,687,562,685)	
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	3,757,740.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,881,480.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	4,288,760.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,000,000.000	1,260,640.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,668,210.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	935,760.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 13,792,590.000 (467,886,031)	
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	1,193,195.250	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	1,090,074.020	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,156,000.000	1,245,139.160	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	370,627.200	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,000,000.000	3,331,110.000	

	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	473,495.870	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,817,841.840	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	906,960.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	896,248.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	805,731.480	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,449,162.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,158,000.000	1,254,287.700	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	575,000.000	649,991.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,398,950.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,200,000.000	1,238,676.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	2,310,756.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	557,384.100	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,810,458.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,200,000.000	1,166,604.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,800,000.000	3,664,264.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,000,000.000	865,060.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 29,496,016.620 (2,504,506,771)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	860,000.000	1,042,139.400	カナダ・ドル
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,219,216.610	カナダ・ドル

5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,528,716.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	770,000.000	1,054,230.100	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,500,000.000	1,536,765.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	740,000.000	972,959.400	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	4,038,000.000	4,130,752.860	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	730,000.000	773,070.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,100,000.000	1,292,104.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,584,996.360	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	820,000.000	845,584.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	930,725.400	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	636,636.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	2,400,000.000	2,459,712.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	324,087.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,048,410.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,442,504.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,688,814.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	890,694.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,200,000.000	1,105,236.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 26,507,352.130 (2,403,686,691)	
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	231,460.600	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	1,000,000.000	1,034,590.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	161,880.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	676,644.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	277,957.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	209,780.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	500,220.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	427,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	390,390.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	213,016.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	277,838.600	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	880,400.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	500,000.000	520,500.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	327,810.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	356,457.500	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 6,486,743.700 (538,334,860)	
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	3,688,196.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	6,950,000.000	7,206,802.500	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,332,309.500	

	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,236,503.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	5,061,542.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,669,595.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	3,138,450.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,921,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 32,254,399.000 (426,403,155)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	6,740,000.000	デンマーク・クローネ 11,842,719.200	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,803,713.600	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	4,330,000.000	4,756,591.600	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,460,988.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	4,941,580.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	1,600,000.000	1,476,768.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	1,000,000.000	993,020.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 32,275,380.400 (579,343,078)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,610,000.000	ノルウェー・クローネ 1,655,563.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,377,948.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	154,386.000	

	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,457,584.700	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,093,300.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,189,840.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,494,800.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,963,600.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 16,387,021.700 (216,636,427)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	1,200,000.000	1,285,752.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,813,580.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,938,910.050	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,108,840.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,900,000.000	3,063,647.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,508,495.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,726,956.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	789,420.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	770,861.200	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,959,660.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,230,000.000	4,626,731.700	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 24,592,852.950 (724,357,891)	

マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	マレーシア・リンギット 1,760,000.000	マレーシア・リンギット 1,921,708.800	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	500,000.000	532,670.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,325,150.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,000,000.000	1,013,410.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,571,370.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,217,033.500	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,128,105.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,600,000.000	1,658,784.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,500,244.200	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,108,120.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,082,070.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,597,725.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,261,260.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,301,027.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	700,000.000	663,264.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	900,000.000	866,574.000		
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 20,748,515.500 (555,350,616)		
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	メキシコ・ペソ 9,200,000.000	メキシコ・ペソ 9,100,088.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	12,242,569.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	27,900,000.000	29,834,307.000	

	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	7,169,338.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	7,200,591.600	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	11,800,000.000	12,546,350.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,503,170.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	7,318,285.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,609,500.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	24,528,485.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	15,900,000.000	16,173,480.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	9,750,000.000	10,178,415.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	11,042,424.000	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 156,447,002.600 (863,211,982)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	690,000.000	744,613.500	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	849,664.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	189,061.200	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	328,776.300	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	211,404.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	168,456.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,010.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	316,974.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	150,000.000	146,593.500	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	145,497.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	174,618.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	140,000.000	150,816.400	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	522,340.000	

1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	146,725.200	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	365,134.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	1,054,120.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	150,000.000	246,643.500	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	643,320.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	738,738.000	
Austria Government Bond 20300220	150,000.000	151,521.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	616,668.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,170,000.000	1,235,028.600	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	610,000.000	749,317.900	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	639,690.450	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	764,000.000	900,175.360	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	570,000.000	794,813.700	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	408,104.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	782,414.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	519,080.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	430,735.700	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	700,000.000	807,023.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	580,000.000	624,335.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	564,200.000	

0.9% Belgium Government Bond 20290622	700,000.000	759,815.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	421,648.500	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	913,851.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	200,000.000	192,148.000	
Belgium Government Bond 20271022	800,000.000	817,104.000	
Belgium Government Bond 20311022	500,000.000	495,545.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	654,503.850	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,131,888.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	1,103,600.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	3,696,000.000	5,851,211.520	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,609,188.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	5,390,529.600	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	990,000.000	1,612,452.600	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	720,000.000	1,268,208.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	3,426,438.600	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	356,000.000	589,315.280	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,581,644.820	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,648,000.000	2,524,192.160	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,192,596.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,546,709.400	

1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	3,800,000.000	4,053,080.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,625,000.000	2,537,632.500	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,054,795.500	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,109,940.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,243,062.100	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	4,300,000.000	4,604,268.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	931,035.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,050,000.000	2,115,251.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	550,000.000	576,174.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	3,302,523.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,260,000.000	1,584,903.600	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	750,000.000	801,225.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	1,999,199.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,400,000.000	1,473,500.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,300,000.000	1,190,150.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	721,119.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	300,000.000	308,391.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	369,980.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	1,800,000.000	1,816,380.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	1,650,000.000	1,671,301.500	



GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,016,980.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	509,950.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,415,000.000	4,402,583.850	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,000,000.000	3,271,720.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,210,000.000	3,549,569.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	2,323,071.520	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,691,997.450	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,339,836.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,943,000.000	3,370,910.700	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,968,330.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,540,000.000	4,232,317.800	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,410,000.000	4,087,055.500	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	195,000.000	202,801.950	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	840,000.000	1,307,031.600	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,730,000.000	4,951,837.000	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,000,000.000	3,255,450.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,986,000.000	2,441,469.240	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,360,000.000	3,632,664.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,400,000.000	3,540,216.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,650,000.000	3,031,494.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,800,000.000	2,933,728.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,350,000.000	1,513,444.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,100,000.000	1,377,508.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,570,000.000	1,625,986.200	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,800,000.000	2,183,958.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,513,708.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,800,000.000	2,308,320.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,800,000.000	1,820,862.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	2,000,000.000	2,139,860.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	2,017,314.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,945,470.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,200,000.000	2,237,554.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,200,000.000	1,388,220.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,100,000.000	3,256,798.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	3,400,000.000	3,421,930.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	700,000.000	664,692.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	800,000.000	783,688.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,200,000.000	2,195,578.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	100,000.000	76,689.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	400,000.000	381,748.000	

5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	809,598.800	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,200,000.000	1,928,172.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,253,561.400	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,080,000.000	1,853,236.800	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	500,000.000	515,960.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	290,000.000	376,373.600	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	788,910.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	840,000.000	1,351,257.600	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	980,000.000	1,061,869.200	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	714,909.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,170,000.000	1,232,946.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,470,000.000	1,578,941.700	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	407,392.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	648,114.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	729,897.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	263,415.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	762,877.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	356,176.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	400,000.000	404,184.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,300,000.000	1,798,225.000	

6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,635,000.000	2,276,933.700	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	3,100,000.000	3,386,843.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,105,000.000	1,466,721.750	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	978,686.800	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,626,045.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	981,702.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	800,000.000	818,808.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,200,000.000	1,456,200.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,200,000.000	1,228,332.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,150,000.000	2,466,136.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	2,400,000.000	2,456,064.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	1,300,000.000	1,573,819.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,519,960.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,900,311.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	650,000.000	894,575.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,719,880.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	710,703.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,500,000.000	2,775,600.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,400,000.000	1,643,698.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,445,925.000	

3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	500,000.000	642,300.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	800,000.000	1,179,432.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	400,000.000	479,196.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	900,000.000	992,610.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	531,905.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,600,000.000	2,668,822.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	600,000.000	632,442.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,100,000.000	1,082,235.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	250,000.000	250,302.500	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,540,000.000	2,135,995.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,988,000.000	2,989,494.760	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,534,790.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	2,446,933.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,764,690.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,600,154.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	3,870,000.000	4,293,958.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,400,000.000	2,858,880.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,014,000.000	3,222,762.520	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	3,939,520.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	500,000.000	535,955.000	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	3,170,000.000	3,428,925.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,080,000.000	1,413,298.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	725,000.000	1,170,875.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,030,000.000	2,293,514.300	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,379,172.700	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,708,622.900	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,402,420.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	1,229,407.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	815,000.000	1,367,341.800	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	870,569.000	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	776,705.400	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	427,209.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,059,640.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	647,068.500	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	879,088.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	405,411.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	841,272.640	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	453,436.200	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	300,000.000	332,988.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	826,669.200	
2% IRISH TREASURY 20450218	710,000.000	908,558.600	
1% IRISH TREASURY 20260515	820,000.000	877,629.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	677,587.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	538,345.000	

1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	168,711.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	1,238,710.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	328,119.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	250,000.000	289,607.500	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	536,149.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	700,000.000	1,121,155.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	881,790.000	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	910,327.200	
3.8% Austria Government Bond 20620126	370,000.000	768,001.600	
3.15% Austria Government Bond 20440620	630,000.000	1,001,851.200	
1.75% Austria Government Bond 20231020	1,280,000.000	1,352,512.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	811,433.700	
1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	947,848.000	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	237,854.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	146,404.800	
1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,008,390.600	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	304,875.900	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	376,827.500	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	2,061,996.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,100,000.000	2,264,997.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,410,000.000	1,624,179.000	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,565,000.000	2,849,355.900	

1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,000,000.000	1,110,090.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	589,000.000	799,108.080	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,530,000.000	2,375,248.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,649,000.000	1,786,345.210	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,100,000.000	1,208,306.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,593,411.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,670,000.000	1,833,125.600	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,150,000.000	2,358,141.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	550,000.000	724,559.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	500,000.000	552,185.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,200,000.000	1,376,244.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,200,000.000	1,241,628.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	1,022,020.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,200,000.000	1,303,860.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	500,000.000	509,865.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	300,000.000	291,675.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,480,000.000	2,330,023.200	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	1,348,002.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	900,000.000	1,514,655.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,243,000.000	2,064,038.790	



	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,318,360.000	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	3,810,000.000	4,181,360.700	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	2,188,000.000	2,447,562.440	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,300,000.000	1,789,424.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,090,000.000	1,978,469.900	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,700,000.000	3,035,583.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,312,239.680	
	ユーロ 小計		ユーロ 357,854,177.420 (47,755,639,977)	
国債証券 合計			116,454,613,580 [116,454,613,580]	
合計			116,454,613,580 [116,454,613,580]	

- (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 76銘柄	100%	44.3%
イギリス・ポンド	国債証券 43銘柄	100%	6.6%
イスラエル・シェケル	国債証券 6銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券 20銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 246銘柄	100%	41.0%

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。

**【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2020年6月16日から2021年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,946,818	39,236,187
親投資信託受益証券	55,620,673	5,554,305,058
未収入金	-	8,511,409
流動資産合計	62,567,491	5,602,052,654
資産合計	62,567,491	5,602,052,654
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	-	9,851,410
未払解約金	-	8,328,959
未払受託者報酬	356,069	681,894
未払委託者報酬	6,410,037	12,274,871
その他未払費用	133,475	255,630
流動負債合計	6,899,581	31,392,764
負債合計	6,899,581	31,392,764
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 51,714,565	1 4,925,705,481
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,953,345	644,954,409
(分配準備積立金)	695,882	157,900,065
元本等合計	55,667,910	5,570,659,890
純資産合計	55,667,910	5,570,659,890
負債純資産合計	62,567,491	5,602,052,654

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		12		22
有価証券売買等損益		72,485,217		260,824,657
<b>営業収益合計</b>		<b>72,485,229</b>		<b>260,824,679</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,954		5,091
受託者報酬		565,771		1,607,985
委託者報酬		10,185,476		28,945,570
その他費用		212,624		602,894
<b>営業費用合計</b>		<b>10,965,825</b>		<b>31,161,540</b>
<b>営業利益</b>		<b>61,519,404</b>		<b>229,663,139</b>
経常利益		61,519,404		229,663,139
<b>当期純利益</b>		<b>61,519,404</b>		<b>229,663,139</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		60,823,525		62,083,496
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		198,253		3,953,345
剰余金増加額又は欠損金減少額		419,235,727		1,528,553,142
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		419,235,727		1,528,553,142
剰余金減少額又は欠損金増加額		416,176,514		1,045,280,311
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		416,176,514		1,045,280,311
分配金		1 -		1 9,851,410
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>3,953,345</b>		<b>644,954,409</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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	10,803,922円	51,714,565円
期中追加設定元本額	9,243,518,976円	15,970,263,749円
期中一部解約元本額	9,202,608,333円	11,096,272,833円
2. 計算期間末日における受益権の総数	51,714,565口	4,925,705,481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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(76,510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(619,369円)、投資信託約款に規定される収益調整金(14,101,555円)及び分配準備積立金(3円)より分配対象額は14,797,437円(1万口当たり2,861.37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(90,583,513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(76,996,130円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,433,152,474円)及び分配準備積立金(171,832円)より分配対象額は1,600,903,949円(1万口当たり3,250.10円)であり、うち9,851,410円(1万口当たり20円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	732,260	181,975,362
合計	732,260	181,975,362

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日



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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0764円 (10,764円)	1.1309円 (11,309円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	1,775,786,514	5,554,305,058	
親投資信託受益証券 合計			5,554,305,058	
合計			5,554,305,058	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	667,928,965	495,178,014
コール・ローン	1,364,247,470	727,158,621
国債証券	191,001,914,387	223,326,922,595
派生商品評価勘定	8,190,994	705,830
未収入金	4,734,146	160,203
未収利息	1,112,578,983	1,188,153,611
前払費用	59,451,596	28,576,492
流動資産合計	194,219,046,541	225,766,855,366
資産合計	194,219,046,541	225,766,855,366
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,577,610	1,289,310
未払金	-	867,453
未払解約金	41,862,143	97,105,815
その他未払費用	4,053	-
流動負債合計	43,443,806	99,262,578
負債合計	43,443,806	99,262,578
純資産の部		
元本等		
元本	1 65,627,347,601	72,148,022,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	128,548,255,134	153,519,569,877
元本等合計	194,175,602,735	225,667,592,788
純資産合計	194,175,602,735	225,667,592,788
負債純資産合計	194,219,046,541	225,766,855,366

## 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6月16日 至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	62,737,394,108円	65,627,347,601円
期中追加設定元本額	10,608,003,880円	14,118,327,282円
期中一部解約元本額	7,718,050,387円	7,597,651,972円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワ外国債券インデックス V A	621,076,448円	520,301,299円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	17,810,994円	10,818,215円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	110,163,708円	93,079,264円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,499,022円	26,042,029円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	357,989,526円	319,990,353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)	61,380,663円	149,602,778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)	461,248,869円	498,273,800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)	1,671,366,657円	2,120,293,437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 エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	636,150,174円	806,617,119円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,079,976円	956,364円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	813,493円	3,755,226円
iFree 外国債券イン デックス	639,249,370円	1,267,378,990円
iFree 8資産バランス	817,834,455円	1,236,583,986円
iFree 年金バランス	32,559,558円	154,784,016円
DCダイワ外国債券インデッ クス	46,802,673,697円	49,189,194,680円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	779,403,095円	888,919,026円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	408,565,954円	529,456,334円

ダイワ・ライフ・バランス70	245,441,653円	334,179,542円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	395,428,004円	533,645,825円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	314,331,404円	401,196,099円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	99,746,809円	144,040,694円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	9,276,813円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	20,253,456円	24,114,337円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,169,007円	7,629,219円
ダイワつみたてインデックス外国債券	124,719,051円	319,659,293円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,010,075円	3,234,798円
ダイワつみたてインデックスバランス50	818,648円	1,161,957円
ダイワつみたてインデックスバランス70	812,361円	1,283,180円
ダイワ世界バランスファンド40VA	188,609,451円	171,725,827円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,649,195円	136,407,366円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,342,555,265円	4,143,757,488円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	264,162,108円	245,616,231円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	145,125,587円	144,867,150円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	30,410,471円	36,827,523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)	18,798,389円	1,775,786,514円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,724,174,641円	5,792,216,256円
ダイワライフスタイル25	32,344,719円	33,312,755円

	ダイワライフスタイル50	59,827,227円	63,756,331円
	ダイワライフスタイル75	14,817,608円	17,557,610円
計		65,627,347,601円	72,148,022,911円
2.	期末日における受益権の総数	65,627,347,601口	72,148,022,911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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	5,887,464,880	9,068,971,566
合計	5,887,464,880	9,068,971,566

(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6月15日まで、及び2020年12月1日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	1,598,279,906	-	1,604,893,290	6,613,384	776,940,680	-	776,357,200	583,480
アメリカ・ドル	255,154,838	-	255,281,000	126,162	287,813,070	-	288,428,722	615,652
イギリス・ポ ンド	45,297,247	-	45,464,340	167,093	10,565,595	-	10,564,976	619
オーストラ リア・ドル	26,012,160	-	26,439,200	427,040	20,163,888	-	20,120,991	42,897
カナダ・ドル	38,659,303	-	38,923,670	264,367	-	-	-	-
シンガポ ール・ドル	20,422,136	-	20,590,440	168,304	-	-	-	-

スウェーデン・クロナ	24,137,565	-	24,532,760	395,195	22,289,608	-	22,200,024	89,584
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	6,502,158	-	6,479,950	22,208
ノルウェー・クローネ	10,795,217	-	10,871,980	76,763	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	59,912,376	-	59,017,740	894,636	-	-	-	-
ユーロ	1,117,889,064	-	1,123,772,160	5,883,096	429,606,361	-	428,562,537	1,043,824
合計	1,598,279,906	-	1,604,893,290	6,613,384	776,940,680	-	776,357,200	583,480

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.9588円	3.1278円
(1万口当たり純資産額)	(29,588円)	(31,278円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
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 20220815	2,543,000.000	2,588,875.720	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,810,695.200	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,484,067.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,827,892.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,796,902.480	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,327,732.890	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,577,617.430	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,227,596.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	740,066.400	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,063,004.400	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	932,661.140	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	908,523.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	949,710.060	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,007,518.260	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,245,949.870	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,596,325.920	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,221,196.130			
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	744,934.760			

4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	715,913.790	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,293,784.150	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,512,733.450	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,474,142.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,659,769.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,429,150.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,310,320.740	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,412,244.950	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,994,960.760	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,811,440.620	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,887,535.650	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,939,029.400	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,699,661.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,904,671.650	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,557,316.530	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,471,702.590	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,804,458.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,085,234.880	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,598,164.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,071,077.380	

3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,686,425.330	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,202,965.510	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,074,643.440	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,556,984.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,272,979.280	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,288,930.940	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,171,932.060	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,059,496.730	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,719,061.070	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,141,588.920	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,280,832.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,349,205.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,881,143.720	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,079,000.000	3,145,721.930	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,073,624.510	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	3,824,138.750	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,497,616.400	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,524,703.040	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,245,354.400	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	764,413.640	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,620,236.140	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,459,892.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,146,003.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	5,067,647.040	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,628,507.960	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,342,042.720	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,031,073.840	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,711,147.590	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	8,045,657.130	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,127,152.700	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,997,207.330	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,570,975.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,074,040.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,583,060.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,524,300.400	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,843,523.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,462,904.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,571,908.550	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,613,601.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,583,575.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,705,545.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,606,034.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,627,325.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,905,028.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,610,200.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,125,493.750	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,416,702.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,783,324.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,914,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,330,300.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,146,010.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,048,270.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,562,509.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,052,260.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,521,488.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,330,700.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,958,609.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,166,620.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	3,842,955.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,259,232.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,095,620.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,557,300.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,641,875.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,564,925.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,900,455.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,899,070.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,716,265.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,386,368.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,978,276.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,627,680.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	7,015,480.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,440,349.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,789,098.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,923,695.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,434,562.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,022,322.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,129,941.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,015,220.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,236,580.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,621,575.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,071,000.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,873,653.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,626,650.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,625,075.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,261,540.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,060,672.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,465,207.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	4,931,112.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,732,600.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,803,328.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,921,156.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,750,675.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,183,630.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,754,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,252,000.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,191,545.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,649,276.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,292,590.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,129,920.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,803,240.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,650,975.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,243,236.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,235,440.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,718,250.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,502,995.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,705,175.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,487,275.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,677,225.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,321,692.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,210,323.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,695,090.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,016,104.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,558,555.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,196,170.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,650,220.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,948,512.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,072,400.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,739,965.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,633,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,807,019.000	



1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,557,680.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,649,772.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,877,756.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,112,480.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,052,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,599,200.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,108,960.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,948,923.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,036,480.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,118,470.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,032,344.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,676,625.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,078,820.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,110,010.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,067,830.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,616,100.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,613,475.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,087,160.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,754,043.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,296,575.000	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,041,400.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,304,000.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,170,284.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	303,222.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,318,612.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,226,712.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,498,935.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,206,112.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,570,864.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,269,834.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,498,215.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,682,693.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,336,040.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,444,328.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,229,250.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	500,270.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,399,235.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,962,950.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,509,625.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,502,860.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,399,800.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,394,720.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,940.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,350,428.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,501,890.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	798,968.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,289,000.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,804,650.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,492,392.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,058,240.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,383,625.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	3,001,380.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,996,780.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,391,320.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	3,000,930.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,830,600.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,445,295.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,191,768.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	3,000,000.000	3,002,460.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,285,108.000	

0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,500,945.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,928,560.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,853,560.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	5,941,976.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,490,550.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	3,000,450.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	5,031,660.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,850,000.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,992,140.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,842,350.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	985,420.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,700,051.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,987,160.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,825,210.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,482,103.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,347,970.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,982,800.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,999,840.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,921,050.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,992,350.000	

	1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,515,995.000	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,967,300.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,999,600.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,998,200.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,998,920.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,000,000.000	5,026,350.000	
	0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,999,840.000	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	3,006,420.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	2,500,000.000	2,528,600.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,090,208.000	
	0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,496,805.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,398,266.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	6,026,700.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	600,000.000	624,252.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 899,132,161.180 (99,003,442,268)	
イギリス・ポ ンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,621,000.000	1,742,299.430	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,442,617.220	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,551,200.600	

0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,332,133.600	
1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,038,261.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,560,043.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,082,966.100	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,478,568.300	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,043,920.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,615,800.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	770,000.000	921,212.600	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,845,126.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,234,386.600	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	934,141.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	812,768.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,644,096.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,191,511.300	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,302,438.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,217,775.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	584,857.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,487,775.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,557,520.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	926,453.000	

0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,219,608.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,299,558.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	600,000.000	564,810.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	456,780.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	99,840.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	297,600.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,324,424.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,492,114.400	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,735,414.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,384,587.740	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,135,320.920	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,520,240.920	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,253,367.260	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,528,924.320	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	3,909,716.160	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,501,866.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,304,870.030	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,178,876.180	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,238,787.200	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,187,197.220	

	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,415,128.190	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,547,670.080	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,289,126.840	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,017,844.480	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,658,964.300	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	2,929,897.100	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,183,389.480	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,924,000.000	2,806,346.400	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 95,030,139.970 (14,766,733,450)	
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	2,595,100.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,932,552.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	2,979,010.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,194,620.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,422,452.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,929,942.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,016,880.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,025,536.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,961,586.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,547,685.000	



	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,007,600.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,864,470.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,100,000.000	1,102,948.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,590,792.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	1,997,680.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 29,168,853.000 (989,495,000)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,162,000.000	1,234,520.420	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,268,000.000	2,498,769.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,438,872.020	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,125,138.030	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,668,515.840	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,498,000.000	2,773,704.260	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,659,213.940	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,748,000.000	3,229,119.840	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,392,340.740	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,464,245.170	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	932,952.240	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	2,978,585.280	

	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,275,950.700	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,415,285.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	2,014,488.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,909,625.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,130,622.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	3,370,000.000	3,708,213.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,519,144.900	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,856,500.400	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,263,821.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,400,648.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,500,000.000	3,374,980.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,211,084.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,900,000.000	1,878,302.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,382,775.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,187,856.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,120,988.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 57,046,261.320 (4,843,798,048)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 405,000.000	カナダ・ドル 490,774.950	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,321,378.090	

5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,626,262.640	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,482,893.720	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,250,015.690	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,793,917.010	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,263,532.410	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,281,781.410	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,487,895.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,570,493.680	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,228,053.480	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	999,232.800	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,240,967.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,766,660.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	689,689.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,406,984.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,346,475.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,360,000.000	3,389,836.800	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,317,953.800	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,258,092.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,442,504.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,427,299.000	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	715,883.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,860,117.400	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,300,989.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	699,958.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,700,000.000	1,565,751.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,042,229.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,191,612.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,499,445.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,098,460.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	300,891.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	600,000.000	602,250.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	99,712.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 51,059,989.080 (4,630,119,810)	
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	880,234.400	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	815,256.920	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	672,341.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	912,341.660	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	465,200.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	703,811.900	

	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	676,488.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	700,312.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	560,418.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	813,904.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	479,286.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	801,457.500	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	460,431.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	605,275.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	510,090.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	382,445.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	723,099.500	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	150,000.000	148,860.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,311,252.980 (938,720,884)	
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	6,812,918.350	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,777,781.750	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,377,538.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,409,032.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,602,902.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,286,845.000	

	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,756,205.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,741,510.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,921,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 59,685,732.450 (789,045,383)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	24,005,226.960	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,088,687.680	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,605,400.760	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,296,501.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,082,926.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,348,160.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	2,030,556.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	496,510.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 60,953,968.400 (1,094,123,733)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,436,173.200	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,340,536.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,552,749.800	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,423,718.600	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,557,295.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,666,110.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,969,427.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,790,016.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,436,300.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 42,172,325.800 (557,518,148)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,474,001.140	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,664,787.750	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,386,415.900	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,989,678.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,031,954.100	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,278,746.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,579,792.000	
	Poland Government Bond 20220725	1,600,000.000	1,599,520.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,996,240.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,878,260.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	995,050.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	300,000.000	283,920.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,088,083.900	

	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,850,015.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,973,755.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,021,589.890	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 47,091,808.680 (1,387,042,133)	
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	2,455,865.160	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,286,234.640	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,643,658.960	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,384,942.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	891,441.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	774,947.720	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,027,676.650	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,446,136.070	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,975,735.880	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	800,000.000	866,304.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,116,741.640	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,838,249.730	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,190,663.550	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,271,471.800	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,349,835.480	



4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	982,554.300	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	693,400.500	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	790,545.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,259,115.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,250,000.000	1,352,587.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,265,208.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,755,964.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,301,544.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	653,160.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	692,347.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,007,505.500	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,288,608.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	414,160.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,301,027.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,658,160.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,300,000.000	1,251,718.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,000,000.000	949,130.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 40,136,639.030 (1,074,289,253)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	28,290,000.000	27,982,770.600	
8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	20,635,946.000	
8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	25,450,054.000	

	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,718,580.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	31,946,102.100	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	27,165,765.060	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	29,736,976.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,304,411.120	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	33,263,294.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	18,953,378.600	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	20,015,000.000	21,627,208.250	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,090,902.800	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	20,517,596.760	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	8,516,603.520	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 323,909,588.970 (1,787,203,548)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	392,810.600	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	296,320.320	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	851,825.740	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	710,703.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	438,368.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	845,616.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	752,436.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,010.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	528,290.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,156.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	302,959.900	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	387,992.000	

Finland Government Bond 20300915	500,000.000	503,905.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	349,236.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	300,000.000	303,591.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,479,077.980	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,200,316.000	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	958,604.640	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	312,972.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	912,159.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,349,273.600	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	887,916.600	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	403,300.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	964,980.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,034,233.200	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	815,080.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	989,937.200	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,012,090.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	719,446.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	366,092.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	300,000.000	273,846.000	
Austria Government Bond 20310220	700,000.000	701,519.000	

Austria Government Bond 20250420	480,000.000	490,536.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,793,430.420	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,950,424.300	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,299,636.620	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	2,002,929.930	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,465,730.560	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	892,422.400	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	959,044.400	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,178,980.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,090,068.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	805,892.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	461,156.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,603,895.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	733,460.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,628,175.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	722,826.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,238,775.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	634,088.400	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,225,656.000	
Belgium Government Bond 20311022	500,000.000	495,545.000	

0.65% Belgium Government Bond 20710622	500,000.000	414,165.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,149,943.360	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,678,694.490	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,058,927.320	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,310,525.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,088,667.120	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,419,566.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,799,746.400	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,816,230.540	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,333,855.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,292,031.340	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,774,000.000	4,592,024.120	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,279,127.620	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,300,929.360	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,688,355.120	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,462,226.400	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,894,277.010	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,693,964.610	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,664,962.600	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,183,579.980	

1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,698,327.300	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,264,188.740	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,291,830.460	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,355,761.840	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,496,819.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,497,028.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,399,878.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,450,259.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	2,981,128.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,029,770.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,261,851.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,315,500.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,094,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,050,000.000	1,876,775.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,802,797.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,903,059.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,065,300.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,500,000.000	1,541,955.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,239,696.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	922,464.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	100,000.000	99,222.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,000,000.000	1,031,340.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,017,445.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	100,669.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	100,854.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	101,023.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,011,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,013,750.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,119,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,803,974.300	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,932,262.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,958,208.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,739,814.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,462,736.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,366,171.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,004.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,266,726.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,325,566.450	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,899,799.750	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,818,649.070	

5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	4,788,162.220	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,270,726.260	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,326,216.040	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,771,645.020	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,574,423.410	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,864,000.000	6,703,653.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,379,622.610	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,359,048.220	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	4,499,000.000	5,392,276.450	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,841,796.940	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,026,902.120	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,236,804.300	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,519,072.900	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,253,652.580	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,296,553.850	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,636,010.080	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,444,909.420	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,628,283.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,967,867.120	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,337,419.830	



1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,611,684.360	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,935,508.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,118,206.700	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,676,148.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,654,840.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,427,816.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,707,692.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,426,883.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,301,846.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,458,038.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,412,707.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,950,000.000	4,149,791.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,194,258.900	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,227,090.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,426,544.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,630,281.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,064,830.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,500,000.000	1,469,415.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,500,000.000	3,492,965.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	680,000.000	521,485.200	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,632.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	500,000.000	477,185.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,800,000.000	1,777,086.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	900,000.000	917,271.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	620,149.680	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,589,884.540	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,498,589.550	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	847,493.220	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,479,000.000	2,537,904.840	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,483,900.960	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,515,877.120	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,456,853.800	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,540,042.560	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,640,479.560	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,855,655.100	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,726,124.400	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,363,042.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,425,872.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,458,256.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,251,252.000	

0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	948,294.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,424,038.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	821,360.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	850,000.000	756,874.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,000,000.000	1,010,460.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	870,660.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,107,530.640	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,535,407.500	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,331,147.040	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,981,849.420	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,002,971.150	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,645,645.730	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,238,521.950	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,062,664.980	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,539,359.040	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,953,735.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,391,085.990	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,922,843.320	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,665,720.960	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,133,682.000	

0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,586,208.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,171,889.840	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,753,800.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,687,923.300	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,380,210.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,546,099.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,995,920.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,725,993.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,689,552.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,623,388.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,331,504.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,944,156.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,379,365.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,819,808.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,341,680.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,723,987.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,631,442.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,842,862.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,574,552.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,276,181.000	

1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,332,770.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,316,090.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,594,887.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,021,239.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	745,712.800	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,323,452.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,440,099.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,796,605.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,556,460.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,039,800.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,478,848.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,052,940.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,609,760.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,318,278.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,771,808.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,738,896.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,370,291.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,337,835.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,108,327.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	900,000.000	885,042.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	670,985.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,888,714.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,000,000.000	1,967,700.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	688,121.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,098,152.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,510,620.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221129	100,000.000	100,602.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	460,556.600	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	300,000.000	301,965.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,819,825.540	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,284,240.730	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,770,295.950	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,407,911.020	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,807,284.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,240,680.240	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,497,597.050	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,522,961.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,589,203.740	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,509,171.200	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,776,154.870	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,120,092.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,153,750.100	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,069,138.180	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,927,995.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,478,803.140	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,481,781.570	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,890,940.060	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,392,528.520	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,448,897.840	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,691,062.880	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,244,913.670	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,400,197.680	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,110,743.400	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,417,798.320	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,398,663.450	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,653,784.300	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,009,473.390	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,260,686.180	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	673,676.640	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	673,745.720	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,168,278.090	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	999,414.460	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,148,410.440	

1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	653,812.500	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	352,884.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	861,352.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	843,555.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	844,575.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,039,043.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	695,058.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	351,113.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	823,912.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	506,750.000	
IRISH TREASURY 20311018	500,000.000	492,410.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	392,380.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,164,009.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,199,065.450	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,102,237.500	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	923,029.440	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	701,579.840	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	990,719.520	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,013,327.350	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	993,040.290	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,003,857.200	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	793,243.090	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	474,595.560	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	321,038.640	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	463,893.520	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	590,878.530	



2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	569,547.850	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,850,995.720	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,205,675.650	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,363,698.800	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,435,005.120	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,033,875.970	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,648,317.440	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,406,297.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,849,052.700	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,087,074.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,112,477.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,250,244.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,622,912.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,632,344.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,712,594.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,446,656.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,087,568.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,766,992.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,121,709.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,352,003.000	

0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,897,132.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,389,947.200	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,485,805.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,537,775.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,300,000.000	1,179,594.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,533,104.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,150,995.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,325,649.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	506,795.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,138,950.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	304,011.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	579,696.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	500,475.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	400,000.000	395,136.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,430,486.860	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,375,996.120	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,631,806.100	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,918,741.500	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,276,225.690	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,648,055.190	

	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,590,577.400	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,148,846.260	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,126,515.630	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,436,369.600	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,199,000.000	2,176,316.890	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,214,851.300	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,326,663.440	
	ユーロ 小計		ユーロ 685,390,715.160 (91,465,390,937)	
国債証券 合計			223,326,922,595 [223,326,922,595]	
合計			223,326,922,595 [223,326,922,595]	

- (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 252銘柄	100%	44.3%
イギリス・ポンド	国債証券 51銘柄	100%	6.6%
イスラエル・シュケル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	100%	2.2%
カナダ・ドル	国債証券 34銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	100%	0.4%
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 16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 32銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 348銘柄	100%	41.0%

**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J - REITインデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年6月16日から2021年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワJ - REITインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,057,185	2,375,491
親投資信託受益証券	586,895,325	1,361,566,126
未収入金	6,000	40,000
流動資産合計	591,958,510	1,363,981,617
資産合計	591,958,510	1,363,981,617
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	17,794,708	32,248,401
未払受託者報酬	305,359	118,394
未払委託者報酬	4,428,282	1,717,408
その他未払費用	76,271	29,516
流動負債合計	22,604,620	34,113,719
負債合計	22,604,620	34,113,719
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 593,156,947	<sup>1</sup> 1,040,271,027
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 23,803,057	<sup>2</sup> 289,596,871
（分配準備積立金）	8,645,335	115,244,660
元本等合計	569,353,890	1,329,867,898
純資産合計	569,353,890	1,329,867,898
負債純資産合計	591,958,510	1,363,981,617

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		15		-
有価証券売買等損益		1,014,292,301		305,631,801
営業収益合計		1,014,292,286		305,631,801
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,317		124
受託者報酬		567,961		194,894
委託者報酬		8,236,566		2,827,400
その他費用		142,411		48,556
営業費用合計		8,948,255		3,070,974
営業利益又は営業損失（ ）		1,023,240,541		302,560,827
経常利益又は経常損失（ ）		1,023,240,541		302,560,827
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,023,240,541		302,560,827
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（ ）		873,537,492		31,077,864
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		147,498,098		23,803,057
剰余金増加額又は欠損金減少額		989,528,608		74,165,366
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		3,888,322
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		989,528,608		70,277,044
剰余金減少額又は欠損金増加額		993,332,006		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		993,332,006		-
分配金		1 17,794,708		1 32,248,401
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		23,803,057		289,596,871

## (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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,101,807,931円	593,156,947円
期中追加設定元本額	3,863,471,660円	633,413,235円
期中一部解約元本額	4,372,122,644円	186,299,155円
2. 計算期間末日における受益権の総数	593,156,947口	1,040,271,027口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は23,803,057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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日



<p>1 分配金の計算過程</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(18,050,837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(53,417,138円)及び分配準備積立金(8,389,206円)より分配対象額は79,857,181円(1万口当たり1,346.31円)であり、うち17,794,708円(1万口当たり300円)を分配金額としております。</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(32,343,865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(108,412,070円)、投資信託約款に規定される収益調整金(174,352,211円)及び分配準備積立金(6,737,126円)より分配対象額は321,845,272円(1万口当たり3,093.86円)であり、うち32,248,401円(1万口当たり310円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021年6月15日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額
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6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	148,397,547	273,956,960
合計	148,397,547	273,956,960

## (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6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期 自 2020年6月16日 至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9599円 (9,599円)	1.2784円 (12,784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	388,974,439	1,361,566,126	
親投資信託受益証券 合計			1,361,566,126	
合計			1,361,566,126	

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6月15日現在		2021年6月15日現在	
	金額（円）		金額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		7,793,194,074		9,391,833,293
投資証券	2	312,729,669,700		477,927,135,200
派生商品評価勘定		-		193,704,000
未収入金		2,239,422,708		2,888,260,342
未収配当金		2,337,843,577		2,704,946,046
前払金		213,945,200		-
差入委託証拠金		23,464,000		-
流動資産合計		325,337,539,259		493,105,878,881
資産合計		325,337,539,259		493,105,878,881
負債の部				
流動負債				
派生商品評価勘定		605,628,480		-
前受金		-		230,720,000
未払金		83,013,000		-
未払解約金		106,784,000		88,913,000
その他未払費用		20,322		-
流動負債合計		795,445,802		319,633,000
負債合計		795,445,802		319,633,000
純資産の部				
元本等				
元本	1	126,932,759,051		140,780,222,102
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		197,609,334,406		352,006,023,779
元本等合計		324,542,093,457		492,786,245,881
純資産合計		324,542,093,457		492,786,245,881
負債純資産合計		325,337,539,259		493,105,878,881

## 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6月16日 至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	95,580,504,970円	126,932,759,051円
期中追加設定元本額	47,652,104,674円	40,009,856,488円
期中一部解約元本額	16,299,850,593円	26,162,393,437円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	5,794,841,087円	5,423,655,838円
ダイワJ - REITオープン （毎月分配型）	110,923,691,743円	124,292,216,452円
ダイワJ - REITオープン （年1回決算型）	311,434,660円	334,735,806円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	1,050,856円	4,678,854円
iFree J - REITイ ンデックス	138,691,083円	440,538,252円

	iFree 8資産バランス	1,004,463,405円	1,135,916,681円
	DC・ダイワJ-REIT オープン	5,260,587,366円	5,406,499,984円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,744,770円	- 円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,982,707円	4,669,644円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,440,608円	3,416,293円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	103,161,629円	103,578,212円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,595,500,538円	1,742,654,704円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	229,542,915円	388,974,439円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	418,298,119円	471,415,178円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,141,327,565円	1,027,271,765円
	計	126,932,759,051円	140,780,222,102円
2.	期末日における受益権の総数	126,932,759,051口	140,780,222,102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 2,874,650,000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 5,835,100,000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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<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（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>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。</p>
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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	15,546,572,937	44,692,150,542
合計	15,546,572,937	44,692,150,542

(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3月17日から2020年6月15日まで、及び2021年3月16日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15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	9,075,323,200	-	8,470,272,000	605,051,200	11,722,480,000	-	11,916,800,000	194,320,000
合計	9,075,323,200	-	8,470,272,000	605,051,200	11,722,480,000	-	11,916,800,000	194,320,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.5568円	3.5004円
(1万口当たり純資産額)	(25,568円)	(35,004円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,727	937,071,100	
	サンケイリアルエステート	10,073	1,300,424,300	
	SOSILA物流リート投	10,824	1,632,259,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	14,186	9,008,110,000	
	森ヒルズリート	48,352	7,944,233,600	
	産業ファンド	58,185	11,997,747,000	
	アドバンス・レジデンス	39,099	14,349,333,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	28,055	6,567,675,500	
	A P I 投資法人	20,626	10,436,756,000	
	G L P 投資法人	128,624	24,348,523,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	18,507	6,542,224,500	
	日本プロロジスリート	65,076	23,069,442,000	
	星野リゾート・リート	6,263	4,240,051,000	
	ONE リート投資法人	6,416	2,043,496,000	
	イオンリート投資	41,751	6,517,331,100	
	ヒューリックリート投資法	34,123	6,213,798,300	
	日本リート投資法人	13,370	6,043,240,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	261,579	5,911,685,400	
	積水ハウス・リート投資	121,070	11,102,119,000	
	トーセイ・リート投資法人	9,107	1,260,408,800	
	ケネディクス商業リート	16,373	4,833,309,600	
	ヘルスケア&メディカル投資	8,780	1,282,758,000	
	サムティ・レジデンシャル	7,924	984,160,800	
	野村不動産マスターF	133,111	24,292,757,500	
	いちごホテルリート投資	7,198	732,036,600	
	ラサールロジポート投資	49,791	9,027,108,300	
	スターアジア不動産投	42,293	2,571,414,400	
	マリモ地方創生リート	3,856	527,115,200	
	三井不ロジパーク	14,367	8,490,897,000	
	大江戸温泉リート	6,644	562,082,400	
	投資法人みらい	44,456	2,280,592,800	
	森トラスト・ホテルリート投	8,915	1,254,340,500	
三菱地所物流REIT	10,353	4,953,910,500		
CREロジスティクスファンド	13,170	2,460,156,000		
ザイマックス・リート	6,307	769,454,000		

タカラレーベン不動産投	12,369	1,521,387,000	
伊藤忠アドバンスロジ	15,966	2,396,496,600	
日本ビルファンド	46,326	33,864,306,000	
ジャパンリアルエステイト	41,163	28,608,285,000	
日本都市ファンド投資法人	205,029	24,029,398,800	
オリックス不動産投資	82,016	17,305,376,000	
日本プライムリアルティ	25,628	11,455,716,000	
NTT都市開発リート投資法人	37,179	6,093,638,100	
東急リアル・エステート	27,598	5,577,555,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	28,583	3,607,174,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	88,031	13,926,504,200	
森トラスト総合リート	29,419	4,674,679,100	
インヴィンシブル投資法人	172,115	7,934,501,500	
フロンティア不動産投資	13,660	7,103,200,000	
平和不動産リート	26,598	4,612,093,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	26,895	8,781,217,500	
福岡リート投資法人	21,288	3,885,060,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,734	9,970,722,000	
いちごオフィスリート投資法人	33,728	3,372,800,000	
大和証券オフィス投資法人	8,770	6,945,840,000	
阪急阪神リート投資法人	18,593	2,917,241,700	
スタートアップリート投資法人	6,410	1,547,374,000	
大和ハウスリート投資法人	58,731	19,469,326,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	132,609	9,203,064,600	
大和証券リビング投資法人	53,751	6,444,744,900	
ジャパンエクセレント投資法人	38,195	6,191,409,500	
投資証券 合計		477,927,135,200	
合計		477,927,135,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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。



**【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2020年6月16日から2021年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,858,236	6,279,767
親投資信託受益証券	134,755,750	3,610,928,646
派生商品評価勘定	455,478	940,944
未収入金	913	2,425,398
流動資産合計	140,070,377	3,620,574,755
資産合計	140,070,377	3,620,574,755
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	251,774	16,924,529
未払金	1,690	316,220
未払収益分配金	-	47,901,523
未払解約金	-	2,270,382
未払受託者報酬	242,478	337,253
未払委託者報酬	4,547,419	6,324,301
その他未払費用	60,556	84,234
流動負債合計	5,103,917	74,158,442
負債合計	5,103,917	74,158,442
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 150,887,999	1 2,993,845,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 15,921,539	2 552,571,123
（分配準備積立金）	716,459	611,916,277
元本等合計	134,966,460	3,546,416,313
純資産合計	134,966,460	3,546,416,313
負債純資産合計	140,070,377	3,620,574,755

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年6月18日 至 2020年6月15日		自 2020年6月16日 至 2021年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		15		3
有価証券売買等損益		1,074,212,810		994,862,896
為替差損益		43,866,705		222,704,098
<b>営業収益合計</b>		<b>1,030,346,090</b>		<b>772,158,801</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,820		369
受託者報酬		413,654		374,182
委託者報酬		7,757,932		7,017,336
その他費用		109,538		99,321
<b>営業費用合計</b>		<b>8,282,944</b>		<b>7,491,208</b>
営業利益又は営業損失( )		1,038,629,034		764,667,593
経常利益又は経常損失( )		1,038,629,034		764,667,593
当期純利益又は当期純損失( )		1,038,629,034		764,667,593
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( )		1,011,757,679		87,521,045
期首剰余金又は期首欠損金( )		38,086,131		15,921,539
剰余金増加額又は欠損金減少額		324,739,456		46,010,056
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		46,010,056
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		324,739,456		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		351,875,771		106,762,419
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		351,875,771		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		106,762,419
<b>分配金</b>		<b>1 -</b>		<b>1 47,901,523</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )		15,921,539		552,571,123

## (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6月16日	至 2021年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 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。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	657,073,836円	150,887,999円
期中追加設定元本額	4,068,922,456円	3,792,473,085円
期中一部解約元本額	4,575,108,293円	949,515,894円
2. 計算期間末日における受益権の総数	150,887,999口	2,993,845,190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15,921,539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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15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(20,591,728円)及び分配準備積立金(716,459円)より分配対象額は21,308,187円(1万口当たり1,412.19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(53,576,052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(605,767,062円)、投資信託約款に規定される収益調整金(428,870,651円)及び分配準備積立金(474,686円)より分配対象額は1,088,688,451円(1万口当たり3,636.42円)であり、うち47,901,523円(1万口当たり160円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>



4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>
----------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	24,604,391	851,122,667
合計	24,604,391	851,122,667

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	第4期 2020年6月15日 現在			第5期 2021年6月15日 現在		
	契約額等 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）
	うち			うち		

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	130,046,338	-	129,842,634	203,704	3,331,287,601	-	3,347,271,186	15,983,585
アメリカ・ドル	98,000,478	-	97,553,619	446,859	2,477,879,818	-	2,493,896,700	16,016,882
イギリス・ポンド	6,891,610	-	6,932,453	40,843	190,989,817	-	190,660,246	329,571
イスラエル・シケル	94,798	-	95,604	806	997,225	-	1,004,094	6,869
オーストラリア・ドル	8,468,823	-	8,587,152	118,329	244,417,750	-	244,823,083	405,333
カナダ・ドル	2,399,927	-	2,405,772	5,845	75,400,506	-	75,359,007	41,499
シンガポール・ドル	5,156,388	-	5,185,350	28,962	114,970,807	-	115,101,478	130,671
ニュージーランド・ドル	576,483	-	590,734	14,251	9,208,794	-	9,095,408	113,386
ユーロ	6,111,942	-	6,154,680	42,738	160,827,228	-	160,392,100	435,128
香港・ドル	2,345,889	-	2,337,270	8,619	56,595,656	-	56,939,070	343,414
合計	130,046,338	-	129,842,634	203,704	3,331,287,601	-	3,347,271,186	15,983,585

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう

に評価しております。

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

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

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

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年6月16日 至 2021年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8945円	1.1846円
（1万口当たり純資産額）	(8,945円)	(11,846円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	先進国REITマザーファンド	582,772,710	1,175,977,051	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	832,319,807	2,434,951,595	
親投資信託受益証券 合計			3,610,928,646	
合計			3,610,928,646	

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」受益証券及び「先進国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・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6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	41,057,234	108,984,909
コール・ローン	423,504,486	291,310,260
投資信託受益証券	540,422,575	389,119,381
投資証券	23,424,809,404	42,224,363,659
派生商品評価勘定	119,248,888	93,130,728
未収入金	1,385,735	2,179,419
未収配当金	46,237,902	61,033,920
差入委託証拠金	210,886,807	264,273,124
流動資産合計	24,807,553,031	43,434,395,400
資産合計	24,807,553,031	43,434,395,400
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,441,168	306,121
未払金	47,266,751	52,097,895
未払解約金	6,871,220	5,877,400
その他未払費用	981	-
流動負債合計	55,580,120	58,281,416
負債合計	55,580,120	58,281,416
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,968,050,382
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		12,783,922,529
元本等合計		24,751,972,911
純資産合計		24,751,972,911

負債純資産合計	24,807,553,031	43,434,395,400
---------	----------------	----------------

## 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6月16日 至 2021年6月15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</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	9,341,984,740円	11,968,050,382円
期中追加設定元本額	5,262,156,766円	4,938,340,057円
期中一部解約元本額	2,636,091,124円	2,079,340,188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	5,819,881,094円	6,106,516,748円
REITインデックス（為替		
ヘッジあり）		
ダイワファンドラップ 外国	1,011,439,969円	1,102,903,841円
REITインデックス（為替		
ヘッジなし）		
ダイワファンドラップオンラ	361,708,622円	333,772,518円
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)	265,959,373円	280,439,993円
D-I's グローバルREITインデックス	2,318,298円	2,300,718円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	1,315,316円	4,865,686円
iFree 外国REITインデックス	123,706,507円	434,510,780円
iFree 8資産バランスグローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	1,258,447,888円	1,411,645,138円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	6,556,810円	175,971,248円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,515,002,695円	2,906,413,027円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,470,362円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,613,190円	5,709,333円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,162,363円	4,182,980円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	- 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	218,996,022円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	251,500,581円	246,972,772円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	50,417,933円	56,274,115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)	65,156,054円	832,319,807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)	212,696,187円	447,317,832円
計	11,968,050,382円	14,827,050,251円

2. 期末日における受益権の総数	11,968,050,382口	14,827,050,251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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。



	<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6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	37,000,267	14,369,410
投資証券	5,278,779,365	7,406,728,672
合計	5,241,779,098	7,421,098,082

（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6月15日まで、及び2020年12月1日から2021年6月15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6月15日 現在				2021年6月15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	668,355,950	-	786,576,726	118,220,776	642,529,634	-	734,930,224	92,400,590
合計	668,355,950	-	786,576,726	118,220,776	642,529,634	-	734,930,224	92,400,590

## （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6月15日 現在				2021年6月15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	417,170,856	-	416,757,800	413,056	267,316,559	-	267,740,576	424,017
アメリカ・ドル	283,042,880	-	281,918,500	1,124,380	151,293,820	-	151,911,366	617,546
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	21,702,056	-	21,750,498	48,442
オーストラ リア・ドル	3,731,865	-	3,651,000	80,865	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	8,163,810	-	8,158,563	5,247
ニュージー ランド・ドル	2,010,873	-	2,060,700	49,827	5,571,377	-	5,502,749	68,628
ユーロ	128,385,238	-	129,127,600	742,362	74,946,816	-	74,744,320	202,496
香港・ドル	-	-	-	-	5,638,680	-	5,673,080	34,400
合計	417,170,856	-	416,757,800	413,056	267,316,559	-	267,740,576	424,017

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0682円 (20,682円)	2,9255円 (29,255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	33,500,000	3,533,915,000	
		アメリカ・ドル 小計		3,533,915,000 (389,119,381)	
投資信託受益証券 合計				389,119,381 [389,119,381]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33,200	809,416,000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,900	137,592,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	26,882	539,790,560	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	27,100	551,214,000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	35,000	7,497,350,000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	82,347	10,975,208,160	
		BOSTON PROPERTIES INC	35,600	4,415,468,000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	36,789	282,907,410	
		VORNADO REALTY TRUST	39,364	1,970,955,480	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19,500	427,050,000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	15,700	780,604,000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,500	311,410,000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	15,900	1,240,995,000	
EQUITY RESIDENTIAL	86,000	6,958,260,000			

APPLE HOSPITALITY REIT INC	50,700	824,382.000	
EPR PROPERTIES	18,500	993,080.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	35,700.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	118,482.000	
GLOBAL NET LEASE INC	21,433	428,231.340	
EQUINIX INC	22,300	18,374,977.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,629	539,495.840	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	149,040.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8,800	166,056.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,900	1,124,232.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	28,300	526,380.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,500	283,195.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	176,900	3,125,823.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	67,408	2,645,764.000	
CORESITE REALTY CORP	10,800	1,455,408.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	37,300	1,129,444.000	
RLJ LODGING TRUST	41,871	672,029.550	
FARMLAND PARTNERS INC	6,700	85,559.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	51,400	1,004,356.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,000	194,180.000	
CYRUSONE INC	30,200	2,386,706.000	
KIMCO REALTY CORP	108,500	2,356,620.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,800	155,820.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	54,950	1,622,124.000	
WHITESTONE REIT	8,500	73,695.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	54,837	2,622,853.710	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	30,200	612,758.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	59,480	1,281,199.200	
COLONY CAPITAL INC	120,211	949,666.900	
INVITATION HOMES INC	142,297	5,380,249.570	
JBG SMITH PROPERTIES	27,932	972,033.600	
ALEXANDER & BALDWIN INC	18,700	370,821.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	10,864.000	
GLADSTONE LAND CORP	6,400	158,208.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	63,300	2,485,791.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,900	420,873.000	
VICI PROPERTIES INC	134,600	4,417,572.000	
RETAIL VALUE INC	2,990	64,524.200	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,000	166,500.000	

BRT APARTMENTS CORP	1,300	23,972.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,100	1,169,614.000	
SAFEHOLD INC	3,200	250,784.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	3,329	11,252.020	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	26,000	234,000.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28,100	811,528.000	
COREPOINT LODGING INC	6,700	68,072.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,700	113,886.000	
STORE CAPITAL CORP	60,200	2,180,444.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,400	22,824.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	9,000	232,650.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,300	256,542.000	
LIFE STORAGE INC	18,650	2,012,148.500	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,300	477,609.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24,882	466,288.680	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12,200	132,370.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,200	455,064.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,000	431,460.000	
NETSTREIT CORP	6,300	150,696.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	37,389	1,865,337.210	
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	67,020.000	
CIM COMMERCIAL TRUST-RIGHTS	2,400	960.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	32,500	1,925,300.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	28,100	524,627.000	
STAG INDUSTRIAL INC	39,800	1,565,334.000	
VENTAS INC	93,979	5,541,001.840	
CARETRUST REIT INC	22,903	548,984.910	
GEO GROUP INC/THE	27,400	187,142.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	74,400	1,777,416.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11,800	364,502.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	51,487	939,637.750	
UMH PROPERTIES INC	8,600	193,328.000	
IRON MOUNTAIN INC	72,300	3,321,462.000	
TERRENO REALTY CORP	16,800	1,131,480.000	
VEREIT INC	57,481	2,813,694.950	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	28,920	1,457,568.000	
SUN COMMUNITIES INC	28,000	4,972,800.000	
ACADIA REALTY TRUST	21,111	473,519.730	
ALEXANDER'S INC	500	140,310.000	

PROLOGIS INC	184,819	23,316,765.040	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	31,900	6,173,607.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	43,300	646,469.000	
SAUL CENTERS INC	3,200	150,592.000	
MACK-CALI REALTY CORP	20,200	360,368.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	24,500	3,312,155.000	
COUSINS PROPERTIES INC	37,306	1,491,493.880	
SITE CENTERS CORP	40,678	637,017.480	
DUKE REALTY CORP	93,700	4,638,150.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,000	1,705,100.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,267	5,130,611.800	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	32,400	1,746,684.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,300	2,134,993.000	
GETTY REALTY CORP	8,803	300,006.240	
WELLTOWER INC	104,700	8,502,687.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	135,100	4,769,030.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26,200	1,273,844.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	39,500	543,915.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	35,200	1,136,256.000	
EQUITY COMMONWEALTH	30,075	845,709.000	
KILROY REALTY CORP	26,200	1,931,988.000	
LTC PROPERTIES INC	9,600	379,968.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	73,300	952,900.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28,728	4,929,437.520	
MACERICH CO/THE	28,379	494,645.970	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,500	3,252,100.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,200	752,640.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	44,000	2,197,360.000	
REALTY INCOME CORP	93,617	6,609,360.200	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28,500	851,865.000	
PUBLIC STORAGE	38,100	11,225,403.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,900	779,051.000	
REGENCY CENTERS CORP	39,620	2,648,200.800	
RPT REALTY	21,100	289,492.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	24,000	463,440.000	
SL GREEN REALTY CORP	17,157	1,429,521.240	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57,500	237,475.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	117,420.000	
UDR INC	74,400	3,728,928.000	

UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,100	219,759.000	
WP CAREY INC	44,000	3,420,560.000	
WASHINGTON REIT	21,600	579,528.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	30,300	1,007,172.000	
AGREE REALTY CORP	16,000	1,154,720.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	58,148	2,197,412.920	
CUBESMART	50,100	2,340,171.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	52,626	694,136.940	
DIGITAL REALTY TRUST INC	70,478	11,440,693.740	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,100	5,294,014.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	93,476.250	
CENTERSPACE	2,960	223,746.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	20,550	474,088.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	23,300	457,845.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,633	107,137.170	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	34,600	1,690,902.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,800	203,368.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	51,342	531,903.120	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	145,500	3,196,635.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	115,920.000	
DOUGLAS EMMETT INC	41,400	1,518,966.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	54,400	678,912.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364,562	275,244.310	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151,400	115,821.000	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	9,247.500	
PRIME US REIT	99,000	85,140.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 286,808,713.130 (31,580,507,402)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	668,520	515,763.180	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159,570	137,868.480	
STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	72,200.000	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	144,300.520	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	108,393.450	
REGIONAL REIT LTD	111,310	97,952.800	
NEWRIVER REIT PLC	69,330	62,189.010	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	212,290	372,993.530	

	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155,490	183,478.200	
	CUSTODIAN REIT PLC	89,420	88,615.220	
	GCP STUDENT LIVING PLC	112,860	195,924.960	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67,900	75,640.600	
	LXI REIT PLC	131,188	194,158.240	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98,200	103,306.400	
	AEW UK REIT PLC	25,610	24,329.500	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201,120	184,628.160	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207,000	244,260.000	
	HOME REIT PLC	60,000	67,800.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	186,931	1,343,286.160	
	SEGRO PLC	299,800	3,285,808.000	
	HAMMERSON PLC	1,011,984	447,802.920	
	UNITE GROUP PLC/THE	100,190	1,152,185.000	
	BRITISH LAND CO PLC	235,990	1,214,876.520	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	63,871	479,032.500	
	DERWENT LONDON PLC	27,820	986,775.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	329,370	520,404.600	
	WORKSPACE GROUP PLC	32,260	283,888.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	52,350	505,701.000	
	SHAFTESBURY PLC	76,370	468,529.950	
	BIG YELLOW GROUP PLC	41,560	537,786.400	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	225,150	536,307.300	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	56,787.200	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	427,740	876,867.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 15,569,840.200 (2,419,397,468)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	508,449.200	イスラエル・シュケル
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 508,449.200 (17,248,123)	
オーストラリ ア・ドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78,380	282,168.000	オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	485,284	444,034.860	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	120,890	448,501.900	
	AVENTUS GROUP	103,000	315,180.000	



RURAL FUNDS GROUP	78,595	199,631.300	
WAYPOINT REIT	193,830	513,649.500	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	149,458	732,344.200	
CENTURIA OFFICE REIT	105,950	248,982.500	
CENTURIA CAPITAL GROUP	128,880	353,131.200	
IRONGATE GROUP	149,630	228,933.900	
HOME CONSORTIUM	48,000	237,120.000	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	74,340	108,536.400	
NATIONAL STORAGE REI - RTS	39,903	12,509.590	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	276,860	708,761.600	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,547	282,893.470	
NATIONAL STORAGE REIT	250,195	517,903.650	
APN INDUSTRIA REIT	42,760	137,259.600	
GDI PROPERTY GROUP	123,310	141,189.950	
SCENTRE GROUP	1,330,650	3,858,885.000	
ARENA REIT	93,890	326,737.200	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	126,390.000	
BWP TRUST	123,870	536,357.100	
DEXUS	278,430	2,987,553.900	
GPT GROUP	499,390	2,452,004.900	
CHARTER HALL RETAIL REIT	130,400	503,344.000	
MIRVAC GROUP	1,009,470	2,998,125.900	
STOCKLAND	611,970	2,931,336.300	
ABACUS PROPERTY GROUP	107,930	342,138.100	
GOODMAN GROUP	431,000	8,887,220.000	
VICINITY CENTRES	981,460	1,643,945.500	
CHARTER HALL GROUP	118,020	1,785,642.600	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	76,660	449,994.200	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 35,742,406.320 (3,034,887,720)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,100	192,204.000	
SLATE GROCERY REIT	7,000	89,810.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,700	255,524.000	
SLATE OFFICE REIT	5,100	27,285.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	94,374.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,400	303,030.000	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	20,600	342,166.000	

	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	84,112.000	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,800	244,080.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	50,143.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	7,600	626,848.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	21,600	316,656.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,200	261,144.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	26,900	481,510.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	40,300	596,440.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	71,442.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,100	237,585.000	
	PLAZA RETAIL REIT	11,100	50,949.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	18,000	535,680.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	21,900	1,249,833.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	224,219.100	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	34,966	580,785.260	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	38,900	847,242.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	125,928.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,900	236,118.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,300	223,245.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	15,600	714,636.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 9,062,988.360 (821,831,784)	
シンガポール・ ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	331,683	852,425.310	
	FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	249,876	68,715.900	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	542,000	579,940.000	
	AIMS APAC REIT	119,000	171,360.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	201,800	108,972.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	683,190	963,297.900	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134,000	122,610.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	168,164.500	
	EC WORLD REIT	57,000	45,885.000	
	IREIT GLOBAL	105,124	68,856.220	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	815,677	2,422,560.690	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,164,622	2,503,937.300	
	SUNTEC REIT	535,400	787,038.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	750,200	1,515,404.000	

	KEPPEL REIT	501,400	596,666.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	453,456	471,594.240	
	ESR-REIT	559,902	229,559.820	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	191,600	241,416.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	347,776	848,573.440	
	STARHILL GLOBAL REIT	383,800	214,928.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	234,442	323,529.960	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	96,300	422,757.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	1,214,720	77,742.080	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	506,469	1,402,919.130	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	294,500	241,490.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	558,184	1,200,095.600	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248,100	147,619.500	
	SPH REIT	275,600	241,150.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	94,342.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651,063	260,425.200	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 17,393,974.790 (1,443,525,967)	
ニュージーランド ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	194,470	302,400.850	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	392,920	467,574.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	89,920	278,302.400	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	273,220	631,138.200	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	266,820	432,248.400	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 2,111,664.650 (166,061,308)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	42,490	659,869.700	ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	17,280	159,356.160	
	WERELDHAVE NV	8,970	142,533.300	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33,090	2,651,170.800	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,687	198,237.340	
	NSI NV	4,131	142,932.600	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	97,312.500	
	ICADE	7,490	571,861.500	
	CARMILA	10,000	133,400.000	
	ALTAREA	890	162,158.000	

	GECINA SA	12,961	1,758,807.700	
	KLEPIERRE	47,910	1,195,833.600	
	COVIVIO	11,452	929,673.360	
	MERCIALYS	8,630	92,772.500	
	AEDIFICA	7,726	859,131.200	
	COFINIMMO	6,790	888,811.000	
	BEFIMMO	5,870	209,852.500	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	5,480	133,712.000	
	RETAIL ESTATES	2,540	182,626.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	32,600	1,056,240.000	
	CARE PROPERTY INVEST	6,100	166,225.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,080	204,000.000	
	MONTEA	2,500	261,000.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,240	61,566.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,530	76,573.100	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	60,633	576,316.660	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	79,700	762,888.400	
	CROMWELL REIT EUR	70,920	165,952.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102,050	158,993.900	
	HIBERNIA REIT PLC	159,240	200,005.440	
ユーロ 小計			ユーロ 14,859,813.060 (1,983,042,053)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	49,200,000.000	韓国・ウォン
	LOTTE REIT CO LTD	25,375	155,041,250.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,960	89,081,600.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	31,304,000.000	
	JR REIT XXVII	25,500	133,110,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,500	51,255,000.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 508,991,850.000 (50,186,597)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398,000	1,663,640.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250,000	1,150,000.000	
	FORTUNE REIT	346,000	2,923,700.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	897,000.000	
	LINK REIT	533,700	41,014,845.000	
	CHAMPION REIT	481,000	2,222,220.000	

	香港・ドル 小計		香港・ドル 49,871,405.000 (707,675,237)	
投資証券	合計		42,224,363,659 [42,224,363,659]	
合計			42,613,483,040 [42,613,483,040]	

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 1銘柄 受益証券 投資証券 157銘柄	1.2%	98.8%	75.0%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.7%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 32銘柄	-%	100%	7.1%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	3.4%
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 30銘柄	-%	100%	4.7%
韓国・ウォン	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.1%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.7%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

「先進国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6月15日現在	2021年6月15日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,077,764	12,489,879
コール・ローン	80,103,780	13,525,656
投資信託受益証券	264,590,892	5,110,821
投資証券	1,081,234,628	3,323,044,536
派生商品評価勘定	4,817,860	2,942,025
未収入金	602,769	48,274,848
未収配当金	2,112,182	3,985,608
差入委託証拠金	17,650,642	26,570,171
流動資産合計	1,453,190,517	3,435,943,544
資産合計	1,453,190,517	3,435,943,544
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	953,311	4,429
未払金	40,708	16,841
未払解約金	13,230,300	9,784,000
その他未払費用	183	-
流動負債合計	14,224,502	9,805,270
負債合計	14,224,502	9,805,270
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,005,399,854	1,697,839,447
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	433,566,161	1,728,298,827
元本等合計	1,438,966,015	3,426,138,274
純資産合計	1,438,966,015	3,426,138,274
負債純資産合計	1,453,190,517	3,435,943,544

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日
-----	------------------------------

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首	2019年6月18日	2020年6月16日
期首元本額	1,302,554,404円	1,005,399,854円
期中追加設定元本額	4,116,787,923円	1,845,135,443円
期中一部解約元本額	4,413,942,473円	1,152,695,850円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
USリート・インデックス・ファンド（為替ヘッジなし/毎月分配型）	19,594,588円	- 円
ダイナミック・アロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	296,428,827円	437,383,101円
先進国REITファンド（適格機関投資家専用）	543,902,238円	453,569,411円
海外リート資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	- 円	14,349,923円
ターゲット・リターン（コスト控除後3%）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	- 円	36,285円
ターゲット・リターン（コスト控除後5%）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	- 円	70,208円



りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	12,059,331円	16,225,514円
堅実バランスファンド - ハジメの一步 -	1,725,629円	19,612,901円
DCダイワ8資産アロケーション・ファンド	8,396円	- 円
DCダイナミック・アロケーション・ファンド	16,654,480円	36,382,591円
ダイワ外国3資産アロケーション・ファンド（部分為替ヘッジあり）	115,026,365円	137,436,803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）	- 円	582,772,710円
計	1,005,399,854円	1,697,839,447円
2. 期末日における受益権の総数	1,005,399,854口	1,697,839,447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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。  デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	22,556,904	341,561
投資証券	76,375,811	222,653,283
合計	98,932,715	222,994,844

（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5月9日から2020年6月15日まで、及び2021年5月11日から2021年6月15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6月15日 現在			2021年6月15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								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	90,062,832	-	93,621,994	3,559,162	45,060,205	-	47,988,170	2,927,965
合計	90,062,832	-	93,621,994	3,559,162	45,060,205	-	47,988,170	2,927,965

## (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6月15日 現在				2021年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	49,769,042	-	49,769,132	90
アメリカ・ドル	-	-	-	-	49,769,042	-	49,769,132	90
買 建	67,364,733	-	67,670,120	305,387	3,793,557	-	3,803,278	9,721
アメリカ・ドル	5,573,984	-	5,573,880	104	2,187,554	-	2,201,614	14,060
イギリス・ポ ンド	29,275,088	-	29,365,710	90,622	-	-	-	-
オーストラ リア・ドル	1,460,682	-	1,460,400	282	-	-	-	-

カナダ・ドル	4,941,285	-	4,953,060	11,775	-	-	-	-
ニュージー ランド・ドル	6,402,531	-	6,525,550	123,019	-	-	-	-
ユーロ	19,711,163	-	19,791,520	80,357	1,606,003	-	1,601,664	4,339
合計	67,364,733	-	67,670,120	305,387	53,562,599	-	53,572,410	9,631

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4312円	2.0179円
(1万口当たり純資産額)	(14,312円)	(20,179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	440.000	46,415.600	
		小計		アメリカ・ドル	

				46,415.600	
				(5,110,821)	
投資信託受益証券 合計				5,110,821	
				[5,110,821]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,236	693,183.560	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,197	1,092,496.160	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,397	545,359.910	
		VORNADO REALTY TRUST	9,516	476,466.120	
		EQUITY RESIDENTIAL	8,197	663,219.270	
		EQUINIX INC	1,864	1,535,917.360	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	28,283	499,760.610	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,252	442,523.160	
		INVITATION HOMES INC	15,091	570,590.710	
		VICI PROPERTIES INC	19,717	647,111.940	
		PARAMOUNT GROUP INC	51,589	583,987.480	
		STAG INDUSTRIAL INC	8,109	318,926.970	
		VENTAS INC	10,940	645,022.400	
		IRON MOUNTAIN INC	9,551	438,772.940	
		VEREIT INC	11,032	540,016.400	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	9,182	462,772.800	
		SUN COMMUNITIES INC	2,691	477,921.600	
		PROLOGIS INC	15,144	1,910,567.040	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,814	544,593.420	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,588	485,061.720	
		DUKE REALTY CORP	8,865	438,817.500	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,724	543,749.600	
		WELLTOWER INC	10,342	839,873.820	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	16,270	574,331.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,289	564,359.510	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,015	460,267.800	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	8,654	432,180.760	
		REALTY INCOME CORP	9,445	666,817.000	
		PUBLIC STORAGE	3,289	969,038.070	
		UDR INC	9,305	466,366.600	
		WP CAREY INC	6,332	492,249.680	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,375	354,281.250	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,611	910,833.630	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	3,641	582,341.540	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21,371	469,520.870	
	DOUGLAS EMMETT INC	12,418	455,616.420	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 22,794,916.620 (2,509,948,269)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	SEGRO PLC	51,860	568,385.600	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	240,010	492,020.500	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 1,060,406.100 (164,776,504)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	SCENTRE GROUP	208,380	604,302.000	
	DEXUS	62,100	666,333.000	
	MIRVAC GROUP	263,640	783,010.800	
	GOODMAN GROUP	50,640	1,044,196.800	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 3,097,842.600 (263,037,815)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CHOICE PROPERTIES REIT	67,000	991,600.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 991,600.000 (89,918,288)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	146,029	433,706.130	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	395,888	851,159.200	
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 1,284,865.330 (106,630,974)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,480	439,057.600	
	GECINA SA	2,110	286,327.000	
	COFINIMMO	2,160	282,744.000	
ユーロ	小計		ユーロ 1,008,128.600 (134,534,762)	
香港・ドル			香港・ドル	

	LINK REIT	49,700	3,819,445.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 3,819,445.000 (54,197,924)	
投資証券	合計		3,323,044,536 [3,323,044,536]	
合計			3,328,155,357 [3,328,155,357]	

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 1銘柄 受益証券 投資証券 36銘柄	0.2%	99.8%	75.6%
イギリス・ポンド	投資証券 2銘柄	-%	100%	5.0%
オーストラリア・ドル	投資証券 4銘柄	-%	100%	7.9%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	2.7%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄	-%	100%	3.2%
ユーロ	投資証券 3銘柄	-%	100%	4.0%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	1.6%

## 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。

**【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2020年6月16日から2021年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,049,400	1,925,203
親投資信託受益証券	439,898,253	1,308,628,317
未収入金	8,000	64,000
流動資産合計	440,955,653	1,310,617,520
資産合計	440,955,653	1,310,617,520
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	15,100,197	18,718,002
未払受託者報酬	51,322	93,653
未払委託者報酬	963,022	1,756,840
その他未払費用	12,748	23,339
流動負債合計	16,127,289	20,591,834
負債合計	16,127,289	20,591,834
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 503,339,911	<sup>1</sup> 1,101,058,979
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 78,511,547	<sup>2</sup> 188,966,707
（分配準備積立金）	11,690,648	199,438,661
元本等合計	424,828,364	1,290,025,686
純資産合計	424,828,364	1,290,025,686
負債純資産合計	440,955,653	1,310,617,520

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	2019年6月18日 至 2020年6月15日	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		76,530,710		303,882,064
<b>営業収益合計</b>		<b>76,530,710</b>		<b>303,882,064</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		103		28
受託者報酬		108,804		140,867
委託者報酬		2,041,837		2,642,831
その他費用		27,185		35,069
<b>営業費用合計</b>		<b>2,177,929</b>		<b>2,818,795</b>
営業利益又は営業損失( )		78,708,639		301,063,269
経常利益又は経常損失( )		78,708,639		301,063,269
当期純利益又は当期純損失( )		78,708,639		301,063,269
期首剰余金又は期首欠損金( )		15,297,289		78,511,547
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		14,867,013
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		14,867,013
分配金		1 15,100,197		1 18,718,002
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>78,511,547</b>		<b>188,966,707</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6月16日	至 2021年6月15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6月15日現在	2021年6月15日現在
1. 1 期首元本額	503,339,911円	503,339,911円
期中追加設定元本額	- 円	597,719,068円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	503,339,911口	1,101,058,979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78,511,547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6月18日 至 2020年6月15日	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日

<p>1 分配金の計算過程</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(15,888,615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(46,291円)及び分配準備積立金(10,902,230円)より分配対象額は26,837,136円(1万口当たり533.18円)であり、うち15,100,197円(1万口当たり300円)を分配金額としております。</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(20,061,888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(186,404,127円)、投資信託約款に規定される収益調整金(14,818,940円)及び分配準備積立金(11,690,648円)より分配対象額は232,975,603円(1万口当たり2,115.92円)であり、うち18,718,002円(1万口当たり170円)を分配金額としております。</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6月16日 至 2021年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第4期	第5期
	2020年6月15日現在	2021年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	76,464,125	303,617,375
合計	76,464,125	303,617,375

## (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6月15日現在	2021年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第5期
自 2020年6月16日
至 2021年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第4期 2020年6月15日現在	第5期 2021年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8440円 (8,440円)	1.1716円 (11,716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	447,317,832	1,308,628,317	
親投資信託受益証券 合計			1,308,628,317	
合計			1,308,628,317	

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「ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)」に記載のとおりであります。



【ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年6月16日から2021年12月15日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。



## 1【中間財務諸表】

## ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,216,369
親投資信託受益証券		2,247,662,039
流動資産合計		2,252,878,408
資産合計		2,252,878,408
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		323,698
未払委託者報酬		4,694,237
その他未払費用		80,849
流動負債合計		5,098,784
負債合計		5,098,784
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,679,892,852
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		567,886,772
(分配準備積立金)		47,614,544
元本等合計		2,247,779,624
純資産合計		2,247,779,624
負債純資産合計		2,252,878,408

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	92,045,225
<b>営業収益合計</b>	92,045,225
<b>営業費用</b>	
支払利息	435
受託者報酬	323,698
委託者報酬	4,694,237
その他費用	80,849
<b>営業費用合計</b>	5,099,219
<b>営業利益</b>	86,946,006
<b>経常利益</b>	86,946,006
<b>中間純利益</b>	86,946,006
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	51,065,073
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	718,740,106
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	202,314,887
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	202,314,887
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	389,049,154
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	389,049,154
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	567,886,772

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	2,239,926,064円
期中追加設定元本額	660,927,562円
期中一部解約元本額	1,220,960,774円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,679,892,852口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3380円 (13,380円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,292,619,311
株式	2 3 186,604,672,470
派生商品評価勘定	500,050
未収入金	86,600,000
未収配当金	18,626,880

未収利息		188,900
前払金		15,060,000
その他未収収益	4	3,238,847
流動資産合計		197,021,506,458
資産合計		197,021,506,458
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		237,750
未払金		3,991,882,530
未払解約金		75,868,650
受入担保金		4,139,642,325
流動負債合計		8,207,631,255
負債合計		8,207,631,255
純資産の部		
元本等		
元本	1	139,659,632,352
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		49,154,242,851
元本等合計		188,813,875,203
純資産合計		188,813,875,203
負債純資産合計		197,021,506,458

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月15日現在
<p>1. 1 期首</p> <p>期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p> <p>期末元本額の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>トピックス・インデックス ファンド</p> <p>ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A</p> <p>適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2</p> <p>ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p>	<p>2021年6月16日</p> <p>136,188,256,579円</p> <p>10,688,899,262円</p> <p>7,217,523,489円</p> <p>2,983,450,597円</p> <p>5,608,193,954円</p> <p>924,019円</p> <p>24,862,174円</p>

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	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)	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)	711,960,045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)	256,044,011円
D-I's TOPIXイン デックス	46,450,618円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	155,237,562円
iFree TOPIXイン デックス	5,052,378,967円
iFree 8資産バランス	3,349,718,126円
iFree 年金バランス	548,924,904円
DCダイワ日本株式インデッ クス	66,555,832,897円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,093,102,247円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,262,979,886円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,154,368,558円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,025,121,381円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	56,773,613円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	60,560,892円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,557,663,378円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,529,649円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,111,509円
ダイワつみたてインデックス バランス70	19,885,938円

	ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	721,033円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	112,385,430円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	130,510,052円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,933,455,693円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	526,703,681円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	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)	141,439,467円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	198,608,434円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,241,198,482円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,662,471,923円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,716,517,385円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,175,808,873円
	ダイワライフスタイル25	151,497,018円
	ダイワライフスタイル50	600,193,646円
	ダイワライフスタイル75	480,225,290円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	10,526,693,687円
	計	139,659,632,352円
2.	期末日における受益権の総数	139,659,632,352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 3,933,861,100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 982,180,000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2,934,610円が含まれております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,261,435,000	-	2,261,760,000	325,000
合計	2,261,435,000	-	2,261,760,000	325,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.3520円
（1万口当たり純資産額）	（13,520円）

【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		1,482,780
親投資信託受益証券		1,933,300,462
未収入金		40,000
流動資産合計		1,934,823,242
<b>資産合計</b>		
1,934,823,242		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		75,878
未払委託者報酬		1,100,964
その他未払費用		18,886
流動負債合計		1,195,728
<b>負債合計</b>		
1,195,728		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1,292,260,207
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		641,367,307
(分配準備積立金)		65,317,451
元本等合計		1,933,627,514
<b>純資産合計</b>		
1,933,627,514		
<b>負債純資産合計</b>		
1,934,823,242		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	1
有価証券売買等損益	3,681,054
営業収益合計	3,681,055
<b>営業費用</b>	
支払利息	49
受託者報酬	75,878
委託者報酬	1,100,964
その他費用	18,886
営業費用合計	1,195,777
<b>営業利益</b>	2,485,278
経常利益	2,485,278
<b>中間純利益</b>	2,485,278
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	481,781
期首剰余金又は期首欠損金( )	153,844,491
剰余金増加額又は欠損金減少額	494,293,871
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	494,293,871
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,774,552
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,774,552
中間剰余金又は中間欠損金( )	641,367,307

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	285,541,229円
期中追加設定元本額	1,023,117,790円
期中一部解約元本額	16,398,812円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,292,260,207口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4963円 (14,963円)

（参考）

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

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

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,662,209,950
株式	200,256,917,360
派生商品評価勘定	28,515,000
未収利息	343,376
その他未収収益	261,265

流動資産合計		209,948,246,951
資産合計		209,948,246,951
負債の部		
流動負債		
前受金		15,120,000
未払解約金		90,910,000
受入担保金		6,755,661,885
流動負債合計		6,861,691,885
負債合計		6,861,691,885
純資産の部		
元本等		
元本	1	54,488,045,903
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		148,598,509,163
元本等合計		203,086,555,066
純資産合計		203,086,555,066
負債純資産合計		209,948,246,951

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引



3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	50,206,993,331円
期中追加設定元本額	10,561,010,696円
期中一部解約元本額	6,279,958,124円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファ ンド225	22,362,032,341円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	321,702,255円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	7,457,700,199円
D-I's 日経225イン デックス	110,356,384円
iFree 日経225イン デックス	7,477,275,314円
DC・ダイワ・ストックイン デックス225(確定拠出年 金専用ファンド)	5,609,641,012円
ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	404,440,455円
ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	3,888,539,039円
ダイワ日経225インデック ス(ダイワSMA専用)	518,700,489円
ダイワ・インデックスセレク ト 日経225	6,337,658,415円
計	54,488,045,903円
2. 期末日における受益権の総数	54,488,045,903口

3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。	株式	6,388,310,900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	2,687,320,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,818,430,000	-	2,847,000,000	28,570,000
合計	2,818,430,000	-	2,847,000,000	28,570,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	3.7272円
（1万口当たり純資産額）	（37,272円）

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年6月16日から2021年12月15日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		28,538,353
親投資信託受益証券		12,397,314,188
未収入金		48,680,000
流動資産合計		12,474,532,541
<b>資産合計</b>		
12,474,532,541		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		48,256,061
未払受託者報酬		1,314,191
未払委託者報酬		25,298,912
その他未払費用		328,469
流動負債合計		75,197,633
<b>負債合計</b>		
75,197,633		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		17,392,215,225
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		5,007,119,683
(分配準備積立金)		1,669,815,281
元本等合計		12,399,334,908
<b>純資産合計</b>		
12,399,334,908		
<b>負債純資産合計</b>		
12,474,532,541		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	864,607,625
<b>営業収益合計</b>	864,607,625
<b>営業費用</b>	
支払利息	2,397
受託者報酬	1,314,191
委託者報酬	25,298,912
その他費用	328,469
<b>営業費用合計</b>	26,943,969
<b>営業利益</b>	837,663,656
<b>経常利益</b>	837,663,656
<b>中間純利益</b>	837,663,656
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	240,079,327
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,083,726,447
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	1,573,209,958
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,573,209,958
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	1,247,401,051
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,247,401,051
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	5,007,119,683

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	7,124,652,730円
期中追加設定元本額	2,400,464,517円
期中一部解約元本額	2,132,902,022円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	7,392,215,225口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6774円 (16,774円)

（参考）

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	167,430,221
コール・ローン	3,244,169,784
株式	76,260,268,293
投資証券	1,916,821,621
派生商品評価勘定	22,226,714



未収入金		12,677,622
未収配当金		77,044,622
差入委託証拠金		998,723,805
流動資産合計		82,699,362,682
資産合計		82,699,362,682
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		337,525,669
未払解約金		57,610,000
その他未払費用		1,204,459
流動負債合計		396,340,128
負債合計		396,340,128
純資産の部		
元本等		
元本	1	27,927,053,232
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,375,969,322
元本等合計		82,303,022,554
純資産合計		82,303,022,554
負債純資産合計		82,699,362,682

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

	<p>(2)投資証券</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	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	26,814,400,442円
期中追加設定元本額	3,741,468,468円
期中一部解約元本額	2,628,815,678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）	20,981,225,390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）	1,139,886,333円
iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,599,326,807円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	4,206,614,702円
計	27,927,053,232円
2. 期末日における受益権の総数	27,927,053,232口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

	<p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 株式関連

種 類	2021年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	4,379,125,331	-	4,347,287,635	31,837,696
合計	4,379,125,331	-	4,347,287,635	31,837,696

#### （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
売 建	79,408,898,844	-	79,692,360,103	283,461,259
アメリカ・ドル	58,843,215,058	-	59,141,774,392	298,559,334
イギリス・ポンド	3,330,990,376	-	3,330,126,909	863,467
イスラエル・ シケル	111,030,569	-	111,777,573	747,004
オーストラリア・ ドル	1,599,540,976	-	1,601,448,849	1,907,873
カナダ・ドル	2,766,811,644	-	2,761,615,154	5,196,490
シンガポール・ ドル	246,096,784	-	246,390,606	293,822
スイス・フラン	2,364,582,602	-	2,365,741,738	1,159,136
スウェーデン・ クローナ	937,294,630	-	929,046,646	8,247,984
デンマーク・ クローネ	645,160,385	-	644,700,630	459,755
ニュージー ランド・ドル	51,691,871	-	51,276,441	415,430
ノルウェー・ クローネ	165,705,229	-	165,530,318	174,911
ユーロ	7,678,831,006	-	7,671,964,680	6,866,326
香港・ドル	667,947,714	-	670,966,167	3,018,453
合計	79,408,898,844	-	79,692,360,103	283,461,259

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
  3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	2.9471円
(1万口当たり純資産額)	(29,471円)

**【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2021年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	24,118,986
親投資信託受益証券	7,867,250,226
未収入金	28,591,200
流動資産合計	7,919,960,412
<b>資産合計</b>	
7,919,960,412	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	28,400,578
未払受託者報酬	1,151,950
未払委託者報酬	22,175,877
その他未払費用	287,910
流動負債合計	52,016,315
<b>負債合計</b>	
52,016,315	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 4,349,500,216
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,518,443,881
(分配準備積立金)	704,950,201
元本等合計	7,867,944,097
<b>純資産合計</b>	
7,867,944,097	
<b>負債純資産合計</b>	
7,919,960,412	



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	1,016,609,652
<b>営業収益合計</b>	<b>1,016,609,652</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	2,233
受託者報酬	1,151,950
委託者報酬	22,175,877
その他費用	287,910
<b>営業費用合計</b>	<b>23,617,970</b>
<b>営業利益</b>	<b>992,991,682</b>
<b>経常利益</b>	<b>992,991,682</b>
<b>中間純利益</b>	<b>992,991,682</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	463,187,683
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,348,264,600
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>1,242,708,554</b>
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,242,708,554
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>2,602,333,272</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,602,333,272
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>3,518,443,881</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	6,496,771,590円
期中追加設定元本額	1,665,637,161円
期中一部解約元本額	3,812,908,535円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	4,349,500,216口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8089円 (18,089円)

（参考）

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,141,801,306
コール・ローン	4,330,272,293
株式	234,512,577,339
投資証券	5,874,604,399
派生商品評価勘定	11,693,173

未収入金		36,987,145
未収配当金		232,342,288
差入委託証拠金		5,021,207,255
流動資産合計		251,161,485,198
資産合計		251,161,485,198
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		78,516,491
未払解約金		35,359,500
その他未払費用		601,560
流動負債合計		114,477,551
負債合計		114,477,551
純資産の部		
元本等		
元本	1	61,469,311,016
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		189,577,696,631
元本等合計		251,047,007,647
純資産合計		251,047,007,647
負債純資産合計		251,161,485,198

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

	<p>(2)投資証券</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>(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>

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	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	58,443,353,703円
期中追加設定元本額	6,288,211,464円
期中一部解約元本額	3,262,254,151円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックス V A	371,526,974円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	4,453,234円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	59,715,729円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	234,345,757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)	39,107,098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)	502,310,593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)	2,525,638,522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)	510,797,040円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	14,043,838円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	33,650,457円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	4,159,923,885円
i F r e e 8資産バランス	1,117,276,703円
i F r e e 年金バランス	181,903,714円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	38,555,568,983円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	506,543,746円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	928,569,141円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	752,615,509円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,725,737,175円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,704,253円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	11,128,424円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	822,319,997円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	1,690,959円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	2,170,844円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	3,645,733円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	107,772,790円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	208,616,060円

ダイワ・バランスファンド3 5 V A	1,455,327,992円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専 用)	73,750,723円
ダイワバランスファンド 2020-07 (適格機関投資家専 用)	194,296,563円
ダイワバランスファンド 2021-02 (適格機関投資家専 用)	209,089,795円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	939,859,791円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	330,463,362円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ S M A 専用)	1,926,311,850円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,837,394,294円
ダイワライフスタイル2 5	12,346,386円
ダイワライフスタイル5 0	49,684,792円
ダイワライフスタイル7 5	39,599,495円
計	61,469,311,016円
2. 期末日における受益権の総数	61,469,311,016口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。



（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 株式関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	10,538,090,603	-	10,460,962,666	77,127,937
合計	10,538,090,603	-	10,460,962,666	77,127,937

#### （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	4,224,910,843	-	4,235,215,462	10,304,619
アメリカ・ドル	2,485,743,185	-	2,496,516,175	10,772,990
イギリス・ポンド	192,711,783	-	192,734,848	23,065

オーストラリア・ドル	246,313,650	-	246,709,010	395,360
カナダ・ドル	188,262,773	-	187,637,384	625,389
スイス・フラン	264,781,714	-	265,038,025	256,311
ユーロ	847,097,738	-	846,580,020	517,718
合計	4,224,910,843	-	4,235,215,462	10,304,619

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	4.0841円
(1万口当たり純資産額)	(40,841円)

**【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		18,773,264
親投資信託受益証券		13,566,782,242
未収入金		37,851,906
流動資産合計		13,623,407,412
<b>資産合計</b>		
13,623,407,412		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		37,651,452
未払受託者報酬		389,303
未払委託者報酬		4,866,812
その他未払費用		194,572
流動負債合計		43,102,139
<b>負債合計</b>		
43,102,139		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 13,309,548,778
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		270,756,495
(分配準備積立金)		33,227,333
元本等合計		13,580,305,273
<b>純資産合計</b>		
13,580,305,273		
<b>負債純資産合計</b>		
13,623,407,412		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	15,644,467
<b>営業収益合計</b>	<b>15,644,467</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	1,420
受託者報酬	389,303
委託者報酬	4,866,812
その他費用	194,572
<b>営業費用合計</b>	<b>5,452,107</b>
営業利益又は営業損失（ ）	10,192,360
経常利益又は経常損失（ ）	10,192,360
中間純利益又は中間純損失（ ）	10,192,360
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	50,385
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	111,522,719
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>155,698,315</b>
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	155,698,315
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>6,606,514</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,606,514
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>270,756,495</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	5,663,399,869円
期中追加設定元本額	7,978,866,904円
期中一部解約元本額	332,717,995円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	13,309,548,778口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0203円 (10,203円)

## (参考)

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

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

## 「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	286,315,612
国債証券	89,288,414,970
地方債証券	3,515,091,100
特殊債券	2,704,166,300

社債券		3,076,879,100
未収入金		127,627,400
未収利息		215,368,019
前払費用		9,906,344
流動資産合計		99,223,768,845
資産合計		99,223,768,845
負債の部		
流動負債		
未払金		100,000,000
未払解約金		155,864,679
流動負債合計		255,864,679
負債合計		255,864,679
純資産の部		
元本等		
元本	1	69,656,327,517
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,311,576,649
元本等合計		98,967,904,166
純資産合計		98,967,904,166
負債純資産合計		99,223,768,845

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>



## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	64,064,308,423円
期中追加設定元本額	9,459,376,971円
期中一部解約元本額	3,867,357,877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)	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)	407,474,559円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	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)	688,013,151円
DCダイワ日本債券インデッ クス	9,557,661,486円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	704,912円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	9,971,276,571円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,669,084,886円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	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)	314,922,939円
ダイワ・ノーロード 日本債 券ファンド	61,576,640円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	26,040,464,350円

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	9,548,692,457円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,145,581,703円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	947,506,175円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,767,401,283円
ダイワライフスタイル25	476,261,428円
ダイワライフスタイル50	577,799,511円
ダイワライフスタイル75	154,420,143円
計	69,656,327,517円
2. 期末日における受益権の総数	69,656,327,517口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.4208円
(1万口当たり純資産額)	(14,208円)



**【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年6月16日から2021年12月15日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2021年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	73,633,945
親投資信託受益証券	17,787,306,451
未収入金	45,246,841
流動資産合計	17,906,187,237
<b>資産合計</b>	
17,906,187,237	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	45,227,034
未払受託者報酬	1,107,814
未払委託者報酬	19,941,330
その他未払費用	415,348
流動負債合計	66,691,526
<b>負債合計</b>	
66,691,526	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1 16,498,304,681
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,341,191,030
(分配準備積立金)	171,417,818
元本等合計	17,839,495,711
<b>純資産合計</b>	
17,839,495,711	
<b>負債純資産合計</b>	
17,906,187,237	

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	120,180,834
<b>営業収益合計</b>	<b>120,180,834</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	6,257
受託者報酬	1,107,814
委託者報酬	19,941,330
その他費用	415,348
<b>営業費用合計</b>	<b>21,470,749</b>
<b>営業利益</b>	<b>98,710,085</b>
<b>経常利益</b>	<b>98,710,085</b>
<b>中間純利益</b>	<b>98,710,085</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	2,478,300
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	552,166,225
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>726,573,961</b>
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	726,573,961
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>33,780,941</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,780,941
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>1,341,191,030</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	7,628,232,231円
期中追加設定元本額	9,330,481,080円
期中一部解約元本額	460,408,630円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	16,498,304,681口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0813円 (10,813円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	234,035,229
コール・ローン	878,282,624
国債証券	135,757,307,556
派生商品評価勘定	5,696,342
未収利息	752,630,617



前払費用		64,193,486
差入委託証拠金		238,614,862
流動資産合計		137,930,760,716
資産合計		137,930,760,716
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		408,863,771
未払解約金		54,220,844
流動負債合計		463,084,615
負債合計		463,084,615
純資産の部		
元本等		
元本	1	130,831,929,604
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,635,746,497
元本等合計		137,467,676,101
純資産合計		137,467,676,101
負債純資産合計		137,930,760,716

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15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	(1)先物取引

<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>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
-----------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	113,403,229,819円
期中追加設定元本額	21,384,485,338円
期中一部解約元本額	3,955,785,553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	102,316,467,332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イン 外国債券インデックス	4,965,036,566円
（為替ヘッジあり）	
ダイワ先進国債券インデックス	959,893円
（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	

ダイワバランスファンド 2020-07（適格機関投資家専用）	3,317,537,196円
ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	3,302,922,762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）	16,929,005,855円
計	130,831,929,604円
2. 期末日における受益権の総数	130,831,929,604口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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>

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

売 建	136,592,906,102	-	136,996,073,531	403,167,429
アメリカ・ドル	65,375,688,937	-	65,563,591,742	187,902,805
イギリス・ ポンド	8,384,334,392	-	8,404,126,194	19,791,802
イスラエル・ シュケル	615,013,285	-	618,591,215	3,577,930
オーストラ リア・ドル	2,215,509,819	-	2,227,062,429	11,552,610
オフショア・ 人民元	569,827,324	-	574,677,809	4,850,485
カナダ・ドル	2,632,651,830	-	2,634,143,903	1,492,073
シンガポー ル・ドル	549,638,188	-	551,645,340	2,007,152
スウェーデン・ クローナ	352,924,114	-	351,094,908	1,829,206
デンマーク・ クローネ	625,808,597	-	627,714,532	1,905,935
ノルウェー・ クローネ	298,988,512	-	300,074,170	1,085,658
ポーランド・ ズロチ	640,659,418	-	647,372,785	6,713,367
マレーシア・ リングット	583,070,020	-	579,202,884	3,867,136
メキシコ・ ペソ	857,019,887	-	873,281,131	16,261,244
ユーロ	52,891,771,779	-	53,043,494,489	151,722,710
合計	136,592,906,102	-	136,996,073,531	403,167,429

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.0507円
(1万口当たり純資産額)	(10,507円)

**【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		35,286,527
親投資信託受益証券		7,472,549,742
未収入金		25,179,717
流動資産合計		7,533,015,986
<b>資産合計</b>		
7,533,015,986		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		25,183,191
未払受託者報酬		693,448
未払委託者報酬		12,482,942
その他未払費用		259,970
流動負債合計		38,619,551
<b>負債合計</b>		
38,619,551		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 6,597,890,876
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		896,505,559
（分配準備積立金）		142,521,453
元本等合計		7,494,396,435
<b>純資産合計</b>		
7,494,396,435		
<b>負債純資産合計</b>		
7,533,015,986		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	38,987,580
営業収益合計	38,987,580
営業費用	
支払利息	3,966
受託者報酬	693,448
委託者報酬	12,482,942
その他費用	259,970
営業費用合計	13,440,326
営業利益	25,547,254
経常利益	25,547,254
中間純利益	25,547,254
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	1,784,443
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	644,954,409
剰余金増加額又は欠損金減少額	304,651,228
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	304,651,228
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,862,889
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,862,889
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	896,505,559



## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	4,925,705,481円
期中追加設定元本額	2,256,986,608円
期中一部解約元本額	584,801,213円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	6,597,890,876口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1359円 (11,359円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	425,409,685
コール・ローン	1,078,323,427
国債証券	232,326,985,094
派生商品評価勘定	1,512,215
未収入金	16,245

未収利息		1,193,186,819
前払費用		26,903,569
流動資産合計		235,052,337,054
資産合計		235,052,337,054
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		516,442
未払金		390,208
未払解約金		100,254,028
流動負債合計		101,160,678
負債合計		101,160,678
純資産の部		
元本等		
元本	1	74,630,555,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		160,320,621,050
元本等合計		234,951,176,376
純資産合計		234,951,176,376
負債純資産合計		235,052,337,054

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	72,148,022,911円
期中追加設定元本額	4,921,512,116円
期中一部解約元本額	2,438,979,701円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックス VA	498,028,337円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	78,767,109円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	310,517,521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)	214,612,921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)	508,084,428円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,336,053,684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 ジ ングプラス(為替 ヘッジなし)	844,973,219円
D-I's 外国債券インデッ クス	756,455円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	7,274,028円
iFree 外国債券イン デックス	1,734,667,289円
iFree 8資産バランス	1,445,464,175円
iFree 年金バランス	234,965,679円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,646,457,729円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	976,196,001円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	609,838,233円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	396,812,649円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	579,169,883円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コ ース)	442,740,702円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	161,834,941円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	29,573,203円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	10,681,156円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	625,205,671円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,401,002円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,455,437円
ダイワつみたてインデックス バランス70	1,897,080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)	317,987円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	164,717,681円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	136,633,533円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,863,177,059円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	229,414,922円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	143,382,715円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	43,741,073円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	2,373,594,353円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,827,876,220円
ダイワライフスタイル25	33,009,183円
ダイワライフスタイル50	65,126,638円
ダイワライフスタイル75	17,354,980円
計	74,630,555,326円
2. 期末日における受益権の総数	74,630,555,326口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2021年12月15日現在
----	---------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	906,390,623	-	907,386,396	995,773
アメリカ・ドル	484,242,821	-	485,136,070	893,249
イギリス・ポンド	76,845,564	-	76,493,166	352,398
シンガポール・ドル	31,361,148	-	31,386,020	24,872
ユーロ	313,941,090	-	314,371,140	430,050
合計	906,390,623	-	907,386,396	995,773

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	3,1482円
(1万口当たり純資産額)	(31,482円)



【ダイワJ - REITインデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2021年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,182,688
親投資信託受益証券	1,249,981,974
未収入金	13,820,000
流動資産合計	1,265,984,662
<b>資産合計</b>	
1,265,984,662	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	13,785,676
未払受託者報酬	101,921
未払委託者報酬	1,478,401
その他未払費用	25,408
流動負債合計	15,391,406
<b>負債合計</b>	
15,391,406	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,017,988,496
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	232,604,760
（分配準備積立金）	25,452,527
元本等合計	1,250,593,256
<b>純資産合計</b>	
1,250,593,256	
<b>負債純資産合計</b>	
1,265,984,662	

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	21,412,152
<b>営業収益合計</b>	<b>21,412,152</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	121
受託者報酬	101,921
委託者報酬	1,478,401
その他費用	25,408
<b>営業費用合計</b>	<b>1,605,851</b>
営業利益又は営業損失（ ）	23,018,003
経常利益又は経常損失（ ）	23,018,003
中間純利益又は中間純損失（ ）	23,018,003
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	5,248,385
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	289,596,871
剰余金増加額又は欠損金減少額	217,770,216
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	217,770,216
剰余金減少額又は欠損金増加額	256,992,709
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	256,992,709
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	232,604,760

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,040,271,027円
期中追加設定元本額	906,767,146円
期中一部解約元本額	929,049,677円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,017,988,496口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2285円 (12,285円)

（参考）

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

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

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2021年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,768,955,766
投資証券	2	437,840,826,750
派生商品評価勘定		58,184,000
未収入金		4,400,914,986
未収配当金		2,569,717,672

流動資産合計		454,638,599,174
資産合計		454,638,599,174
負債の部		
流動負債		
前受金		67,200,000
未払解約金		2,567,787,000
流動負債合計		2,634,987,000
負債合計		2,634,987,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	134,155,204,434
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		317,848,407,740
元本等合計		452,003,612,174
純資産合計		452,003,612,174
負債純資産合計		454,638,599,174

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	140,780,222,102円
期中追加設定元本額	8,627,425,171円
期中一部解約元本額	15,252,442,839円

ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	955,720,270円
計	134,155,204,434円
2. 期末日における受益権の総数	134,155,204,434口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,660,800,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2021年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	11,208,400,000	-	11,267,200,000	58,800,000
合計	11,208,400,000	-	11,267,200,000	58,800,000



（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	3,369.3円
（1万口当たり純資産額）	（33,693円）

**【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2021年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	7,590,403
親投資信託受益証券	4,764,931,769
派生商品評価勘定	469,517
未収入金	16,442,344
流動資産合計	4,789,434,033
資産合計	4,789,434,033
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,956,471
未払金	175,872
未払解約金	16,488,995
未払受託者報酬	433,557
未払委託者報酬	8,130,139
その他未払費用	108,315
流動負債合計	46,293,349
負債合計	46,293,349
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,377,808,445
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	971,332,239
(分配準備積立金)	490,889,720
元本等合計	4,743,140,684
純資産合計	4,743,140,684
負債純資産合計	4,789,434,033

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	344,143,123
為替差損益	69,080,003
営業収益合計	275,063,120
<b>営業費用</b>	
支払利息	502
受託者報酬	433,557
委託者報酬	8,130,139
その他費用	123,702
営業費用合計	8,687,900
<b>営業利益</b>	266,375,220
経常利益	266,375,220
<b>中間純利益</b>	266,375,220
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	42,574,788
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	552,571,123
剰余金増加額又は欠損金減少額	342,420,860
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	342,420,860
剰余金減少額又は欠損金増加額	147,460,176
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	147,460,176
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	971,332,239

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2021年6月16日	2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	2,993,845,190円
期中追加設定元本額	1,549,551,765円
期中一部解約元本額	771,588,510円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,771,808,445口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2021年6月16日	2021年12月15日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末
	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種 類	当中間計算期間末			
	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	4,679,852,918	-	4,700,339,872	20,486,954
アメリカ・ドル	3,588,802,906	-	3,608,183,901	19,380,995
イギリス・ポンド	266,727,908	-	266,732,273	4,365
イスラエル・ シュケル	2,352,913	-	2,368,613	15,700
オーストラリア・ ドル	314,700,122	-	315,486,988	786,866
カナダ・ドル	101,961,756	-	101,844,322	117,434
シンガポール・ ドル	144,360,071	-	144,641,394	281,323
ニュージー ランド・ドル	12,977,763	-	12,886,691	91,072

ユーロ	185,091,462	-	185,018,511	72,951
香港・ドル	62,878,017	-	63,177,179	299,162
合計	4,679,852,918	-	4,700,339,872	20,486,954

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.2575円
（1万口当たり純資産額）	（12,575円）

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		234,139,478
コール・ローン		591,383,056
投資信託受益証券		581,532,908
投資証券		47,998,161,008
派生商品評価勘定		2,227,747
未収入金		2,220,220
未収配当金		128,682,459
差入委託証拠金		416,704,030
流動資産合計		49,955,050,906
資産合計		49,955,050,906
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		16,490,228
未払金		166,737,484
未払解約金		18,911,000
その他未払費用		4,400,381
流動負債合計		206,539,093
負債合計		206,539,093
純資産の部		
元本等		
元本	1	15,683,220,660
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,065,291,153
元本等合計		49,748,511,813
純資産合計		49,748,511,813
負債純資産合計		49,955,050,906

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15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> <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>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	14,827,050,251円
期中追加設定元本額	2,731,491,290円
期中一部解約元本額	1,875,320,881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）	6,294,630,795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）	1,146,858,265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）	336,171,178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）	286,805,566円
D - I ' s グローバルREI Tインデックス	1,918,728円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,673,981円
i F r e e 外国REITイ ンデックス	649,138,037円
i F r e e 8資産バランス	1,462,383,857円

グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	248,583,566円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	116,653,386円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	3,343,473,527円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,315,402円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,335,722円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	168,184,947円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	181,663,633円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	243,401,119円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	61,279,536円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	1,117,756,791円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	3,992,624円
計	15,683,220,660円
2. 期末日における受益権の総数	15,683,220,660口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 不動産投信関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	1,158,188,624	-	1,141,758,092	16,430,532
合計	1,158,188,624	-	1,141,758,092	16,430,532

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

#### 2. 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買 建	539,287,367	-	541,455,418	2,168,051
アメリカ・ドル	430,232,799	-	432,426,173	2,193,374
ユーロ	109,054,568	-	109,029,245	25,323
合計	539,287,367	-	541,455,418	2,168,051

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	3.1721円
(1万口当たり純資産額)	(31,721円)

## 「先進国REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年12月15日現在
	金 額 (円)
資産の部	

流動資産	
預金	5,407,602
コール・ローン	49,030,557
投資信託受益証券	61,682,680
投資証券	3,087,582,128
派生商品評価勘定	61,412
未収入金	62,770
未収配当金	8,708,579
差入委託証拠金	23,886,696
流動資産合計	3,236,422,424
資産合計	3,236,422,424
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	604,220
未払金	30,146,986
未払解約金	10,583,000
その他未払費用	472,494
流動負債合計	41,806,700
負債合計	41,806,700
純資産の部	
元本等	
元本	1 1,463,272,761
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,731,342,963
元本等合計	3,194,615,724
純資産合計	3,194,615,724
負債純資産合計	3,236,422,424

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

### 受取配当金

原則として、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。

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日
期首元本額	1,697,839,447円
期中追加設定元本額	124,765,290円
期中一部解約元本額	359,331,976円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイナミック・アロケーション・ファンド（適格機関投資家専用）	323,459,532円
先進国REITファンド（適格機関投資家専用）	411,674,237円
海外リート資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	14,267,256円
ターゲット・リターン（コスト控除後3%）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	34,826円
ターゲット・リターン（コスト控除後5%）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	61,837円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	12,889,500円
堅実バランスファンド - ハジメの一步 -	16,836,979円



DCダイナミック・アロケーション・ファンド	33,622,116円
ダイワ外国3資産アロケーション・ファンド(部分為替ヘッジあり)	91,936,439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)	558,490,039円
計	1,463,272,761円
2. 期末日における受益権の総数	1,463,272,761口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<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>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	45,682,570	-	45,078,900	603,670

合計	45,682,570	-	45,078,900	603,670

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2021年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	38,056,140	-	38,117,002	60,862
アメリカ・ドル	38,056,140	-	38,117,002	60,862
合計	38,056,140	-	38,117,002	60,862

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月15日現在
1口当たり純資産額	2.1832円
(1万口当たり純資産額)	(21,832円)

**【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		953,954
親投資信託受益証券		12,665,002
未収入金		2,000
流動資産合計		13,620,956
<b>資産合計</b>		
13,620,956		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		47,634
未払委託者報酬		894,162
その他未払費用		11,831
流動負債合計		953,627
<b>負債合計</b>		
953,627		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		10,000,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		2,667,329
(分配準備積立金)		1,810,773
元本等合計		12,667,329
<b>純資産合計</b>		
12,667,329		
<b>負債純資産合計</b>		
13,620,956		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	9,921,685
営業収益合計	9,921,685
営業費用	
支払利息	47
受託者報酬	47,634
委託者報酬	894,162
その他費用	11,831
営業費用合計	953,674
営業利益	8,968,011
経常利益	8,968,011
中間純利益	8,968,011
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	8,016,376
期首剰余金又は期首欠損金( )	188,966,707
剰余金減少額又は欠損金増加額	187,251,013
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	187,251,013
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,667,329

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,101,058,979円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	1,091,058,979円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	10,000,000口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年6月16日 至 2021年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
------------------------------------------------------------------------------------

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2667円 (12,667円)

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）」に記載のとおりであります。



## 2【ファンドの現況】

ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)

## 【純資産額計算書】

2021年12月30日

資産総額	2,308,731,551円
負債総額	25,063,403円
純資産総額( - )	2,283,668,148円
発行済数量	1,697,790,030口
1単位当たり純資産額( / )	1.3451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12月30日

資産総額	196,536,015,077円
負債総額	6,125,970,200円
純資産総額( - )	190,410,044,877円
発行済数量	140,075,113,463口
1単位当たり純資産額( / )	1.3593円

ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	1,927,867,072円
負債総額	276,098円
純資産総額( - )	1,927,590,974円
発行済数量	1,272,064,427口
1単位当たり純資産額( / )	1.5153円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	210,755,580,081円
------	------------------

負債総額	5,305,713,670円
純資産総額( - )	205,449,866,411円
発行済数量	54,422,590,050口
1単位当たり純資産額( / )	3.7751円

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	12,747,437,755円
負債総額	2,316,403円
純資産総額( - )	12,745,121,352円
発行済数量	7,351,855,146口
1単位当たり純資産額( / )	1.7336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12月30日

資産総額	86,848,151,758円
負債総額	1,391,977,834円
純資産総額( - )	85,456,173,924円
発行済数量	28,051,065,327口
1単位当たり純資産額( / )	3.0465円

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	7,870,459,512円
負債総額	505,539,552円
純資産総額( - )	7,364,919,960円
発行済数量	3,887,992,352口
1単位当たり純資産額( / )	1.8943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12月30日

資産総額	265,321,372,485円
負債総額	826,644,714円
純資産総額( - )	264,494,727,771円
発行済数量	61,832,278,867口
1単位当たり純資産額( / )	4.2776円

ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	13,525,610,038円
負債総額	4,002,780円
純資産総額( - )	13,521,607,258円
発行済数量	13,291,176,026口
1単位当たり純資産額( / )	1.0173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12月30日

資産総額	98,817,561,909円
負債総額	134,549,603円
純資産総額( - )	98,683,012,306円
発行済数量	69,655,251,102口
1単位当たり純資産額( / )	1.4167円

ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	17,547,543,701円
負債総額	3,100,561円
純資産総額( - )	17,544,443,140円
発行済数量	16,445,199,258口
1単位当たり純資産額( / )	1.0668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12月30日

資産総額	139,146,592,432円
負債総額	2,579,693,739円
純資産総額( - )	136,566,898,693円
発行済数量	131,719,288,897口
1単位当たり純資産額( / )	1.0368円

ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	7,483,727,981円
負債総額	1,309,147円
純資産総額( - )	7,482,418,834円
発行済数量	6,571,226,098口
1単位当たり純資産額( / )	1.1387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12月30日

資産総額	237,766,390,004円
負債総額	1,116,636,911円
純資産総額( - )	236,649,753,093円
発行済数量	74,973,058,114口
1単位当たり純資産額( / )	3.1565円

ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	1,266,651,317円
負債総額	178,396円
純資産総額( - )	1,266,472,921円
発行済数量	1,013,178,105口
1単位当たり純資産額( / )	1.2500円

## (参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	457,958,450,802円
負債総額	854,894,354円
純資産総額( - )	457,103,556,448円
発行済数量	133,313,227,553口
1単位当たり純資産額( / )	3.4288円

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	4,963,850,670円
負債総額	88,596,832円
純資産総額( - )	4,875,253,838円
発行済数量	3,709,952,391口
1単位当たり純資産額( / )	1.3141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12月30日

資産総額	52,762,995,062円
負債総額	904,747円
純資産総額( - )	52,762,090,315円
発行済数量	15,710,011,732口
1単位当たり純資産額( / )	3.3585円

## (参考) 先進国REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	3,222,348,302円
負債総額	761円
純資産総額( - )	3,222,347,541円
発行済数量	1,391,351,165口
1単位当たり純資産額( / )	2.3160円

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

純資産額計算書

2021年12月30日

資産総額	13,411,512円
負債総額	2,314円
純資産総額( - )	13,409,198円
発行済数量	10,000,000口
1単位当たり純資産額( / )	1.3409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「ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)」の記載と同じ。

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2021年12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年間に於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12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	62	185,083
追加型株式投資信託	776	21,801,298
株式投資信託 合計	838	21,986,381
単位型公社債投資信託	77	213,611
追加型公社債投資信託	14	1,476,507
公社債投資信託 合計	91	1,690,119
総合計	929	23,676,500

## 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、改正府令附則第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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	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よう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  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)  不動産の賃借料(注4)	14,917  527	未払手数料  長期差入保証金	3,321  1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱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)	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

### 第3【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
- ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
- ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
  - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
  - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 使用開始日を記載することがあります。
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
  - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
  - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ・ 次の事項を記載することがあります。
  - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
- ・ 図案を採用することがあります。
- ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
- ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

**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」-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、「ダイワ」-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16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 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明 印  
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外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の監査報告書**

2021年7月16日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2020年6月16日から2021年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。



以 上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2022年1月28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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年6月16日から2021年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2021年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年6月16日から2021年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間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データは中間監査の対象には含まれていません。