【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年2月14日提出
【計算期間】	第1計算期間 （自　2022年2月18日　至　2022年11月21日）
【ファンド名】	ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用） ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）
【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　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、先進国の株式に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ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。

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。

商品分類表
〈ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）〉
〈ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）〉

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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）〉

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）	ファミリーファンド	あり（フルヘッジ）	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			
不動産投信	年4回	北米			
その他資産（投資信託証券（株式　一般））	年6回（隔月）	欧州			TOPIX
資産複合（　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回（毎月）	アジア			
	日々	オセアニア			
	その他（　）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））
		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。

属性区分表〈ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)〉

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

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

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

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人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5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・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 先進国の株式に投資し、投資成果をMSCIコクサイ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。

●以下の2つのファンドがあります。

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(注1)を用います。
MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。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。

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(注1)を用います。
MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

（注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）「先進国」…日本を除きます。
「株式」…DR（預託証券）を含みます。

※DR：Depositary Receiptの略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。また、通常は、預託された株式の通貨とは異なる通貨で取引されます。

運用プロセス

MSCIコクサイ指数について

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。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、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（当ファンド）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。

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

- 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。

分配方針

毎年11月20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、2022年11月20日（休業日の場合翌営業日）までとします。

［分配方針］

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●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。

●株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。

●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。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

●基準価額の動きに関する留意点

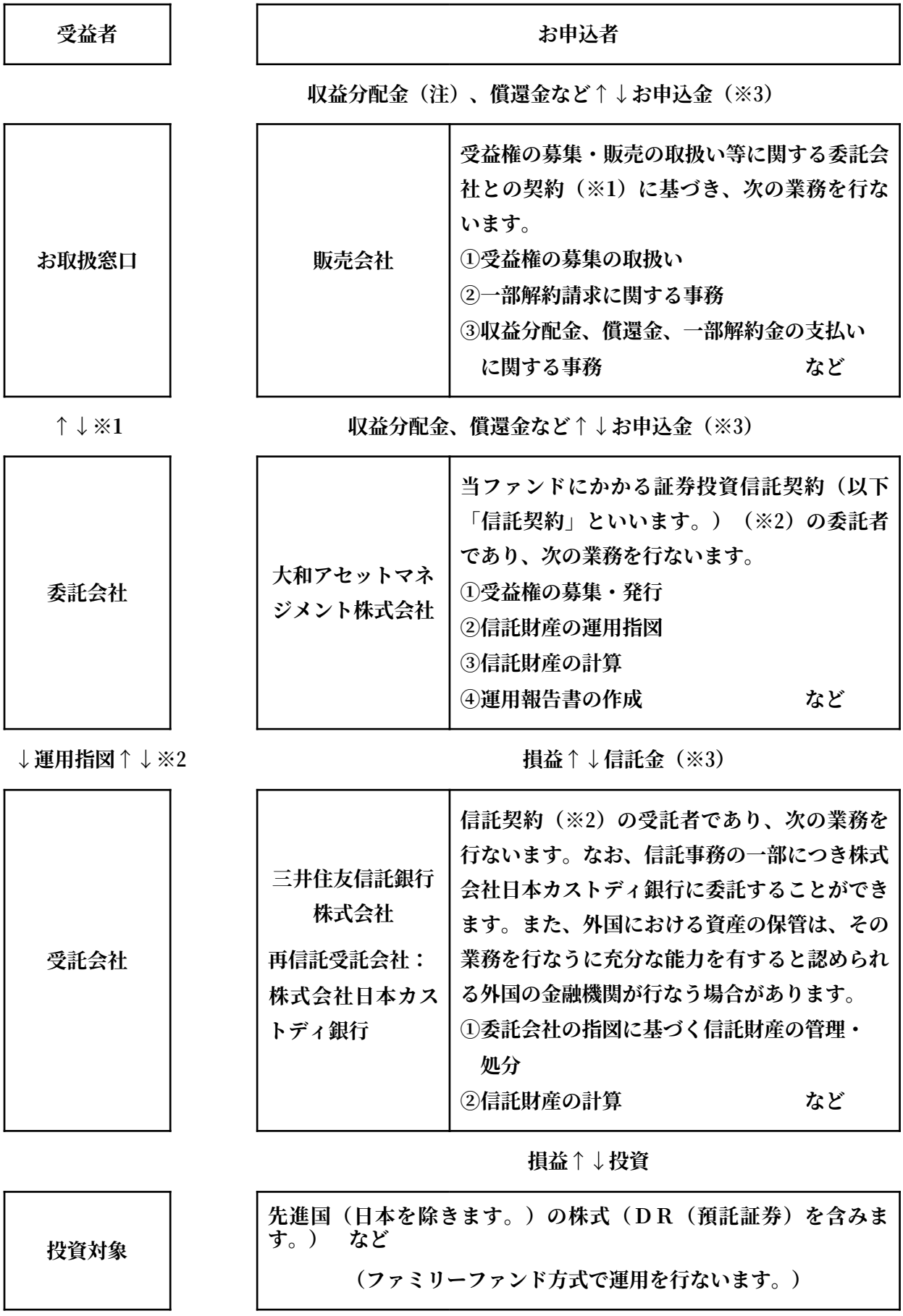
各ファンドはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）、MSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

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

(2)【ファンドの沿革】

2022年2月18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】



（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

＜委託会社の概況（2022年11月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

＜為替ヘッジあり＞

①　主要投資対象

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国の株式（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、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、保有外貨建資産について為替ヘッジを行ないます。

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

＜為替ヘッジなし＞

①　主要投資対象

外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国の株式（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。

※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】

＜各ファンド共通＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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)⑥、⑦および⑧に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された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。

1．株券または新株引受権証書

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および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前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、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

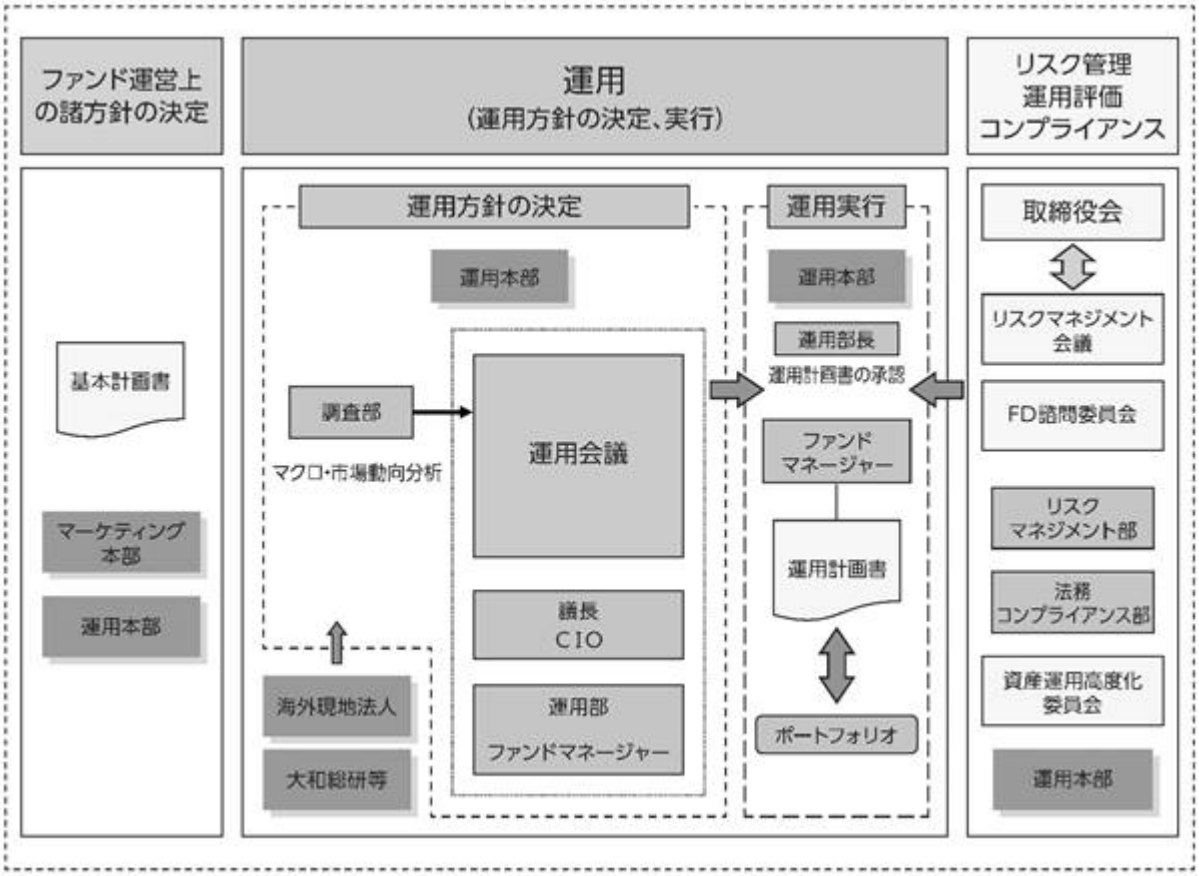
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品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。

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　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35～45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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2022年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

①　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③　投資信託証券（信託約款）

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。

④　投資する株式等の範囲（信託約款）

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。

⑤　信用取引

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

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

1．信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥　先物取引等（信託約款）

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。

⑦　スワップ取引（信託約款）

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

⑧　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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。

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

⑨　デリバティブ取引等（信託約款）

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。

⑩　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑪　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

⑫　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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。

⑬　外国為替予約取引（信託約款）

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。

⑭　信用リスク集中回避（信託約款）

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。

⑮　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜為替ヘッジあり＞

＜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）の概要

(1) 投資方針

①　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。

②　投資態度

イ．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。

ロ．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。

ハ．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。

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。

(2) 投資対象

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
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. 外国通貨表示の新株引受権証券（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、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. 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。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 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。）
19. 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。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.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.までの証券および前12.ならびに前16.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（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

②　投資信託証券

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

③　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

＜為替ヘッジなし＞

＜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）の概要

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

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

(2) 投資対象

①　委託会社は、信託金を、主として、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します。

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

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. 外国通貨表示の新株引受権証券（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、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. 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。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 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。）
19. 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。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.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.までの証券および前12.ならびに前16.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.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託会社は、信託金を、前①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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、株式など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 株価指数先物取引の利用に伴うリスク

株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。

③ 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。

「為替ヘッジあり」において、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減のために、為替ヘッジを行ないます。ただし、影響をすべて排除できるわけではありません。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。

「為替ヘッジなし」において、保有実質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。

④　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。

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金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、ご換金の申込みを取消すことがあります。

②　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。

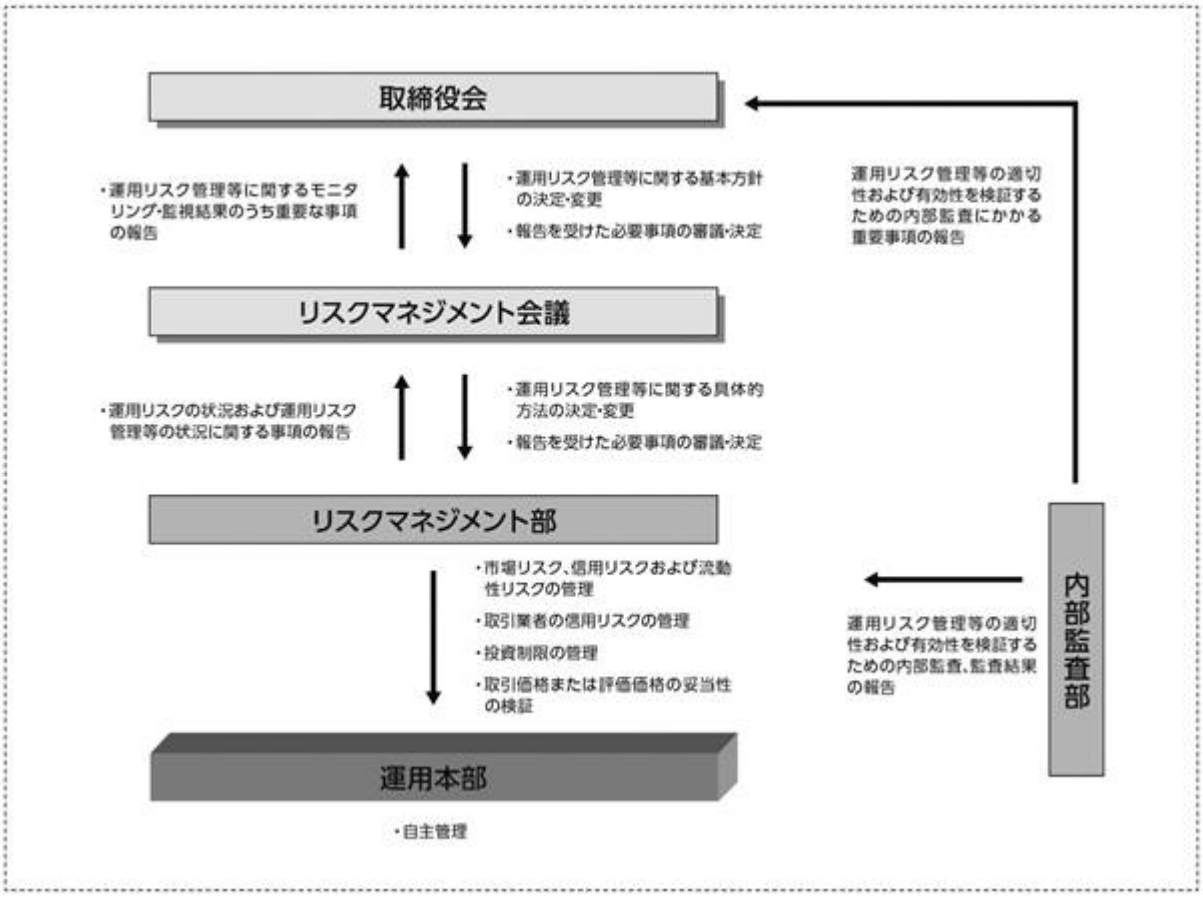
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

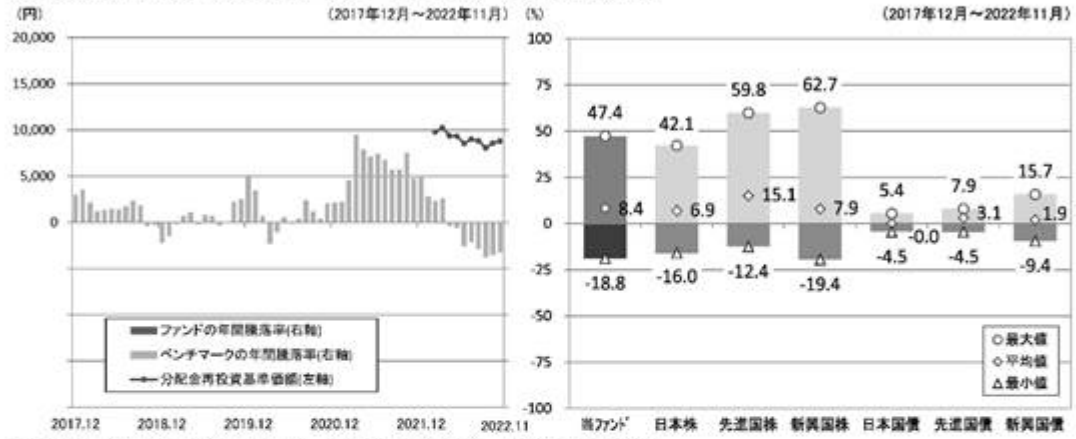
- **委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。**
- **取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

参考情報

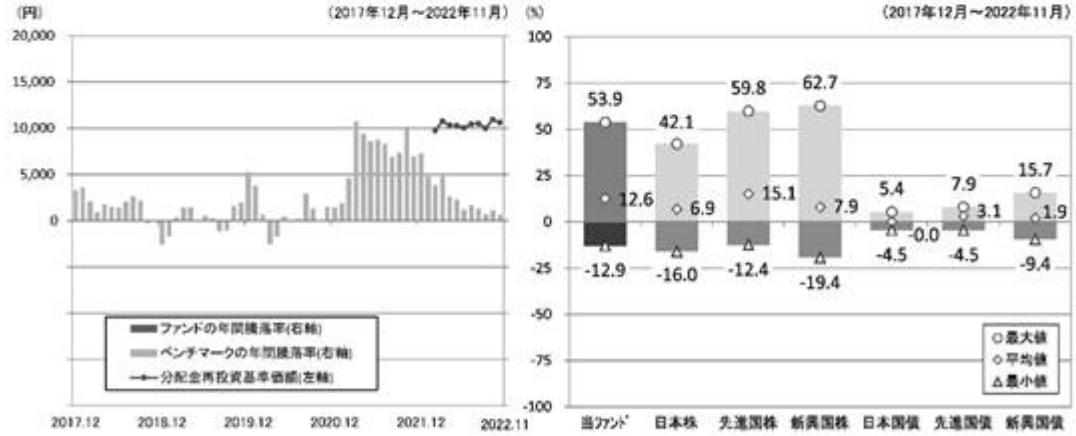
●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移　　**他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較**

［ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）］



［ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）］



※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― エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.2915％（税抜0.265%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.235% （税抜）	年率0.01% （税抜）	年率0.02% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）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。

② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

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

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

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

④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2022年11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】

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）】

(1)【投資状況】(2022年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		912,018	99.98
	内 日本	912,018	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		141	0.02
純資産総額		912,159	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】(2022年11月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	360,396	2.5315 912,343	2.5306 912,018	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
2022年2月末日	977,146	―	0.9771	―
3月末日	1,021,289	―	1.0213	―
4月末日	934,588	―	0.9346	―
5月末日	931,730	―	0.9317	―
6月末日	854,011	―	0.8540	―
7月末日	935,627	―	0.9004	―
8月末日	917,035	―	0.8825	―
9月末日	835,990	―	0.8045	―
10月末日	891,395	―	0.8579	―
第1計算期間末(2022年11月21日)	912,556	912,556	0.8782	0.8782
11月末日	912,159	―	0.8778	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△12.2

(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	39,100	0

(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（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		69,882,489,668	87.66
	内 香港	582,860,273	0.73
	内 シンガポール	305,521,129	0.38
	内 イスラエル	176,023,590	0.22
	内 ノルウェー	187,342,544	0.24
	内 スウェーデン	773,495,030	0.97
	内 デンマーク	618,729,460	0.78
	内 イギリス	3,294,787,667	4.13
	内 アイルランド	121,870,819	0.15
	内 オランダ	915,995,404	1.15
	内 ベルギー	217,801,016	0.27
	内 フランス	2,412,909,765	3.03
	内 ドイツ	1,713,591,665	2.15
	内 スイス	2,145,774,336	2.69
	内 ポルトガル	48,708,519	0.06
	内 スペイン	524,383,638	0.66
	内 イタリア	525,251,792	0.66
	内 フィンランド	228,873,494	0.29
	内 オーストリア	45,129,873	0.06
	内 カナダ	2,745,286,902	3.44
	内 アメリカ	50,677,345,178	63.57
	内 オーストラリア	1,575,385,800	1.98
	内 ニュージーランド	45,421,774	0.06
投資証券		1,729,033,393	2.17
	内 香港	32,640,524	0.04
	内 シンガポール	36,641,760	0.05
	内 イギリス	28,379,269	0.04
	内 ベルギー	6,817,052	0.01
	内 フランス	29,624,751	0.04
	内 カナダ	5,685,924	0.01
	内 アメリカ	1,434,921,360	1.80
	内 オーストラリア	154,322,753	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,104,052,437	10.17
純資産総額		79,715,575,498	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）		3,818,076,760	4.79
	内 イギリス	162,657,717	0.20
	内 ドイツ	558,368,154	0.70
	内 カナダ	75,430,858	0.09
	内 アメリカ	2,971,095,876	3.73
	内 オーストラリア	50,524,155	0.06
為替予約取引（売建）		71,788,179,425	△90.06
	内 日本	71,788,179,425	△90.06

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

(注2) 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（2022年11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	173,401	23,790.93 4,125,383,998	19,604.27 3,399,401,392	4.26
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	76,066	43,160.51 3,283,050,086	33,374.62 2,538,674,385	3.18
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	98,068	22,057.55 2,163,148,172	12,834.36 1,258,640,546	1.58
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	63,962	18,952.42 1,212,239,230	13,219.03 845,515,936	1.06
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	60,377	19,040.32 1,149,605,216	13,253.75 800,221,833	1.00

6	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	9,990	65,374.99 653,097,408	73,323.36 732,500,366	0.92
7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	28,303	47,604.77 1,347,358,137	25,111.86 710,741,033	0.89
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	44,997	9,791.58 440,593,068	15,350.68 690,734,989	0.87
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	28,028	24,054.64 674,205,466	24,453.61 685,386,014	0.86
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	13,759	44,188.71 607,993,173	43,762.10 602,122,777	0.76
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	31,418	22,669.97 712,245,760	18,964.08 595,813,692	0.75
12	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	26,707	36,870.40 984,697,839	21,717.87 580,019,402	0.73
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	25,635	22,157.81 568,018,751	20,202.80 517,898,973	0.65
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	17,542	29,450.71 516,626,386	29,032.16 509,282,189	0.64
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	19,818	17,919.22 355,124,160	25,139.63 498,217,308	0.62
16	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	29,776	17,709.39 527,319,209	16,207.24 482,586,903	0.61
17	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	10,944	52,725.05 577,023,406	43,877.36 480,193,885	0.60
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	9,278	50,406.19 467,669,448	47,650.46 442,100,997	0.55
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	8,663	36,719.72 318,103,179	50,541.73 437,843,063	0.55
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	18,941	19,070.73 361,220,097	21,969.23 416,119,261	0.52
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,953	7,740.47 464,066,634	6,872.67 412,037,562	0.52
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	27,005	11,528.29 311,321,616	15,114.61 408,170,065	0.51
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	77,923	6,622.84 516,072,567	5,138.19 400,383,179	0.50
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	44,373	8,431.21 374,121,711	8,676.59 385,006,665	0.48

25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	14,792	24,157.82 357,342,995	25,356.27 375,069,995	0.47
26	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	24,466	44,080.53 1,078,476,578	15,200.71 371,900,576	0.47
27	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	4,726	72,253.22 341,469,229	73,456.67 347,156,247	0.44
28	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	16,256	19,946.31 324,248,275	21,242.94 345,325,296	0.43
29	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	7,339	53,619.81 393,516,519	45,048.44 330,610,556	0.41
30	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,061	88,906.31 361,049,112	80,376.08 326,407,277	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	87.66%
投資証券	2.17%
合計	89.83%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.41%
素材	3.97%
資本財・サービス	8.79%
一般消費財・サービス	8.84%
生活必需品	7.05%
ヘルスケア	12.94%
金融	13.00%
情報技術	18.80%
コミュニケーション・サービス	5.70%
公益事業	2.87%
不動産	0.30%
合計	87.66%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI DEC 22	買建	108	2,862,078,204	2,971,095,876	3.73%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 22	買建	13	154,254,915	162,657,717	0.20%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 22	買建	3	47,871,614	50,524,155	0.06%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 22	買建	3	72,816,941	75,430,858	0.09%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 22	買建	8	122,229,075	129,086,927	0.16%
		EURO STOXX 50 DEC 22	買建	76	386,590,011	429,281,227	0.54%
為替予約取引	日本	シンガポール・ドル売/円買 2022年12月	売建	3,051,400	319,658,561	308,021,437	△0.39%
		米ドル売/円買 2022年12月	売建	381,721,300	56,558,293,764	52,959,745,956	△66.44%
		カナダ・ドル売/円買 2022年12月	売建	26,421,900	2,875,368,542	2,697,102,633	△3.38%
		デンマーク・クローネ売/円買 2022年12月	売建	32,702,500	644,710,638	631,256,357	△0.79%
		ユーロ売/円買 2022年12月	売建	45,090,200	6,617,687,850	6,471,841,495	△8.12%
		イスラエル・シュケル売/円買 2022年12月	売建	3,213,700	134,933,621	129,521,429	△0.16%
		香港ドル売/円買 2022年12月	売建	29,899,600	564,758,594	531,055,765	△0.67%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2022年12月	売建	59,104,400	795,606,838	776,354,024	△0.97%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2022年12月	売建	13,341,800	190,387,486	185,326,941	△0.23%
		豪ドル売/円買 2022年12月	売建	18,040,300	1,712,697,296	1,672,864,390	△2.10%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2022年12月	売建	521,000	45,022,215	44,834,811	△0.06%

		スイス・フラン売/円買 2022年12月	売建	14,764,300	2,192,550,294	2,150,646,187	△2.70%
		英ポンド売/円買 2022年12月	売建	19,442,200	3,310,054,105	3,229,608,000	△4.05%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(投資一任専用)

2022年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,778円
純資産総額	0.9百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.3%
3カ月間	-0.5%
6カ月間	-5.8%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	-12.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第１期 22年11月										
分配金	0円										

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,215	92.4%
外国リート	59	2.1%
外国投資証券	5	0.1%
コール・ローン、その他		10.2%
合計	1,279	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	69.1%
イギリス	4.4%
その他	21.1%
合計	94.6%

通貨別構成	比率
日本円	97.9%
米ドル	0.6%
ユーロ	0.6%
英ポンド	0.3%
豪ドル	0.2%
カナダ・ドル	0.1%
香港ドル	0.1%
スイス・フラン	0.1%
スウェーデン・クローネ	0.1%
その他	0.1%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	18.8%
金融	13.0%
ヘルスケア	12.9%
一般消費財・サービス	8.8%
資本財・サービス	8.8%
生活必需品	7.1%
コミュニケーション・サービス	5.7%
エネルギー	5.4%
素材	4.0%
公益事業、他	3.2%
合計	87.7%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	4.3%
S&P500 EMINI DEC 22	アメリカ	3.7%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.2%
AMAZON.COM INC	アメリカ	1.6%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
TESLA INC	アメリカ	0.9%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
合計		18.4%

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

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)(※配当なし)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。
・2022年は11月30日まで、2022年※は設定日(2月18日)から11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）】

(1) 【投資状況】 (2022年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		17,689,087	99.99
	内 日本	17,689,087	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,772	0.01
純資産総額		17,690,859	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】 (2022年11月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,098,586	4.3539 17,845,145	4.3159 17,689,087	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
2022年2月末日	974,667	－	0.9747	－
3月末日	1,078,185	－	1.0782	－
4月末日	1,075,478	－	1.0318	－
5月末日	1,028,780	－	1.0288	－
6月末日	1,846,281	－	1.0044	－
7月末日	2,452,810	－	1.0438	－
8月末日	12,553,873	－	1.0507	－
9月末日	14,214,162	－	0.9990	－
10月末日	16,245,139	－	1.0944	－
第1計算期間末(2022年11月21日)	15,978,901	15,978,901	1.0724	1.0724
11月末日	17,690,859	－	1.0621	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.2

(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	14,966,956	1,067,476

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

株式		267,590,825,720	89.68
	内 香港	2,220,562,811	0.74
	内 シンガポール	1,124,742,168	0.38
	内 イスラエル	645,271,962	0.22
	内 ノルウェー	670,144,288	0.22
	内 スウェーデン	2,928,365,101	0.98
	内 デンマーク	2,356,253,979	0.79
	内 イギリス	12,424,463,706	4.16
	内 アイルランド	480,788,317	0.16
	内 オランダ	3,487,443,410	1.17
	内 ベルギー	768,034,111	0.26
	内 フランス	9,278,418,421	3.11
	内 ドイツ	6,493,252,119	2.18
	内 スイス	8,039,238,397	2.69
	内 ポルトガル	174,187,623	0.06
	内 スペイン	1,921,983,940	0.64
	内 イタリア	1,919,632,029	0.64
	内 フィンランド	794,754,208	0.27
	内 オーストリア	147,143,414	0.05
	内 カナダ	10,059,105,167	3.37
	内 アメリカ	195,902,161,071	65.66
	内 オーストラリア	5,601,355,473	1.88
	内 ニュージーランド	153,524,005	0.05
投資証券		6,560,957,275	2.20
	内 香港	122,651,952	0.04
	内 シンガポール	127,159,103	0.04
	内 イギリス	117,894,616	0.04
	内 ベルギー	22,866,298	0.01
	内 フランス	102,508,985	0.03
	内 カナダ	27,643,066	0.01
	内 アメリカ	5,498,694,638	1.84
	内 オーストラリア	541,538,617	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,221,481,393	8.12
純資産総額		298,373,264,388	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）	24,154,881,142	8.10

	内 イギリス	1,363,822,399	0.46
	内 ドイツ	4,126,420,111	1.38
	内 カナダ	1,181,750,102	0.40
	内 アメリカ	16,506,088,200	5.53
	内 オーストラリア	976,800,330	0.33
為替予約取引(買建)		16,953,866,380	5.68
	内 日本	16,953,866,380	5.68

(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（2022年11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	670,000	22,224.33 14,890,321,308	19,604.27 13,134,866,193	4.40
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	294,100	45,999.85 13,528,572,086	33,374.62 9,815,477,830	3.29
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	378,800	24,101.72 9,129,761,184	12,834.36 4,861,657,614	1.63
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	248,800	19,860.35 4,941,287,852	13,219.03 3,288,895,983	1.10
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	233,340	20,010.47 4,669,248,793	13,253.75 3,092,630,678	1.04
6	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	38,766	63,270.14 2,452,735,410	73,323.36 2,842,453,374	0.95
7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	109,150	50,559.65 5,518,592,772	25,111.86 2,740,959,748	0.92

8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	174,205	8,900.73 1,550,566,448	15,350.68 2,674,166,917	0.90
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	108,900	22,308.91 2,429,452,327	24,453.61 2,662,999,033	0.89
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	53,250	39,439.63 2,100,165,172	43,762.10 2,330,331,990	0.78
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	121,470	22,046.86 2,678,047,278	18,964.08 2,303,567,672	0.77
12	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	103,580	44,488.25 4,608,102,352	21,717.87 2,249,537,938	0.75
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	99,267	20,677.74 2,052,620,853	20,202.80 2,005,472,102	0.67
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	68,150	27,408.21 1,867,873,782	29,032.16 1,978,541,854	0.66
15	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	77,218	16,522.19 1,275,812,091	25,139.63 1,941,232,420	0.65
16	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	42,550	55,433.98 2,358,716,532	43,877.36 1,866,981,889	0.63
17	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	112,433	17,464.95 1,963,642,939	16,207.24 1,822,229,087	0.61
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	35,900	45,199.96 1,622,680,119	47,650.46 1,710,651,625	0.57
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,385	35,749.16 1,193,486,768	50,541.73 1,687,335,873	0.57
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	73,072	16,605.65 1,213,417,047	21,969.23 1,605,335,867	0.54
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	232,113	7,238.32 1,680,139,831	6,872.67 1,595,237,514	0.53
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	104,621	10,539.53 1,102,666,779	15,114.61 1,581,305,697	0.53
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	299,901	6,265.39 1,879,016,862	5,138.19 1,540,948,319	0.52
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	170,450	7,687.84 1,310,408,566	8,676.59 1,478,926,061	0.50
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	57,200	22,820.09 1,305,309,537	25,356.27 1,450,378,833	0.49

26	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	94,800	45,674.48 4,329,947,297	15,200.71 1,441,027,327	0.48
27	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	18,260	76,205.19 1,391,509,035	73,456.67 1,341,318,889	0.45
28	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	62,600	19,678.98 1,231,910,215	21,242.94 1,329,808,288	0.45
29	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	16,320	99,567.99 1,624,950,869	80,376.08 1,311,737,691	0.44
30	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	28,061	51,784.81 1,453,134,102	45,048.44 1,264,104,485	0.42

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	89.68%
投資証券	2.20%
合計	91.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.52%
素材	4.03%
資本財・サービス	8.96%
一般消費財・サービス	9.11%
生活必需品	7.21%
ヘルスケア	13.28%
金融	13.20%
情報技術	19.32%
コミュニケーション・サービス	5.84%
公益事業	2.90%
不動産	0.30%
合計	89.68%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI DEC 22	買建	600	16,446,802,167	16,506,088,200	5.53%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 22	買建	109	1,327,055,606	1,363,822,399	0.46%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 22	買建	58	939,903,407	976,800,330	0.33%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 22	買建	47	1,144,070,379	1,181,750,102	0.40%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 22	買建	66	1,047,541,594	1,064,967,149	0.36%
		EURO STOXX 50 DEC 22	買建	542	2,845,837,010	3,061,452,962	1.03%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2022年12月	買建	14,400,000	2,104,026,770	2,066,846,400	0.69%
		カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	7,900,000	847,777,660	806,418,570	0.27%
		米ドル買/円売 2022年12月	買建	85,300,000	12,336,972,570	11,834,462,290	3.97%
		英ポンド買/円売 2022年12月	買建	4,900,000	828,018,030	813,955,170	0.27%
		豪ドル買/円売 2022年12月	買建	6,300,000	594,996,870	584,194,590	0.20%
		イスラエル・シュケル買/円売 2022年12月	買建	800,000	32,484,240	32,263,680	0.01%
		スイス・フラン買/円売 2022年12月	買建	5,600,000	829,345,070	815,725,680	0.27%

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

(注2) 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

●ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)（投資一任専用）

2022年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,621円
純資産総額	17百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.0%
3カ月間	1.1%
6カ月間	3.2%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	6.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第１期 22年11月										
分配金	0円										

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,215	97.8%
外国リート	59	2.1%
外国投資証券	5	0.1%
コール・ローン、その他		8.1%
合計	1,279	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	73.0%
イギリス	4.7%
その他	22.3%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	73.3%
ユーロ	9.5%
英ポンド	4.6%
カナダ・ドル	3.8%
スイス・フラン	3.0%
豪ドル	2.4%
スウェーデン・クローネ	1.0%
デンマーク・クローネ	0.8%
香港ドル	0.8%
その他	0.8%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	19.3%
ヘルスケア	13.3%
金融	13.2%
一般消費財・サービス	9.1%
資本財・サービス	9.0%
生活必需品	7.2%
コミュニケーション・サービス	5.8%
エネルギー	5.5%
素材	4.0%
公益事業、他	3.2%
合計	89.7%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
S&P500 EMINI DEC 22	アメリカ	5.5%
APPLE INC	アメリカ	4.4%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.3%
AMAZON.COM INC	アメリカ	1.6%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
EURO STOXX 50 DEC 22	ドイツ	1.0%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	1.0%
TESLA INC	アメリカ	0.9%
EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
合計		20.8%

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

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)(※配当なし)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。
・2022年は11月30日まで、2022年※は設定日(2月18日)から11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

ただし、販売会社は、次のイ．またはロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額（当初自己設定については1万口当たり1万円）です。

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

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その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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

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、販売会社は、次のイ．またはロ．に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

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、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消すことができるものとします。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

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

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

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。

（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

・外国の株式：原則として金融商品取引所または店頭市場における計算時において知りう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。

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。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2022年2月18日から2022年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項

を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（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）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（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。

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）】

(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1期計算期間（2022年2月18日から2022年11月21日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	839
親投資信託受益証券	912,413
未収入金	30
流動資産合計	913,282
資産合計	913,282
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	4
未払委託者報酬	626
その他未払費用	96
流動負債合計	726
負債合計	726
純資産の部	
元本等	
元本	※1 1,039,100
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 126,544
元本等合計	912,556
純資産合計	912,556
負債純資産合計	913,282

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
営業収益	
有価証券売買等損益	△ 119,429
営業収益合計	△ 119,429
営業費用	
受託者報酬	29
委託者報酬	1,836
その他費用	276
営業費用合計	2,141
営業損失（△）	△ 121,570
経常損失（△）	△ 121,570
当期純損失（△）	△ 121,570
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974
分配金	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 126,544

(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1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2022年2月18日から2022年11月21日までとなっております。 (2)計算期間末日 2022年11月20日が休日のため、当計算期間末日を2022年11月21日としております。このため、当計算期間は277日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第1期 2022年11月21日現在
1．※1　期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	39,100円
期中一部解約元本額	－円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,039,100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126,544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1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21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	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第1期 2022年11月21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1期 2022年11月21日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△119,150
合計	△119,150

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 2022年11月21日現在
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1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21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1期 2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8782円 (8,782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	360,424	912,413	
親投資信託受益証券　合計			912,413	
合計			912,413	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「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

	2022年11月21日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	654,005,186
コール・ローン	3,193,751,390
株式	70,613,827,697
投資証券	1,731,577,137
派生商品評価勘定	3,665,069,820
未収入金	67,027,140
未収配当金	89,174,588
差入委託証拠金	870,931,448
流動資産合計	80,885,364,406

資産合計	80,885,364,406
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,843
未払解約金	2,103,950,030
流動負債合計	2,103,956,873
負債合計	2,103,956,873
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	31,119,989,052
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	47,661,418,481
元本等合計	78,781,407,533
純資産合計	78,781,407,533
負債純資産合計	80,885,364,406

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年11月21日現在
1.　※1　期首	2022年2月18日
期首元本額	28,185,744,786円
期中追加設定元本額	7,032,826,419円
期中一部解約元本額	4,098,582,153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）	24,565,463,207円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,787,311,335円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	2,580,313,844円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	360,424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）	2,186,540,242円
計	31,119,989,052円
2.　期末日における受益権の総数	31,119,989,052口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年11月21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	2022年11月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	△10,658,091,414
投資証券	△447,304,006
合計	△11,105,395,420

（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（2022年1月12日から2022年11月21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	2022年11月21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	2,939,006,935	－	3,116,786,130	177,779,195
合計	2,939,006,935	－	3,116,786,130	177,779,195

（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	2022年11月21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	75,961,729,804	－	72,474,446,022	3,487,283,782
アメリカ・ドル	56,558,293,764	－	53,478,657,891	3,079,635,873
イギリス・ポンド	3,310,054,105	－	3,234,001,938	76,052,167
イスラエル・シュケル	134,933,621	－	129,682,757	5,250,864
オーストラリア・ドル	1,712,697,296	－	1,682,835,264	29,862,032
カナダ・ドル	2,875,368,542	－	2,764,610,588	110,757,954
シンガポール・ドル	319,658,561	－	310,903,179	8,755,382
スイス・フラン	2,192,550,294	－	2,171,434,322	21,115,972
スウェーデン・クローナ	795,606,838	－	778,050,321	17,556,517
デンマーク・クローネ	644,710,638	－	636,194,434	8,516,204
ニュージーランド・ドル	45,022,215	－	44,840,386	181,829
ノルウェー・クローネ	190,387,486	－	183,032,151	7,355,335
ユーロ	6,617,687,850	－	6,524,461,759	93,226,091
香港・ドル	564,758,594	－	535,741,032	29,017,562
合計	75,961,729,804	－	72,474,446,022	3,487,283,782

（注）１．時価の算定方法

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

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5315円 (25,315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 SOLUTIO	1,228	144.600	177,568.800	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,555	167.480	595,391.400	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,829	171.900	314,405.100	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	107.230	170,924.620	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	147.180	109,796.280	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,606	35.890	201,199.340	
	ABBOTT LABORATORIES	18,738	103.870	1,946,316.060	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	37.100	146,545.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,656	173.540	287,382.240	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,880	43.620	169,245.600	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,218	79.710	495,636.780	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	474	377.310	178,844.940	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,293	61.410	386,453.130	
	QORVO INC	1,147	98.920	113,461.240	
	AFLAC INC	6,622	70.940	469,764.680	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,357	147.140	199,668.980	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	66.210	121,495.350	
	ADOBE INC	5,075	330.860	1,679,114.500	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,083	101.340	211,091.220	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,442	347.850	501,599.700	
	GARMIN LTD	1,724	91.030	156,935.720	

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,303	296.480	682,793.440	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,260	214.530	1,557,487.800	
WR BERKLEY CORP	2,312	73.330	169,538.960	
AUTOZONE INC	207	2,460.840	509,393.880	
DOLLAR TREE INC	2,312	163.360	377,688.320	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	8.720	107,822.800	
CELANESE CORP	1,211	101.230	122,589.530	
DR HORTON INC	3,601	81.390	293,085.390	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	31.130	76,268.500	
AUTODESK INC	2,253	210.370	473,963.610	
MOODY'S CORP	1,870	292.330	546,657.100	
DEVON ENERGY CORP	6,669	69.620	464,295.780	
ALBEMARLE CORP	1,233	276.980	341,516.340	
ATMOS ENERGY CORP	1,465	115.050	168,548.250	
ALLIANT ENERGY CORP	2,692	55.260	148,759.920	
CITIGROUP INC	20,903	48.660	1,017,139.980	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,483	256.020	1,147,737.660	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,681	91.280	518,561.680	
DOMINO'S PIZZA INC	407	367.890	149,731.230	
HESS CORP	2,881	143.990	414,835.190	
DAVITA INC	609	70.650	43,025.850	
DANAHER CORP	7,414	260.650	1,932,459.100	
FORTIVE CORP	3,433	66.610	228,672.130	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,840	104.210	608,586.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5,944	95.150	565,571.600	
BUNGE LTD	1,693	100.700	170,485.100	
TE CONNECTIVITY LTD	3,389	126.390	428,335.710	
APPLE INC	173,401	151.290	26,233,837.290	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,919	107.260	313,091.940	
BOEING CO/THE	6,161	173.890	1,071,336.290	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,611	106.860	172,151.460	
BECTON DICKINSON AND CO	3,008	225.590	678,574.720	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	106.300	148,820.000	
NISOURCE INC	4,111	26.320	108,201.520	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	97.090	136,314.360	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,219	44.560	366,238.640	

VERIZON COMMUNICATIONS INC	44,831	38.550	1,728,235.050	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	13,759	310.760	4,275,746.840	
ANSYS INC	956	243.760	233,034.560	
TRUIST FINANCIAL CORP	13,581	45.660	620,108.460	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	7,964	91.680	730,139.520	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,743	77.450	1,761,445.350	
JPMORGAN CHASE & CO	31,418	133.840	4,204,985.120	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,296	122.070	280,272.720	
LKQ CORP	2,916	54.020	157,522.320	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,384	69.790	236,169.360	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,883	165.020	475,752.660	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,148	328.700	377,347.600	
DOLLAR GENERAL CORP	2,405	257.700	619,768.500	
SERVICENOW INC	2,134	399.380	852,276.920	
CATERPILLAR INC	5,715	231.430	1,322,622.450	
BROWN & BROWN INC	2,446	56.940	139,275.240	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,558	47.120	120,532.960	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	242.150	138,994.100	
CMS ENERGY CORP	2,775	60.000	166,500.000	
MOSAIC CO/THE	3,841	48.970	188,093.770	
DELTA AIR LINES INC	75	34.470	2,585.250	
CORNING INC	8,106	33.890	274,712.340	
CISCO SYSTEMS INC	44,167	47.790	2,110,740.930	
MORGAN STANLEY	14,000	89.200	1,248,800.000	
MSCI INC	836	490.310	409,899.160	
FAIR ISAAC CORP	299	576.200	172,283.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	268.570	126,227.900	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	52.220	156,555.560	
BROADCOM INC	4,295	515.160	2,212,612.200	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,360	217.360	295,609.600	
ARAMARK	2,858	40.640	116,149.120	
DTE ENERGY COMPANY	2,031	114.600	232,752.600	
CENTENE CORP	6,046	82.680	499,883.280	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,119	121.510	135,969.690	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,071	40.410	204,919.110	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,391	194.330	464,643.030	
GARTNER INC	869	337.690	293,452.610	
SPLUNK INC	1,921	77.300	148,493.300	
DOMINION ENERGY INC	8,959	59.160	530,014.440	

MONSTER BEVERAGE CORP	4,095	99.700	408,271.500	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	61.280	85,792.000	
DEERE & CO	3,123	414.260	1,293,733.980	
QUANTA SERVICES INC	1,539	148.660	228,787.740	
POOL CORP	438	321.980	141,027.240	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,911	98.010	285,307.110	
VMWARE INC-CLASS A	2,382	116.560	277,645.920	
CABLE ONE INC	60	683.350	41,001.000	
BURLINGTON STORES INC	766	157.860	120,920.760	
NASDAQ INC	3,672	65.520	240,589.440	
VAIL RESORTS INC	448	243.360	109,025.280	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	6,360	7.590	48,272.400	
TARGA RESOURCES CORP	2,431	72.330	175,834.230	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	142.140	124,230.360	
WESTLAKE CORP	424	104.430	44,278.320	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,609	93.530	337,549.770	
COGNEX CORP	1,994	47.740	95,193.560	
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,200	52.610	115,742.000	
TELEFLEX INC	502	217.400	109,134.800	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	861	180.250	155,195.250	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	797	225.000	179,325.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	398.120	95,946.920	
CATALENT INC	1,863	43.040	80,183.520	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,736	184.080	319,562.880	
MOLINA HEALTHCARE INC	610	317.750	193,827.500	
CARLISLE COS INC	600	250.750	150,450.000	
IDEX CORP	801	233.550	187,073.550	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,348	76.460	638,288.080	
ROLLINS INC	2,337	42.460	99,229.020	
AMETEK INC	2,360	139.320	328,795.200	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,412	76.420	184,325.040	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,454	54.730	79,577.420	
HEICO CORP	535	163.760	87,611.600	
GENERAC HOLDINGS INC	684	102.870	70,363.080	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	399	437.770	174,670.230	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,760	82.300	227,148.000	

TYLER TECHNOLOGIES INC	467	313.450	146,381.150	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,726	523.670	2,474,864.420	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	57.060	64,363.680	
EPAM SYSTEMS INC	624	341.460	213,071.040	
RPM INTERNATIONAL INC	1,457	100.600	146,574.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	288	1,502.480	432,714.240	
UGI CORP	2,907	38.610	112,239.270	
CUMMINS INC	1,522	250.310	380,971.820	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,143	74.100	603,396.300	
CDW CORP/DE	1,426	185.600	264,665.600	
SIGNATURE BANK	692	132.030	91,364.760	
COSTAR GROUP INC	4,957	80.800	400,525.600	
SVB FINANCIAL GROUP	582	223.530	130,094.460	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,140	298.340	340,107.600	
MERCADOLIBRE INC	551	962.080	530,106.080	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	778	186.960	145,454.880	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,889	139.510	403,044.390	
DEXCOM INC	4,456	113.720	506,736.320	
NORDSON CORP	547	231.010	126,362.470	
COPART INC	4,218	64.420	271,723.560	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,726	156.220	269,635.720	
SEAGEN INC	1,745	131.760	229,921.200	
ALIGN TECHNOLOGY INC	744	193.560	144,008.640	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	904	218.220	197,270.880	
TRANSDIGM GROUP INC	550	620.610	341,335.500	
BIO-TECHNE CORP	430	328.610	141,302.300	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,079	120.160	129,652.640	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,431	76.260	185,388.060	
KINDER MORGAN INC	22,051	18.420	406,179.420	
HCA HEALTHCARE INC	2,538	230.080	583,943.040	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	259.790	109,111.800	
COTERRA ENERGY INC	8,637	26.600	229,744.200	
T-MOBILE US INC	6,947	148.830	1,033,922.010	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	35.260	62,974.360	
COCA-COLA CO/THE	44,373	61.140	2,712,965.220	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	50.790	130,784.250	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	112.770	217,082.250	

FRANKLIN RESOURCES INC	3,373	26.150	88,203.950	
CSX CORP	22,882	30.880	706,596.160	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,001	230.180	230,410.180	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	98.310	153,658.530	
AMAZON.COM INC	98,068	94.140	9,232,121.520	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,517	75.040	489,035.680	
EXXON MOBIL CORP	44,997	112.080	5,043,263.760	
AES CORP	7,037	27.660	194,643.420	
EVEREST RE GROUP LTD	376	323.490	121,632.240	
EOG RESOURCES INC	6,171	141.020	870,234.420	
EQT CORP	3,828	41.030	157,062.840	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,676	90.950	152,432.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	789.140	105,744.760	
ABIOMED INC	512	377.290	193,172.480	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,634	162.000	264,708.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,202	146.190	468,100.380	
FORD MOTOR CO	43,756	13.990	612,146.440	
EXACT SCIENCES CORP	1,959	42.530	83,316.270	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	19.300	46,628.800	
ENTEGRIS INC	1,893	73.340	138,832.620	
AERCAP HOLDINGS NV	1,700	59.340	100,878.000	
FORTINET INC	7,013	52.150	365,727.950	
MARKEL CORP	140	1,259.290	176,300.600	
NEXTERA ENERGY INC	20,933	83.200	1,741,625.600	
MASIMO CORP	623	141.460	88,129.580	
FREEPORT-MCMORAN INC	15,206	36.340	552,586.040	
INSULET CORP	769	295.530	227,262.570	
US BANCORP	14,904	43.380	646,535.520	
UNITED RENTALS INC	849	345.700	293,499.300	
F5 NETWORKS INC	659	149.370	98,434.830	
FASTENAL CO	5,941	51.660	306,912.060	
FISERV INC	6,531	99.860	652,185.660	
GENERAL ELECTRIC CO	11,567	85.480	988,747.160	
GENERAL MOTORS CO	14,483	39.770	575,988.910	
ZENDESK INC	1,305	77.460	101,085.300	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,500	248.220	620,550.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,615	379.200	1,370,808.000	
ALPHABET INC-CL A	63,962	97.430	6,231,817.660	

ALPHABET INC-CL C	60,377	97.800	5,904,870.600	
OWENS CORNING	1,083	90.060	97,534.980	
GENERAL MILLS INC	6,857	81.030	555,622.710	
FIRSTENERGY CORP	5,840	38.480	224,723.200	
GENUINE PARTS CO	1,539	180.680	278,066.520	
FIFTH THIRD BANCORP	7,230	35.630	257,604.900	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,022	224.000	452,928.000	
HALLIBURTON CO	10,652	36.710	391,034.920	
HOME DEPOT INC	10,944	313.180	3,427,441.920	
ASSURANT INC	532	124.950	66,473.400	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	15,352	14.890	228,591.280	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	431	227.310	97,970.610	
HERSHEY CO/THE	1,664	225.210	374,749.440	
HUMANA INC	1,334	529.900	706,886.600	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,723	171.940	468,192.620	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	36.210	33,204.570	
HENRY SCHEIN INC	1,491	78.910	117,654.810	
HP INC	10,699	29.480	315,406.520	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,115	15.770	222,593.550	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	681	41.980	28,588.380	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,262	57.610	130,313.820	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	42.300	85,784.400	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,274	57.670	246,481.580	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,629	38.100	290,664.900	
ENPHASE ENERGY INC	1,507	311.940	470,093.580	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,621	147.640	1,420,444.440	
INTERNATIONAL PAPER CO	3,457	35.770	123,656.890	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	64.410	96,615.000	
ZOETIS INC	4,996	145.640	727,617.440	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,456	176.240	432,845.440	
CHENIERE ENERGY INC	2,818	167.750	472,719.500	
ALLEGION PLC	942	112.960	106,408.320	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	2,912	20.020	58,298.240	
WASTE CONNECTIONS INC	3,014	140.200	422,562.800	

JUNIPER NETWORKS INC	3,530	31.570	111,442.100	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	146.140	179,021.500	
JOHNSON & JOHNSON	28,028	176.200	4,938,533.600	
PLUG POWER INC	6,251	15.840	99,015.840	
ABBVIE INC	18,941	154.980	2,935,476.180	
HOLOGIC INC	2,613	73.480	192,003.240	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,806	131.400	500,108.400	
KROGER CO	7,265	48.260	350,608.900	
KLA CORP	1,548	376.340	582,574.320	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,556	476.820	1,218,751.920	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	840	188.450	158,298.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	38.230	109,796.560	
LOWE'S COS INC	6,788	209.930	1,425,004.840	
ELI LILLY & CO	8,663	361.670	3,133,147.210	
LAM RESEARCH CORP	1,450	456.700	662,215.000	
LOEWS CORP	2,228	56.620	126,149.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,741	37.730	65,687.930	
MCDONALD'S CORP	7,902	273.370	2,160,169.740	
3M CO	5,924	126.760	750,926.240	
META PLATFORMS INC CLASS A	24,466	112.050	2,741,415.300	
S&P GLOBAL INC	3,716	345.870	1,285,252.920	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	356.320	269,021.600	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	575	306.390	176,174.250	
ALCOA CORP	2,093	47.310	99,019.830	
PHILLIPS 66	4,982	108.990	542,988.180	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,867	36.740	142,073.580	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,663	83.760	223,052.880	
METLIFE INC	7,575	75.500	571,912.500	
MARVELL TECHNOLOGY INC	10,239	44.000	450,516.000	
ARISTA NETWORKS INC	2,545	135.480	344,796.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,754	262.940	461,196.760	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	241	1,401.310	337,715.710	
BAKER HUGHES CO	10,110	29.130	294,504.300	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,253	264.740	331,719.220	
MERCK & CO. INC.	27,005	104.230	2,814,731.150	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,561	69.380	385,822.180	
MASCO CORP	2,541	49.930	126,872.130	

M & T BANK CORP	1,827	170.610	311,704.470	
MARSH & MCLENNAN COS	5,287	167.500	885,572.500	
BLACK KNIGHT INC	1,644	60.800	99,955.200	
HEICO CORP-CLASS A	754	127.950	96,474.300	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,886	161.710	466,695.060	
WORKDAY INC-CLASS A	2,448	146.740	359,219.520	
WAYFAIR INC- CLASS A	880	33.240	29,251.200	
BLOCK INC CLASS A	6,304	65.820	414,929.280	
TRANSUNION	2,557	60.440	154,545.080	
VISTRA CORP	4,057	22.910	92,945.870	
NOVOCURE LTD	1,054	77.490	81,674.460	
NETAPP INC	2,370	73.720	174,716.400	
NIKE INC -CL B	13,548	105.420	1,428,230.160	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,507	246.760	618,627.320	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,673	74.170	420,766.410	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,012	121.590	244,639.080	
ALLY FINANCIAL INC	3,709	26.010	96,471.090	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,577	520.420	820,702.340	
APTIV PLC	3,176	108.030	343,103.280	
NEWMONT CORP	8,148	45.130	367,719.240	
MCKESSON CORP	1,555	369.730	574,930.150	
XYLEM INC	1,972	112.630	222,106.360	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,616	96.280	1,599,788.480	
NUCOR CORP	2,725	142.030	387,031.750	
WESTERN UNION CO	4,350	13.890	60,421.500	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	74.030	142,877.900	
NEWELL BRANDS INC	4,058	13.350	54,174.300	
EVERGY INC	2,317	58.650	135,892.050	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,415	71.250	742,068.750	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	267.980	72,086.620	
OKTA INC	1,995	49.860	99,470.700	
COUPA SOFTWARE INC	880	45.870	40,365.600	
LIBERTY BROADBAND-C	1,312	86.260	113,173.120	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	11.910	58,085.070	
LINDE PLC	4,761	334.910	1,594,506.510	
WIX.COM LTD	785	85.090	66,795.650	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,293	30.650	131,580.450	
KKR & CO INC	6,886	51.840	356,970.240	

PAYCHEX INC	3,473	120.830	419,642.590	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	693	838.270	580,921.110	
ALTRIA GROUP INC	19,293	44.200	852,750.600	
P G & E CORP	16,482	15.020	247,559.640	
PFIZER INC	59,953	48.230	2,891,533.190	
CIGNA CORP	3,379	319.210	1,078,610.590	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	42.040	137,723.040	
XCEL ENERGY INC	5,534	68.380	378,414.920	
STERIS PLC	1,054	166.010	174,974.540	
SEA LTD-ADR	4,100	56.940	233,454.000	
FOX CORP - CLASS B	1,530	29.140	44,584.200	
FOX CORP - CLASS A	3,495	30.930	108,100.350	
STRYKER CORP	3,593	223.610	803,430.730	
LYFT INC-A	3,191	11.210	35,771.110	
DOW INC	7,617	50.070	381,383.190	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,130	57.250	64,692.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,751	81.640	224,591.640	
PARKER HANNIFIN CORP	1,319	305.630	403,125.970	
UBER TECHNOLOGIES INC	17,823	28.960	516,154.080	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,401	249.940	600,105.940	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	25,635	142.570	3,654,781.950	
EXELON CORP	11,097	38.580	428,122.260	
TELADOC HEALTH INC	2,575	28.790	74,134.250	
INGERSOLL-RAND INC	4,003	53.700	214,961.100	
NVR INC	33	4,392.590	144,955.470	
CONOCOPHILLIPS	13,826	128.590	1,777,885.340	
TWILIO INC - A	2,053	49.250	101,110.250	
DOCUSIGN INC	2,333	46.000	107,318.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	550	316.390	174,014.500	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	65.280	95,961.600	
PEPSICO INC	14,792	181.330	2,682,233.360	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	148.900	60,900.100	
DROPBOX INC-CLASS A	2,950	22.280	65,726.000	
MONGODB INC	821	159.880	131,261.480	
SNAP INC - A	12,910	10.520	135,813.200	
CORTEVA INC	7,674	65.200	500,344.800	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,084	107.330	438,335.720	
AMCOR PLC	15,231	11.820	180,030.420	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,406	138.990	334,409.940	
ROKU INC	1,417	55.650	78,856.050	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,910	146.710	280,216.100	
ACCENTURE PLC-CL A	6,786	286.500	1,944,189.000	
PENTAIR PLC	1,348	45.030	60,700.440	
QUALCOMM INC	11,908	123.850	1,474,805.800	
INVESCO LTD	3,700	18.940	70,078.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	664	147.500	97,940.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,895	90.900	263,155.500	
DATADOG INC - CLASS A	2,587	76.520	197,957.240	
PINTEREST INC- CLASS A	6,763	24.380	164,881.940	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,128	736.730	831,031.440	
REPUBLIC SERVICES INC	2,344	133.890	313,838.160	
BOOKING HOLDINGS INC	433	1,940.280	840,141.240	
ROSS STORES INC	3,750	107.590	403,462.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	129.040	128,781.920	
RESMED INC	1,482	224.400	332,560.800	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	146.420	194,299.340	
ROBERT HALF INTL INC	1,209	75.500	91,279.500	
MODERNA INC	3,538	181.590	642,465.420	
HUBSPOT INC	518	272.600	141,206.800	
PERKINELMER INC	1,230	136.170	167,489.100	
CARRIER GLOBAL CORP	8,939	43.920	392,600.880	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,520	77.760	351,475.200	
BILL.COM HOLDINGS INC	1,159	113.310	131,326.290	
AVANTOR INC	6,686	20.880	139,603.680	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,773	28.290	78,448.170	
DYNATRACE INC	2,339	36.590	85,584.010	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,191	49.770	258,356.070	
REGIONS FINANCIAL CORP	9,916	22.490	223,010.840	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	2,996	26.610	79,723.560	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,176	42.870	179,025.120	
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	47.110	48,099.310	
MATCH GROUP INC	3,049	46.400	141,473.600	
CHEVRON CORP	19,818	182.990	3,626,495.820	
ZSCALER INC	985	138.730	136,649.050	

EDISON INTERNATIONAL	4,460	61.720	275,271.200	
ETSY INC	1,409	113.920	160,513.280	
TESLA INC	28,303	180.190	5,099,917.570	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,502	146.200	365,792.400	
GEN DIGITAL INC	6,272	22.620	141,872.640	
UNITY SOFTWARE INC	2,239	34.680	77,648.520	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,745	80.200	139,949.000	
SYNOPSYS INC	1,714	325.890	558,575.460	
CHEWY INC - CLASS A	856	40.920	35,027.520	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,925	47.010	137,504.250	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,239	374.380	463,856.820	
VIATRIS INC	12,623	11.000	138,853.000	
DOORDASH INC - A	2,139	58.290	124,682.310	
ROBLOX CORP -CLASS A	3,970	31.720	125,928.400	
AIRBNB INC-CLASS A	4,053	97.770	396,261.810	
CBRE GROUP INC - A	3,379	75.300	254,438.700	
SOUTHERN CO/THE	11,652	65.570	764,021.640	
SYSCO CORP	5,663	85.060	481,694.780	
TRAVELERS COS INC/THE	2,519	184.560	464,906.640	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	50.620	30,372.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,011	60.900	61,569.900	
STEEL DYNAMICS INC	2,156	100.640	216,979.840	
SCHLUMBERGER LTD	14,879	53.440	795,133.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,749	44.030	77,008.470	
AFFIRM HOLDINGS INC	2,035	13.510	27,492.850	
AT&T INC	76,332	18.970	1,448,018.040	
APA CORP	3,632	46.340	168,306.880	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,008	38.110	38,414.880	
ON SEMICONDUCTOR CORP	4,963	72.460	359,618.980	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,388	49.980	119,352.240	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,578	240.040	618,823.120	
SEMPRA ENERGY	3,285	157.840	518,504.400	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	38.540	87,254.560	
CLARIVATE PLC	3,377	9.260	31,271.020	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	18,593	7.390	137,402.270	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,240	54.570	122,236.800	

COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,335	45.260	60,422.100	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9,769	175.180	1,711,333.420	
SALESFORCE.COM INC	10,661	148.040	1,578,254.440	
WESTROCK CO	2,754	36.510	100,548.540	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,086	61.940	315,026.840	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,377	66.980	494,111.460	
TERADYNE INC	1,718	92.900	159,602.200	
UNION PACIFIC CORP	6,744	210.580	1,420,151.520	
MARATHON OIL CORP	7,622	30.800	234,757.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	5,769	121.180	699,087.420	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	15,835	95.360	1,510,025.600	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,853	178.970	1,405,451.410	
IQVIA HOLDINGS INC	1,961	213.780	419,222.580	
AMEREN CORPORATION	2,690	86.180	231,824.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,990	530.000	5,294,700.000	
APPLOVIN CORP CLASS A	1,362	13.950	18,999.900	
VERISIGN INC	1,080	194.250	209,790.000	
LUCID GROUP INC	5,100	11.260	57,426.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	2,200	30.340	66,748.000	
VALERO ENERGY CORP	4,255	137.620	585,573.100	
ULTA BEAUTY INC	540	440.500	237,870.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	39.700	119,417.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	128.670	98,689.890	
ELEVANCE HEALTH INC	2,574	495.320	1,274,953.680	
WALT DISNEY CO/THE	19,421	91.800	1,782,847.800	
WELLS FARGO & CO	40,644	46.500	1,889,946.000	
WASTE MANAGEMENT INC	4,600	161.180	741,428.000	
WILLIAMS COS INC	12,870	33.400	429,858.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,190	219.860	261,633.400	
WHIRLPOOL CORP	636	147.420	93,759.120	
WALMART INC	16,256	150.230	2,442,138.880	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,226	114.090	253,964.340	
WYNN RESORTS LTD	1,145	76.000	87,020.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	13,900	3.210	44,619.000	
WABTEC CORP	1,898	99.160	188,205.680	

TJX COMPANIES INC	12,480	78.160	975,436.800	
WATERS CORP	651	321.160	209,075.160	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	571	256.100	146,233.100	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,793	39.750	309,771.750	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,184	232.730	275,552.320	
WESTERN DIGITAL CORP	3,264	36.860	120,311.040	
WEC ENERGY GROUP INC	3,366	95.700	322,126.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,350	57.690	308,641.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	17,542	210.800	3,697,853.600	
PPL CORP	7,299	28.090	205,028.910	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	3,460	93.300	322,818.000	
PULTEGROUP INC	2,592	42.850	111,067.200	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	25,542	10.770	275,087.340	
PPG INDUSTRIES INC	2,415	128.470	310,255.050	
NORTHERN TRUST CORP	2,131	92.320	196,733.920	
NVIDIA CORP	26,707	154.090	4,115,281.630	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,406	161.160	710,070.960	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	940	24.780	23,293.200	
TYSON FOODS INC-CL A	2,886	65.520	189,090.720	
NETFLIX INC	4,746	287.980	1,366,753.080	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,193	535.240	2,244,261.320	
NRG ENERGY INC	2,411	42.240	101,840.640	
GLOBE LIFE INC	1,011	113.720	114,970.920	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,041	121.950	248,899.950	
TEXTRON INC	2,388	70.070	167,327.160	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	17.830	66,844.670	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	70	2,703.890	189,272.300	
OMNICOM GROUP	2,311	77.200	178,409.200	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,361	126.040	171,540.440	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	6,360	1.380	8,776.800	
ORACLE CORP	17,190	79.730	1,370,558.700	

MASTERCARD INC - A	9,278	343.690	3,188,755.820	
ONEOK INC	4,773	64.470	307,715.310	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	10,299	5.870	60,455.130	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,098	433.010	475,444.980	
AMERCO NON VOTING SERIES N	882	58.000	51,156.000	
YUM! BRANDS INC	3,035	124.610	378,191.350	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,715	98.770	169,390.550	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,961	53.500	104,913.500	
BANK OF AMERICA CORP	77,923	37.190	2,897,956.370	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	487	407.090	198,252.830	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,120	88.310	187,217.200	
AMERICAN EXPRESS CO	6,903	152.500	1,052,707.500	
ANALOG DEVICES INC	5,435	161.850	879,654.750	
ADVANCED MICRO DEVICES	17,292	73.570	1,272,172.440	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,374	59.820	500,932.680	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,734	94.330	163,568.220	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,609	58.690	153,122.210	
AVERY DENNISON CORP	869	188.220	163,563.180	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,492	59.970	329,355.240	
EMERSON ELECTRIC CO	6,080	93.700	569,696.000	
AON PLC-CLASS A	2,251	301.320	678,271.320	
AMGEN INC	5,762	287.290	1,655,364.980	
EATON CORP PLC	4,157	165.010	685,946.570	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,701	247.650	421,252.650	
APPLIED MATERIALS INC	9,287	104.700	972,348.900	
CME GROUP INC	3,783	172.500	652,567.500	
ECOLAB INC	2,675	148.110	396,194.250	
EQUIFAX INC	1,219	200.180	244,019.420	
GILEAD SCIENCES INC	13,352	83.620	1,116,494.240	
KEURIG DR PEPPER INC	8,423	37.420	315,188.660	
HORMEL FOODS CORP	2,415	48.660	117,513.900	
STATE STREET CORP	3,917	75.590	296,086.030	
SCHWAB (CHARLES) CORP	15,435	79.810	1,231,867.350	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,180	55.000	284,900.000	
CAMPBELL SOUP CO	1,302	51.560	67,131.120	
CROWN HOLDINGS INC	1,392	80.400	111,916.800	

CARDINAL HEALTH INC	2,973	77.680	230,942.640	
FEDEX CORP	2,550	174.720	445,536.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,052	98.960	400,985.920	
FMC CORP	1,360	127.650	173,604.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,662	98.270	261,594.740	
INTEL CORP	43,592	29.870	1,302,093.040	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,318	33.100	142,925.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,556	73.690	262,041.640	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,304	226.880	749,611.520	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,227	6.390	65,350.530	
ILLUMINA INC	1,689	220.560	372,525.840	
SEALED AIR CORP	1,450	51.140	74,153.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,788	262.110	992,872.680	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,239	129.290	160,190.310	
SNAP-ON INC	623	236.380	147,264.740	
CARMAX INC	1,749	66.560	116,413.440	
DUKE ENERGY CORP	7,998	96.790	774,126.420	
TARGET CORP	4,960	162.880	807,884.800	
DOVER CORP	1,526	139.470	212,831.220	
WW GRAINGER INC	541	597.030	322,993.230	
CINTAS CORP	964	449.370	433,192.680	
CONAGRA BRANDS INC	4,972	35.950	178,743.400	
CLOROX COMPANY	1,313	146.790	192,735.270	
ENTERGY CORP	2,110	111.920	236,151.200	
MICROSOFT CORP	76,066	241.220	18,348,640.520	
INCYTE CORP	2,006	77.450	155,364.700	
CVS HEALTH CORP	13,986	97.350	1,361,537.100	
MEDTRONIC PLC	14,207	81.300	1,155,029.100	
MICRON TECHNOLOGY INC	11,624	58.580	680,933.920	
BLACKROCK INC	1,626	720.610	1,171,711.860	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,606	29.670	196,000.020	
HASBRO INC	1,348	59.520	80,232.960	
KELLOGG CO	2,153	70.610	152,023.330	
KEYCORP	9,940	18.610	184,983.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	14,577	64.990	947,359.230	
COOPER COS INC/THE	471	307.400	144,785.400	
CHUBB LTD	4,488	210.140	943,108.320	

	ARROW ELECTRONICS INC	737	108.070	79,647.590	
	ALLSTATE CORP	2,938	132.740	389,990.120	
	EBAY INC	6,211	45.680	283,718.480	
	PAYPAL HOLDINGS INC	11,753	84.920	998,064.760	
	EASTMAN CHEMICAL CO	1,392	84.250	117,276.000	
	DISH NETWORK CORP-A	2,984	15.230	45,446.320	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,399	233.460	560,070.540	
	TRIMBLE INC	2,636	57.990	152,861.640	
	LENNAR CORP-A	2,744	84.710	232,444.240	
	LEAR CORP	828	145.640	120,589.920	
	PROGRESSIVE CORP	6,179	128.360	793,136.440	
	PACCAR INC	3,595	103.870	373,412.650	
	BIOGEN INC	1,578	302.890	477,960.420	
	IDEXX LABORATORIES INC	894	413.890	370,017.660	
	STARBUCKS CORP	12,336	97.950	1,208,311.200	
	PTC INC	1,200	123.300	147,960.000	
	EVERSOURCE ENERGY	3,492	79.650	278,137.800	
	INTUIT INC	2,873	380.070	1,091,941.110	
	BORGWARNER INC	2,741	42.220	115,725.020	
	BEST BUY CO INC	2,316	72.050	166,867.800	
	BALL CORP	3,359	55.090	185,047.310	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,912	42.960	683,579.520	
	ELECTRONIC ARTS INC	2,902	130.080	377,492.160	
	VULCAN MATERIALS CO	1,425	178.890	254,918.250	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,831	314.630	890,717.530	
	VF CORP	3,212	33.080	106,252.960	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	6,779	18.660	126,496.140	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	564	99.970	56,383.080	
	CARNIVAL CORP	9,986	9.470	94,567.420	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	7,674	14.330	109,968.420	
	COMCAST CORP-CLASS A	47,399	34.500	1,635,265.500	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	46.160	87,704.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	3.970	52,007.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 367,221,463.980 (51,543,204,683)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	80,726	23.445	1,892,621.070	

HALEON PLC	54,552	2.872	156,673.340	
BP PLC	210,312	4.760	1,001,190.270	
UNILEVER PLC	27,806	40.405	1,123,501.430	
BARCLAYS PLC	174,358	1.582	275,869.220	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	91,245	0.854	78,005.350	
PRUDENTIAL PLC	29,590	9.786	289,567.740	
NATWEST GROUP PLC	56,020	2.581	144,587.620	
JOHNSON MATTHEY PLC	3,080	20.310	62,554.800	
BAE SYSTEMS PLC	34,216	7.702	263,531.630	
AVIVA PLC	31,964	4.551	145,468.160	
AVEVA GROUP PLC	1,140	31.640	36,069.600	
GSK	43,436	13.684	594,378.220	
INFORMA PLC	16,200	5.916	95,839.200	
MELROSE INDUSTRIES PLC	44,776	1.308	58,567.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	5.668	60,007.110	
DCC PLC	726	43.420	31,522.920	
OCADO GROUP PLC	5,149	6.782	34,920.510	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	114.000	84,360.000	
HALMA PLC	3,978	22.250	88,510.500	
ENTAIN PLC	5,823	13.400	78,028.200	
JD SPORTS FASHION PLC	21,808	1.196	26,082.360	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	6,857	5.960	40,867.720	
M&G PLC	25,964	1.983	51,499.590	
RELX PLC	20,392	22.830	465,549.360	
DIAGEO PLC	24,819	36.740	911,850.060	
RIO TINTO PLC	11,928	53.850	642,322.800	
STANDARD CHARTERED PLC	27,461	5.816	159,713.170	
TESCO PLC	80,477	2.313	186,143.300	
SMITH & NEPHEW PLC	9,237	10.680	98,651.160	
GLENCORE PLC	102,863	5.058	520,281.050	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	8.374	26,796.800	
SMITHS GROUP PLC	4,080	15.750	64,260.000	
PEARSON PLC	8,271	9.770	80,807.670	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.168	38,224.000	
NEXT PLC	1,456	57.320	83,457.920	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.031	33,251.430	
WHITBREAD PLC	1,547	25.120	38,860.640	
BUNZL PLC	3,703	30.260	112,052.780	

VODAFONE GROUP PLC	309,588	0.974	301,600.620	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,409	69.140	97,418.260	
KINGFISHER PLC	24,703	2.461	60,794.080	
WPP PLC	13,021	8.688	113,126.440	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.260	84,583.440	
SEVERN TRENT PLC	2,681	27.300	73,191.300	
RENTOKIL INITIAL PLC	19,857	5.344	106,115.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,092	58.120	470,307.040	
ST JAMES'S PLACE PLC	3,999	11.880	47,508.120	
SCHRODERS PLC	7,217	4.593	33,147.680	
SSE PLC	11,927	16.965	202,341.550	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	3.992	49,373.050	
ASTRAZENECA PLC	16,906	109.200	1,846,135.200	
FERGUSON PLC	2,396	98.500	236,006.000	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.614	178,358.440	
3I GROUP PLC	8,367	13.135	109,900.540	
ASHTEAD GROUP PLC	4,635	50.100	232,213.500	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	8.002	92,407.090	
NATIONAL GRID PLC	41,545	10.175	422,720.370	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	740,947	0.454	336,945.640	
IMPERIAL BRANDS PLC	9,822	21.210	208,324.620	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,155	37.280	43,058.400	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	23,330	33.110	772,456.300	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,483	15.340	53,429.220	
HSBC HOLDINGS PLC	219,262	4.789	1,050,045.710	
ANGLO AMERICAN PLC	13,276	31.605	419,587.980	
MONDI PLC	5,248	15.750	82,656.000	
COMPASS GROUP PLC	20,336	18.505	376,317.680	
PERSIMMON PLC	3,969	12.995	51,577.150	
BT GROUP PLC	75,578	1.228	92,809.780	
COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	19.950	51,351.300	
BURBERRY GROUP PLC	4,508	20.980	94,577.840	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,078	47.400	98,497.200	
INTERTEK GROUP PLC	1,713	39.240	67,218.120	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,381	81.220	274,604.820	

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	14.290	29,137.310	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	20.920	32,844.400	
	ANTOFAGASTA PLC	6,056	13.230	80,120.880	
	ABRDN PLC	27,775	2.025	56,244.370	
	EXPERIAN PLC	9,546	28.890	275,783.940	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 19,481,282.880 (3,245,386,914)	
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	14,335	19.920	285,553.200	
	AZRIELI GROUP LTD	530	263.000	139,390.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,279	150.500	192,489.500	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	24,000	6.135	147,240.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	28.330	234,969.020	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	670.000	201,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	32.950	499,522.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	16,751	32.480	544,072.480	
	NICE LTD	742	688.600	510,941.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	131.400	247,426.200	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 3,002,603.600 (121,329,806)	
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	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	23,727	4.500	106,771.500	
	TELSTRA GROUP LTD	42,351	3.940	166,862.940	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,136	2.830	85,284.880	
	BHP GROUP LTD	55,761	43.940	2,450,138.340	
	SOUTH32 LTD	48,803	3.910	190,819.730	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	21,927	37.890	830,814.030	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	18,391	19.960	367,084.360	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,612	30.660	1,061,203.920	
	WESTPAC BANKING CORP	37,244	23.620	879,703.280	
	SANTOS LTD	33,160	7.380	244,720.800	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	32,365	24.500	792,942.500	
	RIO TINTO LTD	4,000	106.380	425,520.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	18,280	7.500	137,100.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	19,619	3.690	72,394.110	

	XERO LTD	1,426	68.920	98,279.920	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	27.500	75,570.000	
	COLES GROUP LTD	16,386	16.940	277,578.840	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,645	58.800	96,726.000	
	IDP EDUCATION LTD	2,088	30.210	63,078.480	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	10,716	10.000	107,160.000	
	EVOLUTION MINING LTD	17,017	2.560	43,563.520	
	REECE LTD	2,322	15.000	34,830.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	7.160	99,566.960	
	SEEK LTD	4,813	21.560	103,768.280	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	8,616	13.460	115,971.360	
	NEWCREST MINING LTD	9,662	19.060	184,157.720	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,705	105.820	1,979,363.100	
	AMPOL LTD	1,538	28.820	44,325.160	
	ORICA LTD	4,783	15.090	72,175.470	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	12.400	190,315.200	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	14,042	34.660	486,695.720	
	QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	5.880	37,473.240	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,796	29.550	141,721.800	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,004	179.320	717,997.280	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,462	36.200	233,924.400	
	CSL LTD	5,288	294.400	1,556,787.200	
	WESFARMERS LTD	11,899	47.570	566,035.430	
	COCHLEAR LTD	697	206.130	143,672.610	
	BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	16.620	83,498.880	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	11.950	173,322.800	
	ASX LTD	2,260	72.800	164,528.000	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	27.090	164,002.860	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	4.900	132,775.300	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	31.900	166,613.700	
	BRAMBLES LTD	15,068	11.520	173,583.360	
	MINERAL RESOURCES LTD	1,881	83.170	156,442.770	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	62.420	128,834.880	
	REA GROUP LTD	608	121.430	73,829.440	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	760	64.060	48,685.600	

オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 16,748,215.670 (1,564,450,826)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,054	61.720	558,812.880	
	IMPERIAL OIL LTD	3,068	75.580	231,879.440	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	237	2,022.290	479,282.730	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,136	89.380	280,295.680	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,069	49.550	251,168.950	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,835	194.260	356,467.100	
	BCE INC	668	63.370	42,331.160	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,414	185.680	448,231.520	
	SUNCOR ENERGY INC	15,253	47.660	726,957.980	
	METRO INC/CN	2,379	76.670	182,397.930	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,599	97.390	350,506.610	
	BANK OF NOVA SCOTIA	13,165	69.040	908,911.600	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,656	63.560	613,735.360	
	TORONTO-DOMINION BANK	20,072	89.420	1,794,838.240	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,335	31.390	104,685.650	
	ROYAL BANK OF CANADA	15,608	132.700	2,071,181.600	
	TOURMALINE OIL CORP	3,656	79.730	291,492.880	
	TC ENERGY CORP	10,639	64.000	680,896.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,048	47.070	284,679.360	
	BARRICK GOLD CORP	19,119	20.910	399,778.290	
	CAE INC	3,752	28.420	106,631.840	
	THOMSON REUTERS CORP	1,968	151.950	299,037.600	
	EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	34.780	62,604.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	109.070	68,823.170	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	62.370	97,297.200	
	HYDRO ONE LTD	2,408	35.510	85,508.080	
	LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	110.940	206,459.340	
	NORTHLAND POWER INC	2,632	37.000	97,384.000	
	WSP GLOBAL INC	1,345	159.850	214,998.250	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	99.980	97,380.520	
	PARKLAND CORP	1,621	25.820	41,854.220	
	QUEBECOR INC -CL B	1,949	27.150	52,915.350	
	EMERA INC	3,524	51.320	180,851.680	

TFI INTERNATIONAL INC	924	140.170	129,517.080	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,193	35.850	78,619.050	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,956	59.710	236,212.760	
BRP INC/CA- SUB VOTING	403	93.310	37,603.930	
IVANHOE MINES LTD-CL A	7,402	10.400	76,980.800	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,027	63.960	321,526.920	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,997	10.280	71,929.160	
AIR CANADA	1,700	18.610	31,637.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	5.480	80,868.360	
BANK OF MONTREAL	7,414	132.270	980,649.780	
POWER CORP OF CANADA	5,730	33.080	189,548.400	
SHOPIFY INC - CLASS A	12,670	49.020	621,083.400	
NUTRIEN LTD	6,364	104.110	662,556.040	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	41.250	63,195.000	
CAMECO CORP	4,472	31.890	142,612.080	
FIRSTSERVICE CORP	422	165.910	70,014.020	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	1,865	37.020	69,042.300	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,560	20.150	31,434.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	772	40.190	31,026.680	
TELUS CORP	600	29.170	17,502.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	43.970	236,294.780	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	147.860	92,116.780	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	12,748	79.950	1,019,202.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	274	747.660	204,858.840	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,167	82.960	262,734.320	
WESTON (GEORGE) LTD	800	157.420	125,936.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,615	19.860	51,933.900	
BLACKBERRY LTD	6,400	6.340	40,576.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,420	61.820	396,884.400	
ENBRIDGE INC	22,166	53.970	1,196,299.020	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,150	59.870	907,030.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	21,036	23.570	495,818.520	
BAUSCH HEALTH COS INC	3,514	10.140	35,631.960	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,003	105.090	1,051,215.270	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	72.970	80,267.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,364	38.390	90,753.960	

	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,418	166.490	1,068,532.820	
	CGI INC - CLASS A	2,271	114.230	259,416.330	
	ONEX CORPORATION	1,104	69.510	76,739.040	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,172	36.450	188,519.400	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	38.880	51,243.840	
	TMX GROUP LTD	698	135.650	94,683.700	
	OPEN TEXT CORP	3,210	38.790	124,515.900	
	SAPUTO INC	2,900	34.500	100,050.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	29.510	185,913.000	
	FORTIS INC	5,938	53.430	317,267.340	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	73.420	99,484.100	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	7.680	50,688.000	
	CENOVUS ENERGY INC	15,373	27.130	417,069.490	
	DOLLARAMA INC	3,074	77.700	238,849.800	
	ALTAGAS LTD	3,201	22.390	71,670.390	
	KEYERA CORP	2,200	29.380	64,636.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,734	18.970	146,713.980	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 26,457,381.950 (2,773,262,776)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	30,400	3.620	110,048.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	14,900	30.250	450,725.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,300	35.540	757,002.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	11,750	5.480	64,390.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	7.410	128,193.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	6.610	19,830.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	8.170	42,484.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	40,700	12.550	510,785.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	46,000	0.865	39,790.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	17.570	56,224.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	81,400	2.680	218,152.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.470	48,927.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.390	110,802.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	4.120	114,536.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 2,671,888.000	

				(272,719,609)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	38,238	17.485	668,591.430	
	ROCHE HOLDING AG-BR	324	364.800	118,195.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	674.500	60,030.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	33.170	58,180.180	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7,339	308.000	2,260,412.000	
	SIKA AG-REG	1,611	245.000	394,695.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	98,800.000	98,800.000	
	ABB LTD-REG	17,976	29.280	526,337.280	
	SWISS RE AG	2,969	80.520	239,063.880	
	NESTLE SA-REG	29,776	110.880	3,301,562.880	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	243	968.400	235,321.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	261	176.600	46,092.600	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	27,320	4.056	110,809.920	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	52.560	141,071.040	
	SGS SA-REG	78	2,304.000	179,712.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	168.600	78,736.200	
	TEMENOS AG - REG	793	58.680	46,533.240	
	VAT GROUP AG	339	262.600	89,021.400	
	ALCON INC	5,550	62.200	345,210.000	
	SIG GROUP N AG	3,400	20.080	68,272.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	247.300	93,232.100	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,510	441.800	667,118.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	550	138.600	76,230.000	
	CLARIANT AG-REG	2,552	16.080	41,036.160	
	NOVARTIS AG-REG	22,697	81.510	1,850,032.470	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,927.000	79,007.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	82.750	32,272.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5,238	116.250	608,917.500	
	SWISSCOM AG-REG	196	499.700	97,941.200	
	GEBERIT AG-REG	433	465.100	201,388.300	
	GIVAUDAN-REG	106	3,205.000	339,730.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,271	108.800	138,284.800	
	SONOVA HOLDING AG-REG	613	251.800	154,353.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,730	55.800	96,534.000	
	LONZA GROUP AG-REG	746	495.200	369,419.200	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	45.880	20,646.000	
	HOLCIM LTD	5,418	48.080	260,497.440	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	329	502.600	165,355.400	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	225.900	144,576.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	81.200	76,815.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	9,980.000	139,720.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 14,719,754.620 (2,165,275,905)	
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	
	SAGAX CLASS B	2,020	226.900	458,338.000	
	INVESTOR CLASS A	6,256	199.000	1,244,944.000	
	VOLVO CAR CLASS B	7,177	50.670	363,658.590	
	ERICSSON LM-B SHS	29,689	64.920	1,927,409.880	
	VOLVO AB-B SHS	16,333	192.100	3,137,569.300	
	SKF AB-B SHARES	4,000	173.250	693,000.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	141.900	368,940.000	
	SWEDISH MATCH AB	18,200	115.100	2,094,820.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	93.260	655,244.760	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	235.800	676,510.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,767	118.150	2,217,321.050	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,557	106.150	1,757,525.550	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	166.000	1,796,286.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,112	117.700	954,782.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	138.650	1,014,918.000	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	181.100	671,699.900	
	SANDVIK AB	12,212	190.900	2,331,270.800	
	INVESTOR AB-B SHS	19,446	191.480	3,723,520.080	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	28,712	129.460	3,717,055.520	
	VOLVO AB-A SHS	1,923	202.000	388,446.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	419.100	466,877.400	
	SECURITAS AB-B SHS	3,930	90.260	354,721.800	
	TELIA CO AB	29,088	29.220	849,951.360	
	ALFA LAVAL AB	3,803	296.400	1,127,209.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,329	116.800	1,907,227.200	
	ASSA ABLOY AB-B	11,369	239.800	2,726,286.200	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,638	266.000	435,708.000	

	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,420	46.105	295,994.100	
	INDUTRADE AB	3,600	217.500	783,000.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	1,911	212.800	406,660.800	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	471.100	446,602.800	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	209.700	429,465.600	
	LIFCO AB-B SHS	2,924	182.900	534,799.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,716	98.860	1,652,543.760	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,282	248.000	1,557,936.000	
	EMBRACER GROUP AB	7,090	45.915	325,537.350	
	BOLIDEN AB	3,171	369.900	1,172,952.900	
	EPIROC AB-A	7,913	189.100	1,496,348.300	
	EPIROC AB-B	4,015	162.050	650,630.750	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	80.060	432,324.000	
	NORDEA BANK ABP	38,096	108.340	4,127,320.640	
	EQT AB	3,365	241.500	812,647.500	
	EVOLUTION AB	2,064	999.000	2,061,936.000	
	KINNEVIK AB - B	3,003	157.150	471,921.450	
	HEXAGON AB-B SHS	22,193	121.100	2,687,572.300	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,216	264.900	322,118.400	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 58,729,553.440 (774,055,515)	
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	18,290	812.000	14,851,480.000	
	DANSKE BANK A/S	8,002	122.400	979,444.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	14,700.000	573,300.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	11,264	173.280	1,951,825.920	
	GN STORE NORD A/S	1,551	173.300	268,788.300	
	CARLSBERG AS-B	1,132	916.800	1,037,817.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,464	402.100	990,774.400	
	COLOPLAST-B	1,400	888.000	1,243,200.000	
	DSV PANALPINA A/S	2,004	1,088.000	2,180,352.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	1,669.500	163,611.000	
	DEMANT A/S	614	203.300	124,826.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	58	15,020.000	871,160.000	
	TRYG A/S	4,074	162.700	662,839.800	
	PANDORA A/S	1,128	507.600	572,572.800	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	436.800	551,241.600	

	GENMAB A/S	741	3,131.000	2,320,071.000	
	ORSTED A/S	2,246	637.700	1,432,274.200	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 30,775,579.620 (599,200,535)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	4.700	70,500.000	
	MERCURY NZ LTD	12,380	5.660	70,070.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	23,635	5.120	121,011.200	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.915	105,182.430	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	20.500	148,379.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 515,143.430 (44,410,515)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	11,049	184.050	2,033,568.450	
	NORSK HYDRO ASA	15,284	71.220	1,088,526.480	
	ORKLA ASA	11,618	68.260	793,044.680	
	TELENOR ASA	8,746	98.180	858,682.280	
	EQUINOR ASA	11,382	342.550	3,898,904.100	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	457.800	966,873.600	
	MOWI ASA	4,677	150.350	703,186.950	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	189.800	379,600.000	
	AKER BP ASA	3,655	336.800	1,231,004.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,203	378.800	455,696.400	
	SALMAR ASA	728	341.800	248,830.400	
	ADEVINTA ASA	3,382	79.900	270,221.800	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ 12,928,139.140 (177,632,632)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	8,490	20.720	175,912.800	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	5,055	30.115	152,231.320	
	EXOR NV	1,300	73.920	96,096.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,320	107.050	141,306.000	

BAYER AG-REG	9,724	53.790	523,053.960	
EVONIK INDUSTRIES AG	2,431	19.460	47,307.260	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	23,478	10.212	239,757.330	
COMMERZBANK AG	14,830	8.068	119,648.440	
VOLKSWAGEN AG	341	188.600	64,312.600	
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,824	141.860	258,752.640	
SIEMENS AG-REG	7,696	132.500	1,019,720.000	
E.ON SE	28,880	9.116	263,270.080	
UNIPER SE	1,192	5.460	6,508.320	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,257	84.150	274,076.550	
GEA GROUP AG	1,908	39.840	76,014.720	
CONTINENTAL AG	1,272	56.760	72,198.720	
BASF SE	9,198	49.625	456,450.750	
ALLIANZ SE-REG	4,105	203.950	837,214.750	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,995	66.980	133,625.100	
RHEINMETALL AG	502	180.550	90,636.100	
RWE AG	7,330	41.210	302,069.300	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	7.336	48,512.960	
BRENNTAG SE	1,773	65.700	116,486.100	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	24.410	118,022.350	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	19.590	18,786.810	
SAP SE	10,305	105.160	1,083,673.800	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,408	293.300	412,966.400	
ZALANDO SE	2,514	30.000	75,420.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,570	51.700	81,169.000	
KION GROUP AG	600	27.090	16,254.000	
COVESTRO AG	1,945	36.290	70,584.050	
RATIONAL AG	74	590.000	43,660.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	279	377.300	105,266.700	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	58.920	102,520.800	
DELIVERY HERO SE	1,832	44.190	80,956.080	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	132.650	74,284.000	
BECHTLE AG	819	36.670	30,032.730	
NEMETSCHEK SE	789	47.000	37,083.000	
SCOUT24 AG	1,083	54.760	59,305.080	
AROUNDTOWN SA	10,412	2.488	25,905.050	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,230	52.140	168,412.200	
KNORR-BREMSE AG	926	54.180	50,170.680	

HELLOFRESH SE	1,814	23.950	43,445.300	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	14.675	69,442.100	
BEIERSDORF AG	1,147	102.350	117,395.450	
MERCK KGAA	1,490	176.200	262,538.000	
ADIDAS AG	1,621	129.200	209,433.200	
PUMA SE	1,295	51.440	66,614.800	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	62.850	82,396.350	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	34,147	19.332	660,129.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,341	29.840	69,855.440	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	8,634	62.220	537,207.480	
QIAGEN N.V.	2,521	46.230	116,545.830	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14,228	32.095	456,647.660	
HANNOVER RUECK SE	644	177.750	114,471.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	9,596	38.685	371,221.260	
DEUTSCHE BOERSE AG	1,943	170.400	331,087.200	
MTU AERO ENGINES AG	619	193.300	119,652.700	
SYMRISE AG	1,509	111.700	168,555.300	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	2,105	2.377	5,003.580	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	80.200	58,786.600	
VONOVIA SE	7,135	24.340	173,665.900	
LEG IMMOBILIEN SE	869	63.340	55,042.460	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,030	13.726	123,945.780	
NN GROUP NV	3,860	42.380	163,586.800	
ARCELORMITTAL	6,975	25.075	174,898.120	
HEINEKEN NV	2,930	87.900	257,547.000	
AEGON NV	26,133	4.701	122,851.230	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	10,058	27.595	277,550.510	
AKZO NOBEL N.V.	2,168	70.180	152,150.240	
KONINKLIJKE DSM NV	2,014	127.500	256,785.000	
WOLTERS KLUWER	3,032	102.250	310,022.000	
ING GROEP NV	40,248	11.438	460,356.620	
KONINKLIJKE KPN NV	37,607	2.802	105,374.810	
ASML HOLDING NV	4,061	571.400	2,320,455.400	
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	11.680	47,070.400	
IMCD NV	715	137.150	98,062.250	
ADYEN NV	193	1,521.600	293,668.800	

JUST EAT TAKEAWAY	2,381	21.360	50,858.160	
PROSUS NV	8,121	59.030	479,382.630	
JDE PEET'S NV	1,476	28.220	41,652.720	
ASM INTERNATIONAL NV	555	252.000	139,860.000	
RANDSTAD NV	1,490	55.060	82,039.400	
HEINEKEN HOLDING NV	1,153	71.700	82,670.100	
OCI NV	1,197	35.520	42,517.440	
TOTALENERGIES SE	24,332	57.400	1,396,656.800	
MICHELIN (CGDE)	8,584	26.270	225,501.680	
AIR LIQUIDE SA	5,159	136.640	704,925.760	
KERING	734	551.100	404,507.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,330	142.280	758,352.400	
BOUYGUES SA	2,721	28.890	78,609.690	
BNP PARIBAS	11,143	53.310	594,033.330	
THALES SA	1,235	117.000	144,495.000	
DANONE	6,414	49.885	319,962.390	
CARREFOUR SA	6,641	16.250	107,916.250	
VIVENDI	8,930	8.450	75,458.500	
L'OREAL	2,410	348.100	838,921.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,639	44.315	249,892.280	
LEGRAND SA	3,052	79.440	242,450.880	
PERNOD RICARD SA	2,068	185.700	384,027.600	
EURAZEO SE	400	60.350	24,140.000	
SOCIETE GENERALE SA	9,112	24.030	218,961.360	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,795	698.200	1,951,469.000	
ACCOR SA	1,850	24.470	45,269.500	
CAPGEMINI SE	1,919	178.050	341,677.950	
VALEO SA	2,245	18.270	41,016.150	
PUBLICIS GROUPE	2,918	62.200	181,499.600	
BUREAU VERITAS SA	3,227	26.000	83,902.000	
EIFFAGE	945	93.200	88,074.000	
SODEXO SA	1,085	88.960	96,521.600	
IPSEN	640	104.000	66,560.000	
AMUNDI SA	1,005	54.100	54,370.500	
TELEPERFORMANCE	745	224.500	167,252.500	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	25.920	25,323.840	
EURONEXT NV	929	70.120	65,141.480	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	66.260	98,064.800	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	314	331.800	104,185.200	
SEB SA	216	74.000	15,984.000	
ESSILORLUXOTTICA	2,758	173.350	478,099.300	
DASSAULT AVIATION SA	220	146.300	32,186.000	
WORLDLINE SA	2,641	44.200	116,732.200	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	878	35.790	31,423.620	
AXA SA	18,609	27.080	503,931.720	
EDENRED	3,007	51.020	153,417.140	
RENAULT SA	2,044	33.045	67,543.980	
HERMES INTERNATIONAL	304	1,470.000	446,880.000	
STMICROELECTRONICS NV	8,570	36.995	317,047.150	
REMY COINTREAU	253	162.300	41,061.900	
DASSAULT SYSTEMES SE	7,626	36.245	276,404.370	
WENDEL	331	87.700	29,028.700	
ORANGE	22,580	9.806	221,419.480	
ALSTOM	3,668	24.500	89,866.000	
SANOFI	11,373	86.040	978,532.920	
VINCI SA	5,238	95.440	499,914.720	
AIRBUS SE	5,858	114.640	671,561.120	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,368	24.820	182,873.760	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	9.705	141,780.340	
BIOMERIEUX	457	97.440	44,530.080	
ENGIE	20,960	14.380	301,404.800	
EDF	6,760	11.930	80,646.800	
SAFRAN SA	3,650	114.740	418,801.000	
ARKEMA	650	86.880	56,472.000	
ADP	350	143.850	50,347.500	
GETLINK SE	4,973	15.790	78,523.670	
BOLLORE	14,302	5.070	72,511.140	
UCB SA	1,550	74.260	115,103.000	
KBC GROUP NV	3,011	52.460	157,957.060	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	78.540	89,457.060	
SOLVAY SA	873	98.860	86,304.780	
UMICORE	2,270	34.120	77,452.400	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,300	53.580	498,294.000	
AGEAS	1,887	37.810	71,347.470	
D'IETEREN GROUP	296	174.300	51,592.800	
PROXIMUS	2,269	10.690	24,255.610	
ELIA GROUP SA/NV	502	136.200	68,372.400	

SOFINA	146	225.800	32,966.800	
ARGENX SE	614	356.100	218,645.400	
PRYSMIAN SPA	2,949	32.620	96,196.380	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,944	17.260	223,413.440	
MEDIOBANCA SPA	7,465	10.175	75,956.370	
TENARIS SA	4,700	16.415	77,150.500	
UNICREDIT SPA	23,887	13.102	312,967.470	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.223	24,261.270	
INTESA SANPAOLO	164,057	2.216	363,632.340	
ATLANTIA SPA	5,557	22.960	127,588.720	
POSTE ITALIANE SPA	6,465	9.604	62,089.860	
MONCLER SPA	2,435	49.830	121,336.050	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	39.490	50,744.650	
ENI SPA	24,147	14.188	342,597.630	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5,546	10.030	55,626.380	
DIASORIN SPA	277	132.100	36,591.700	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	9.514	22,966.790	
NEXI SPA	6,511	8.636	56,228.990	
AMPLIFON SPA	1,440	27.630	39,787.200	
ENEL SPA	82,994	5.157	428,000.050	
SNAM SPA	24,300	4.769	115,886.700	
TERNA SPA	15,815	7.316	115,702.540	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	14.880	173,962.080	
FINECOBANK SPA	8,077	15.000	121,155.000	
STELLANTIS NV	21,477	14.410	309,483.570	
FERRARI NV	1,599	208.200	332,911.800	
TELEFONICA SA	67,494	3.541	238,996.250	
ENDESA SA	3,760	18.660	70,161.600	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	66,350	5.448	361,474.800	
IBERDROLA SA	63,278	10.590	670,114.020	
REPSOL SA	19,220	13.795	265,139.900	
GRIFOLS SA	2,795	9.730	27,195.350	
BANCO SANTANDER SA	170,827	2.606	445,175.160	
AMADEUS IT GROUP SA	5,160	49.690	256,400.400	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,668	26.740	44,602.320	
CAIXABANK SA	50,378	3.397	171,134.060	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,953	26.450	78,106.850	

	AENA SME SA	866	120.500	104,353.000	
	CELLNEX TELECOM SA	6,812	33.330	227,043.960	
	ACCIONA SA	291	180.400	52,496.400	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	10,791	24.120	260,278.920	
	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	2,739	18.020	49,356.780	
	ENAGAS SA	3,218	17.305	55,687.490	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,828	17.290	48,896.120	
	FERROVIAL SA	5,367	24.890	133,584.630	
	UPM-KYMMENE OYJ	6,124	34.420	210,788.080	
	NOKIA OYJ	67,262	4.696	315,895.980	
	WARTSILA OYJ ABP	8,227	8.110	66,720.970	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	5,911	14.140	83,581.540	
	ELISA OYJ	939	49.400	46,386.600	
	SAMPO OYJ-A SHS	5,826	47.770	278,308.020	
	FORTUM OYJ	4,400	15.060	66,264.000	
	KESKO OYJ-B SHS	3,470	21.030	72,974.100	
	KONE OYJ-B	3,334	47.360	157,898.240	
	NESTE OYJ	4,941	45.240	223,530.840	
	ORION OYJ-CLASS B	1,315	47.370	62,291.550	
	VERBUND AG	876	88.300	77,350.800	
	OMV AG	2,056	48.380	99,469.280	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,489	29.270	102,123.030	
	VOESTALPINE AG	1,323	25.760	34,080.480	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,693	35.110	94,551.230	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,744	58.240	101,570.560	
	JERONIMO MARTINS	2,900	20.440	59,276.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	31,772	4.432	140,813.500	
	GALP ENERGIA SGPS SA	6,135	11.255	69,049.420	
	EDP RENOVAVEIS SA	3,029	22.300	67,546.700	
	KERRY GROUP PLC-A	1,822	92.100	167,806.200	
	CRH PLC	7,287	38.020	277,051.740	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,557	133.550	207,937.350	
ユーロ　小計				ユーロ 46,741,593.680 (6,768,650,182)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	39.350	688,625.000	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	22,000	45.900	1,009,800.000	
	MTR CORP	16,500	37.450	617,925.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	17,000	91.250	1,551,250.000	
	SINO LAND CO	34,000	9.980	339,320.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,552	43.550	1,243,439.600	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	60.750	303,750.000	
	CLP HOLDINGS LTD	19,000	57.200	1,086,800.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	23.100	428,851.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	138,027	6.590	909,597.930	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	122.100	1,098,900.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,500	19.220	297,910.000	
	WH GROUP LTD	89,500	4.330	387,535.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,400	301.000	4,033,400.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	15,000	12.860	192,900.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	22,000	13.700	301,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	17.560	140,480.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	46.900	1,104,588.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	38.750	213,125.000	
	AIA GROUP LTD	136,000	76.100	10,349,600.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	12,000	15.000	180,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	36.650	733,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	22.400	430,080.000	
	ESR CAYMAN LTD	22,000	17.080	375,760.000	
	SANDS CHINA LTD	29,000	19.620	568,980.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	26,000	16.400	426,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	15,000	92.600	1,389,000.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	43,000	24.000	1,032,000.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 31,434,417.830 (564,247,799)	
合計				70,613,827,697 [70,613,827,697]	

(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	1,520	257,168.800	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,535	416,776.500	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	117,535.620	
		VORNADO REALTY TRUST	1,851	44,386.980	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,229	357,245.720	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,833	241,210.690	
		EQUINIX INC	946	612,449.860	
		AMERICAN TOWER CORP	4,876	1,052,874.680	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	7,895	144,715.350	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3,155	100,960.000	
		KIMCO REALTY CORP	7,054	156,246.100	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	5,382	104,572.260	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,000	150,420.000	
		INVITATION HOMES INC	7,588	237,276.760	
		VICI PROPERTIES INC	9,791	316,249.300	
		VENTAS INC	4,401	193,952.070	
		WEYERHAEUSER CO	7,465	240,895.550	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,563	619,837.920	
		IRON MOUNTAIN INC	3,160	165,268.000	
		SUN COMMUNITIES INC	1,461	208,923.000	
		PROLOGIS INC	9,807	1,123,489.920	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,561	234,415.370	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,049	120,446.180	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	704	148,959.360	
		WELLTOWER INC	4,790	324,666.200	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,888	145,139.200	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,236	196,165.560	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	127,198.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,245	104,427.950	
		REALTY INCOME CORP	6,221	402,498.700	
		PUBLIC STORAGE	1,647	483,410.970	
		REGENCY CENTERS CORP	1,761	115,503.990	
		UDR INC	3,360	135,072.000	
		WP CAREY INC	2,131	169,883.320	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,233	357,117.180	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,429	225,982.060	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6,944	85,897.280	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 10,239,238.900 (1,437,179,572)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,946	49,646.600	
	SEGRO PLC	10,113	84,504.220	
	BRITISH LAND CO PLC	9,799	39,881.930	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 174,032.750 (28,992,116)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	12,537	94,528.980	
	LENDLEASE GROUP	6,942	54,147.600	
	TRANSURBAN GROUP	33,749	469,786.080	
	APA GROUP	13,286	146,411.720	
	SCENTRE GROUP	64,017	183,088.620	
	GPT GROUP	21,774	93,192.720	
	MIRVAC GROUP	43,513	92,247.560	
	STOCKLAND	14,352	52,671.840	
	GOODMAN GROUP	18,558	340,724.880	
	VICINITY CENTRES	50,371	96,460.460	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 1,623,260.460 (151,628,759)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	35,475.390	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	925	19,452.750	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 54,928.140 (5,757,568)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	47,500	130,625.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56,826	115,356.780	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	30,000	49,500.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	37,600	65,800.000	

	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 361,281.780 (36,876,031)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	77,610.500	
		GECINA SA	578	55,314.600	
		KLEPIERRE	2,394	53,098.920	
		COVIVIO	353	20,209.250	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,846	49,509.720	
	ユーロ　小計			ユーロ 255,742.990 (37,034,142)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	25,000	1,377,500.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	33,000	186,120.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	36,000	336,600.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 1,900,220.000 (34,108,949)	
投資証券　合計				1,731,577,137 [1,731,577,137]	
合計				1,731,577,137 [1,731,577,137]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式　598銘柄 投資証券　37銘柄	97.3%	2.7%	73.3%
イギリス・ポンド	株式　79銘柄 投資証券　3銘柄	99.1%	0.9%	4.5%
イスラエル・シュケル	株式　10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式　49銘柄 投資証券　10銘柄	91.2%	8.8%	2.4%
カナダ・ドル	株式　86銘柄 投資証券　2銘柄	99.8%	0.2%	3.8%

シンガポール・ドル	株式 投資証券	14銘柄 4銘柄	88.1%	11.9%	0.4%
スイス・フラン	株式	41銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	100%	-%	1.1%
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	5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 投資証券	224銘柄 5銘柄	99.5%	0.5%	9.4%
香港・ドル	株式 投資証券	28銘柄 3銘柄	94.3%	5.7%	0.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）】

(1) 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1期計算期間（2022年2月18日から2022年11月21日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年11月21日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,214
親投資信託受益証券	15,977,305
未収入金	400
流動資産合計	15,989,919
資産合計	15,989,919
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	799
未払委託者報酬	10,050
その他未払費用	169
流動負債合計	11,018
負債合計	11,018
純資産の部	
元本等	
元本	※1 14,899,480
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,079,421
（分配準備積立金）	335,789
元本等合計	15,978,901
純資産合計	15,978,901
負債純資産合計	15,989,919

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
営業収益	
有価証券売買等損益	375,517
営業収益合計	375,517
営業費用	
受託者報酬	923
委託者報酬	12,561
その他費用	349
営業費用合計	13,833
営業利益	361,684
経常利益	361,684
当期純利益	361,684
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	25,895
剰余金増加額又は欠損金減少額	771,300
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	771,300
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,668
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,668
分配金	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,079,421

(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1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1)計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、2022年2月18日から2022年11月21日までとなっております。 (2)計算期間末日 2022年11月20日が休日のため、当計算期間末日を2022年11月21日としております。このため、当計算期間は277日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第1期 2022年11月21日現在
1．※1　期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	14,966,956円
期中一部解約元本額	1,067,476円
2．計算期間末日における受益権の総数	14,899,480口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（335,789円）、投資信託約款に規定される収益調整金（743,632円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は1,079,421円（1万口当たり724.47円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21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	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第1期 2022年11月21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1期 2022年11月21日現在 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	365,995
合計	365,995

（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1期 2022年11月21日現在
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1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21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1期 2022年11月21日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	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	外国株式インデックスマザーファンド	3,666,622	15,977,305	
親投資信託受益証券　合計			15,977,305	
合計			15,977,305	

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

	2022年11月21日現在
	金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,919,228,599
コール・ローン	12,752,480,603
株式	270,397,636,749
投資証券	6,572,871,715
派生商品評価勘定	632,822,264
未収入金	1,187,581
未収配当金	340,864,287
差入委託証拠金	3,700,645,069
流動資産合計	296,317,736,867
資産合計	296,317,736,867
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	701,674,377
未払金	5,559,550
未払解約金	73,925,400
流動負債合計	781,159,327
負債合計	781,159,327
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	67,823,053,477
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	227,713,524,063
元本等合計	295,536,577,540
純資産合計	295,536,577,540
負債純資産合計	296,317,736,867

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2022年2月18日 至　2022年11月21日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2022年11月21日現在
1.　※1　期首	2022年2月18日
期首元本額	62,854,201,776円
期中追加設定元本額	9,586,482,571円
期中一部解約元本額	4,617,630,870円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	307,550,193円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	39,042,034円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	182,847,618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）	67,536,852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）	506,839,931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）	2,965,336,460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）	638,076,417円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	17,930,035円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	45,366,336円

ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	5,870,847,009円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,346,306,577円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	249,638,620円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	43,461,020,632円
ダイワ・ライフ・バランス３０	523,088,723円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,000,565,561円
ダイワ・ライフ・バランス７０	817,851,072円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,887,610,203円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,229,493円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,045,619円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,345,442,282円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,859,726円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,206,144円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,628,137円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	3,666,622円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	72,721,941円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	53,797,340円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,222,816,635円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	63,485,953円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	173,081,567円

ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,137,042,173円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	421,701,589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）	387,377,608円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,884,606,287円
ダイワライフスタイル２５	10,488,247円
ダイワライフスタイル５０	43,399,577円
ダイワライフスタイル７５	33,068,115円
計	67,823,053,477円
2. 期末日における受益権の総数	67,823,053,477口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2022年2月18日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2022年11月21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	2022年11月21日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△40,056,037,257
投資証券	△1,576,429,600
合計	△41,632,466,857

（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（2021年12月1日から2022年11月21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	2022年11月21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	22,067,857,264	－	22,468,357,751	400,500,487
合計	22,067,857,264	－	22,468,357,751	400,500,487

（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	2022年11月21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	16,541,320,240	－	16,071,967,640	△469,352,600
アメリカ・ドル	11,553,219,870	－	11,153,081,520	△400,138,350
イギリス・ポンド	811,342,900	－	798,499,140	△12,843,760
オーストラリア・ドル	548,809,920	－	541,035,600	△7,774,320
カナダ・ドル	796,180,560	－	774,286,420	△21,894,140
スイス・フラン	770,639,220	－	764,781,160	△5,858,060
ユーロ	2,061,127,770	－	2,040,283,800	△20,843,970
合計	16,541,320,240	－	16,071,967,640	△469,352,600

（注）　1．時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月21日現在
1口当たり純資産額	4.3575円
（1万口当たり純資産額）	(43,575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 SOLUTIO	4,900	144.600	708,540.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	12,300	167.480	2,060,004.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,500	171.900	1,289,250.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	107.230	579,042.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,600	147.180	382,668.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	35.890	757,279.000	
	ABBOTT LABORATORIES	72,366	103.870	7,516,656.420	
	HOWMET AEROSPACE INC	15,583	37.100	578,129.300	
	VERISK ANALYTICS INC	6,500	173.540	1,128,010.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	43.620	606,318.000	

AMPHENOL CORP-CL A	24,700	79.710	1,968,837.000	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	377.310	679,158.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	25,300	61.410	1,553,673.000	
QORVO INC	4,420	98.920	437,226.400	
AFLAC INC	25,300	70.940	1,794,782.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	147.140	750,414.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,100	66.210	470,091.000	
ADOBE INC	19,520	330.860	6,458,387.200	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,600	101.340	871,524.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	347.850	1,669,680.000	
GARMIN LTD	6,300	91.030	573,489.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,200	296.480	2,727,616.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,200	214.530	6,049,746.000	
WR BERKLEY CORP	8,642	73.330	633,717.860	
AUTOZONE INC	820	2,460.840	2,017,888.800	
DOLLAR TREE INC	9,271	163.360	1,514,510.560	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	47,800	8.720	416,816.000	
CELANESE CORP	4,450	101.230	450,473.500	
DR HORTON INC	13,816	81.390	1,124,484.240	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	31.130	277,057.000	
AUTODESK INC	9,000	210.370	1,893,330.000	
MOODY'S CORP	6,900	292.330	2,017,077.000	
DEVON ENERGY CORP	25,900	69.620	1,803,158.000	
ALBEMARLE CORP	4,800	276.980	1,329,504.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,800	115.050	667,290.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	55.260	563,652.000	
CITIGROUP INC	80,473	48.660	3,915,816.180	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,400	256.020	4,454,748.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,300	91.280	1,944,264.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	367.890	562,871.700	
HESS CORP	11,600	143.990	1,670,284.000	
DAVITA INC	2,750	70.650	194,287.500	
DANAHER CORP	28,650	260.650	7,467,622.500	
FORTIVE CORP	14,100	66.610	939,201.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23,100	104.210	2,407,251.000	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,300	95.150	2,216,995.000	
BUNGE LTD	6,300	100.700	634,410.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	126.390	1,667,716.050	
APPLE INC	670,000	151.290	101,364,300.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,600	107.260	1,244,216.000	
BOEING CO/THE	23,300	173.890	4,051,637.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	106.860	664,134.900	
BECTON DICKINSON AND CO	11,799	225.590	2,661,736.410	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	106.300	574,020.000	
NISOURCE INC	16,500	26.320	434,280.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,300	97.090	514,577.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	31,771	44.560	1,415,715.760	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	173,704	38.550	6,696,289.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,250	310.760	16,547,970.000	
ANSYS INC	3,600	243.760	877,536.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,117	45.660	2,516,642.220	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	29,000	91.680	2,658,720.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	77.450	6,838,835.000	
JPMORGAN CHASE & CO	121,470	133.840	16,257,544.800	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	122.070	1,135,251.000	
LKQ CORP	11,100	54.020	599,622.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,812	69.790	894,149.480	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,400	165.020	1,881,228.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	328.700	1,479,150.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	257.700	2,422,380.000	
SERVICENOW INC	8,300	399.380	3,314,854.000	
CATERPILLAR INC	22,100	231.430	5,114,603.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	56.940	552,318.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,300	47.120	485,336.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,100	242.150	508,515.000	
CMS ENERGY CORP	12,000	60.000	720,000.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	48.970	729,653.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	34.470	213,714.000	
CORNING INC	33,200	33.890	1,125,148.000	
CISCO SYSTEMS INC	171,350	47.790	8,188,816.500	
MORGAN STANLEY	54,152	89.200	4,830,358.400	
MSCI INC	3,400	490.310	1,667,054.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	576.200	633,820.000	

LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	268.570	349,141.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	52.220	490,868.000	
BROADCOM INC	16,712	515.160	8,609,353.920	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,000	217.360	1,086,800.000	
ARAMARK	9,600	40.640	390,144.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	114.600	905,340.000	
CENTENE CORP	24,207	82.680	2,001,434.760	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,400	121.510	534,644.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	40.410	816,282.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,700	194.330	1,690,671.000	
GARTNER INC	3,350	337.690	1,131,261.500	
SPLUNK INC	6,700	77.300	517,910.000	
DOMINION ENERGY INC	33,541	59.160	1,984,285.560	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,400	99.700	1,635,080.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	61.280	324,784.000	
DEERE & CO	12,000	414.260	4,971,120.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	148.660	891,960.000	
POOL CORP	1,700	321.980	547,366.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,684	98.010	1,145,148.840	
VMWARE INC-CLASS A	8,700	116.560	1,014,072.000	
CABLE ONE INC	200	683.350	136,670.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	157.860	426,222.000	
NASDAQ INC	14,300	65.520	936,936.000	
VAIL RESORTS INC	1,700	243.360	413,712.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	7.590	158,631.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	72.330	650,970.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,000	142.140	426,420.000	
WESTLAKE CORP	1,600	104.430	167,088.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,700	93.530	1,374,891.000	
COGNEX CORP	6,900	47.740	329,406.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	52.610	384,053.000	
TELEFLEX INC	1,900	217.400	413,060.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,500	180.250	630,875.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,100	225.000	697,500.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	398.120	358,308.000	
CATALENT INC	6,900	43.040	296,976.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,800	184.080	1,067,664.000	

MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	317.750	762,600.000	
CARLISLE COS INC	2,200	250.750	551,650.000	
IDEX CORP	3,100	233.550	724,005.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,900	76.460	2,515,534.000	
ROLLINS INC	9,207	42.460	390,929.220	
AMETEK INC	9,600	139.320	1,337,472.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,000	76.420	764,200.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	54.730	353,008.500	
HEICO CORP	1,800	163.760	294,768.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	102.870	267,462.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	437.770	700,432.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,800	82.300	888,840.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	313.450	532,865.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	18,260	523.670	9,562,214.200	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	57.060	185,445.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,400	341.460	819,504.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	100.600	533,180.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,200	1,502.480	1,802,976.000	
UGI CORP	8,500	38.610	328,185.000	
CUMMINS INC	5,800	250.310	1,451,798.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,300	74.100	2,393,430.000	
CDW CORP/DE	5,600	185.600	1,039,360.000	
SIGNATURE BANK	2,650	132.030	349,879.500	
COSTAR GROUP INC	16,400	80.800	1,325,120.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	223.530	536,472.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	298.340	1,193,360.000	
MERCADOLIBRE INC	1,890	962.080	1,818,331.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	186.960	560,880.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,516	139.510	1,606,597.160	
DEXCOM INC	16,200	113.720	1,842,264.000	
NORDSON CORP	2,090	231.010	482,810.900	
COPART INC	17,400	64.420	1,120,908.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,000	156.220	1,093,540.000	
SEAGEN INC	5,700	131.760	751,032.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,100	193.560	600,036.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	218.220	720,126.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	620.610	1,297,074.900	

BIO-TECHNE CORP	1,580	328.610	519,203.800	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	120.160	468,624.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,000	76.260	686,340.000	
KINDER MORGAN INC	84,381	18.420	1,554,298.020	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	230.080	2,254,784.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,600	259.790	415,664.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	26.600	877,800.000	
T-MOBILE US INC	25,927	148.830	3,858,715.410	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	35.260	238,005.000	
COCA-COLA CO/THE	170,450	61.140	10,421,313.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,800	50.790	446,952.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	112.770	783,751.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,400	26.150	324,260.000	
CSX CORP	89,900	30.880	2,776,112.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	230.180	874,684.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,325	98.310	621,810.750	
AMAZON.COM INC	378,800	94.140	35,660,232.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,700	75.040	1,928,528.000	
EXXON MOBIL CORP	174,205	112.080	19,524,896.400	
AES CORP	27,100	27.660	749,586.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	323.490	517,584.000	
EOG RESOURCES INC	24,200	141.020	3,412,684.000	
EQT CORP	14,100	41.030	578,523.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	90.950	591,175.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	789.140	394,570.000	
ABIOMED INC	1,900	377.290	716,851.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,500	162.000	1,053,000.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,400	146.190	1,812,756.000	
FORD MOTOR CO	163,423	13.990	2,286,287.770	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	42.530	301,963.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	19.300	120,374.100	
ENTEGRIS INC	6,200	73.340	454,708.000	
AERCAP HOLDINGS NV	5,600	59.340	332,304.000	
FORTINET INC	28,200	52.150	1,470,630.000	
MARKEL CORP	550	1,259.290	692,609.500	
NEXTERA ENERGY INC	81,280	83.200	6,762,496.000	
MASIMO CORP	2,200	141.460	311,212.000	

FREEPORT-MCMORAN INC	59,908	36.340	2,177,056.720	
INSULET CORP	2,900	295.530	857,037.000	
US BANCORP	58,400	43.380	2,533,392.000	
UNITED RENTALS INC	3,000	345.700	1,037,100.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	149.370	373,425.000	
FASTENAL CO	23,800	51.660	1,229,508.000	
FISERV INC	25,433	99.860	2,539,739.380	
GENERAL ELECTRIC CO	45,506	85.480	3,889,852.880	
GENERAL MOTORS CO	57,300	39.770	2,278,821.000	
ZENDESK INC	5,100	77.460	395,046.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,800	248.220	2,432,556.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,250	379.200	5,403,600.000	
ALPHABET INC-CL A	248,800	97.430	24,240,584.000	
ALPHABET INC-CL C	233,340	97.800	22,820,652.000	
OWENS CORNING	3,900	90.060	351,234.000	
GENERAL MILLS INC	24,900	81.030	2,017,647.000	
FIRSTENERGY CORP	22,418	38.480	862,644.640	
GENUINE PARTS CO	5,950	180.680	1,075,046.000	
FIFTH THIRD BANCORP	28,400	35.630	1,011,892.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,050	224.000	1,803,200.000	
HALLIBURTON CO	37,300	36.710	1,369,283.000	
HOME DEPOT INC	42,550	313.180	13,325,809.000	
ASSURANT INC	2,250	124.950	281,137.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	59,500	14.890	885,955.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,710	227.310	388,700.100	
HERSHEY CO/THE	6,000	225.210	1,351,260.000	
HUMANA INC	5,200	529.900	2,755,480.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	171.940	1,874,146.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	36.210	120,217.200	
HENRY SCHEIN INC	5,600	78.910	441,896.000	
HP INC	47,300	29.480	1,394,404.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	53,800	15.770	848,426.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	41.980	286,639.440	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,900	57.610	455,119.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	42.300	124,785.000	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	57.670	888,118.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	30,403	38.100	1,158,354.300	
ENPHASE ENERGY INC	5,600	311.940	1,746,864.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,200	147.640	5,492,208.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	35.770	511,511.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	64.410	334,932.000	
ZOETIS INC	19,500	145.640	2,839,980.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,699	176.240	1,709,351.760	
CHENIERE ENERGY INC	9,500	167.750	1,593,625.000	
ALLEGION PLC	3,650	112.960	412,304.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	20.020	259,719.460	
WASTE CONNECTIONS INC	10,637	140.200	1,491,307.400	
JUNIPER NETWORKS INC	13,400	31.570	423,038.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	146.140	643,016.000	
JOHNSON & JOHNSON	108,900	176.200	19,188,180.000	
PLUG POWER INC	21,100	15.840	334,224.000	
ABBVIE INC	73,072	154.980	11,324,698.560	
HOLOGIC INC	10,100	73.480	742,148.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	13,900	131.400	1,826,460.000	
KROGER CO	28,600	48.260	1,380,236.000	
KLA CORP	6,200	376.340	2,333,308.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	476.820	4,720,518.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	188.450	584,195.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	38.230	401,415.000	
LOWE'S COS INC	27,200	209.930	5,710,096.000	
ELI LILLY & CO	33,385	361.670	12,074,352.950	
LAM RESEARCH CORP	5,680	456.700	2,594,056.000	
LOEWS CORP	8,600	56.620	486,932.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	37.730	250,866.770	
MCDONALD'S CORP	30,650	273.370	8,378,790.500	
3M CO	23,490	126.760	2,977,592.400	
META PLATFORMS INC CLASS A	94,800	112.050	10,622,340.000	
S&P GLOBAL INC	14,439	345.870	4,994,016.930	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,600	356.320	926,432.000	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,320	306.390	710,824.800	
ALCOA CORP	7,700	47.310	364,287.000	
PHILLIPS 66	19,900	108.990	2,168,901.000	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	36.740	589,677.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,400	83.760	871,104.000	
METLIFE INC	28,400	75.500	2,144,200.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	35,200	44.000	1,548,800.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,200	135.480	1,381,896.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,898	262.940	1,813,760.120	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,401.310	1,261,179.000	
BAKER HUGHES CO	40,823	29.130	1,189,173.990	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,800	264.740	1,270,752.000	
MERCK & CO. INC.	104,621	104.230	10,904,646.830	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	69.380	1,439,704.380	
MASCO CORP	9,800	49.930	489,314.000	
M & T BANK CORP	7,399	170.610	1,262,343.390	
MARSH & MCLENNAN COS	20,770	167.500	3,478,975.000	
BLACK KNIGHT INC	6,350	60.800	386,080.000	
HEICO CORP-CLASS A	3,020	127.950	386,409.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,502	161.710	1,859,988.420	
WORKDAY INC-CLASS A	8,200	146.740	1,203,268.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	33.240	96,396.000	
BLOCK INC CLASS A	21,512	65.820	1,415,919.840	
TRANSUNION	8,000	60.440	483,520.000	
VISTRA CORP	17,600	22.910	403,216.000	
NOVOCURE LTD	3,850	77.490	298,336.500	
NETAPP INC	9,200	73.720	678,224.000	
NIKE INC -CL B	52,500	105.420	5,534,550.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,900	246.760	2,442,924.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,900	74.170	1,698,493.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,105	121.590	985,486.950	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	26.010	369,342.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,100	520.420	3,174,562.000	
APTIV PLC	11,200	108.030	1,209,936.000	
NEWMONT CORP	32,811	45.130	1,480,760.430	
MCKESSON CORP	6,100	369.730	2,255,353.000	
XYLEM INC	7,300	112.630	822,199.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,100	96.280	6,171,548.000	
NUCOR CORP	11,100	142.030	1,576,533.000	
WESTERN UNION CO	15,246	13.890	211,766.940	

GODADDY INC - CLASS A	6,800	74.030	503,404.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	13.350	219,500.700	
EVERGY INC	9,350	58.650	548,377.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,824	71.250	2,766,210.000	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,150	267.980	308,177.000	
OKTA INC	6,200	49.860	309,132.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	45.870	133,023.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	86.260	483,056.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	11.910	206,102.550	
LINDE PLC	20,846	334.910	6,981,533.860	
WIX.COM LTD	2,310	85.090	196,557.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	30.650	484,270.000	
KKR & CO INC	23,300	51.840	1,207,872.000	
PAYCHEX INC	13,400	120.830	1,619,122.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	838.270	2,263,329.000	
ALTRIA GROUP INC	74,900	44.200	3,310,580.000	
P G & E CORP	61,700	15.020	926,734.000	
PFIZER INC	232,113	48.230	11,194,809.990	
CIGNA CORP	13,100	319.210	4,181,651.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	42.040	496,114.040	
XCEL ENERGY INC	22,500	68.380	1,538,550.000	
STERIS PLC	4,100	166.010	680,641.000	
SEA LTD-ADR	15,500	56.940	882,570.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	29.140	175,801.620	
FOX CORP - CLASS A	12,799	30.930	395,873.070	
STRYKER CORP	14,080	223.610	3,148,428.800	
LYFT INC-A	12,500	11.210	140,125.000	
DOW INC	30,118	50.070	1,508,008.260	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,500	57.250	257,625.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,400	81.640	767,416.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,300	305.630	1,619,839.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	60,900	28.960	1,763,664.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,500	249.940	2,374,430.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	99,267	142.570	14,152,496.190	
EXELON CORP	40,522	38.580	1,563,338.760	
TELADOC HEALTH INC	6,500	28.790	187,135.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,808	53.700	902,589.600	

NVR INC	130	4,392.590	571,036.700	
CONOCOPHILLIPS	53,502	128.590	6,879,822.180	
TWILIO INC - A	7,000	49.250	344,750.000	
DOCUSIGN INC	8,300	46.000	381,800.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	316.390	664,419.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,700	65.280	372,096.000	
PEPSICO INC	57,200	181.330	10,372,076.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,820	148.900	270,998.000	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	22.280	269,588.000	
MONGODB INC	2,800	159.880	447,664.000	
SNAP INC - A	45,800	10.520	481,816.000	
CORTEVA INC	29,868	65.200	1,947,393.600	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,500	107.330	1,663,615.000	
AMCOR PLC	61,400	11.820	725,748.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,400	138.990	1,167,516.000	
ROKU INC	4,800	55.650	267,120.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,500	146.710	1,100,325.000	
ACCENTURE PLC-CL A	26,200	286.500	7,506,300.000	
PENTAIR PLC	6,675	45.030	300,575.250	
QUALCOMM INC	46,300	123.850	5,734,255.000	
INVESCO LTD	14,100	18.940	267,054.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	147.500	376,125.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	90.900	963,540.000	
DATADOG INC - CLASS A	10,000	76.520	765,200.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,800	24.380	580,244.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,500	736.730	3,315,285.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,100	133.890	1,218,399.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	1,940.280	3,298,476.000	
ROSS STORES INC	14,500	107.590	1,560,055.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	129.040	494,223.200	
RESMED INC	6,100	224.400	1,368,840.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,930	146.420	721,850.600	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	75.500	339,750.000	
MODERNA INC	13,900	181.590	2,524,101.000	
HUBSPOT INC	1,880	272.600	512,488.000	
PERKINELMER INC	5,100	136.170	694,467.000	
CARRIER GLOBAL CORP	35,087	43.920	1,541,021.040	

OTIS WORLDWIDE CORP	17,538	77.760	1,363,754.880	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,900	113.310	441,909.000	
AVANTOR INC	24,800	20.880	517,824.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	28.290	226,320.000	
DYNATRACE INC	8,100	36.590	296,379.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	18,300	49.770	910,791.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	38,685	22.490	870,025.650	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	26.610	292,710.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,400	42.870	617,328.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	47.110	152,165.300	
MATCH GROUP INC	11,600	46.400	538,240.000	
CHEVRON CORP	77,218	182.990	14,130,121.820	
ZSCALER INC	3,500	138.730	485,555.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,800	61.720	975,176.000	
ETSY INC	5,200	113.920	592,384.000	
TESLA INC	109,150	180.190	19,667,738.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,200	146.200	1,345,040.000	
GEN DIGITAL INC	23,600	22.620	533,832.000	
UNITY SOFTWARE INC	7,900	34.680	273,972.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	80.200	529,480.400	
SYNOPSYS INC	6,300	325.890	2,053,107.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,950	40.920	161,634.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,500	47.010	493,605.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	374.380	1,836,333.900	
VIATRIS INC	49,021	11.000	539,231.000	
DOORDASH INC - A	7,850	58.290	457,576.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	31.720	463,112.000	
AIRBNB INC-CLASS A	15,600	97.770	1,525,212.000	
CBRE GROUP INC - A	13,600	75.300	1,024,080.000	
SOUTHERN CO/THE	44,000	65.570	2,885,080.000	
SYSCO CORP	21,100	85.060	1,794,766.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,903	184.560	1,827,697.680	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	50.620	126,550.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	60.900	280,140.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	100.640	790,024.000	
SCHLUMBERGER LTD	58,452	53.440	3,123,674.880	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	44.030	272,986.000	

AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	13.510	104,027.000	
AT&T INC	296,191	18.970	5,618,743.270	
APA CORP	14,400	46.340	667,296.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	38.110	230,565.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,000	72.460	1,304,280.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	49.980	434,826.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,200	240.040	2,448,408.000	
SEMPRA ENERGY	13,000	157.840	2,051,920.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	38.540	300,612.000	
CLARIVATE PLC	13,400	9.260	124,084.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,500	7.390	506,215.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	54.570	461,116.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	45.260	221,774.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,100	175.180	6,674,358.000	
SALESFORCE.COM INC	41,066	148.040	6,079,410.640	
WESTROCK CO	10,700	36.510	390,657.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,609	61.940	1,028,761.460	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,834	66.980	1,931,301.320	
TERADYNE INC	6,600	92.900	613,140.000	
UNION PACIFIC CORP	25,980	210.580	5,470,868.400	
MARATHON OIL CORP	29,900	30.800	920,920.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	121.180	2,906,865.840	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	61,479	95.360	5,862,637.440	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,400	178.970	5,440,688.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,804	213.780	1,668,339.120	
AMEREN CORPORATION	10,700	86.180	922,126.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,766	530.000	20,545,980.000	
APPLOVIN CORP CLASS A	4,900	13.950	68,355.000	
VERISIGN INC	4,100	194.250	796,425.000	
LUCID GROUP INC	16,800	11.260	189,168.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	13,200	30.340	400,488.000	
VALERO ENERGY CORP	16,942	137.620	2,331,558.040	
ULTA BEAUTY INC	2,200	440.500	969,100.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	39.700	432,253.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	128.670	364,136.100	

ELEVANCE HEALTH INC	10,000	495.320	4,953,200.000	
WALT DISNEY CO/THE	75,262	91.800	6,909,051.600	
WELLS FARGO & CO	156,722	46.500	7,287,573.000	
WASTE MANAGEMENT INC	17,200	161.180	2,772,296.000	
WILLIAMS COS INC	50,400	33.400	1,683,360.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	219.860	1,011,356.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	147.420	353,808.000	
WALMART INC	62,600	150.230	9,404,398.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,700	114.090	992,583.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	76.000	342,000.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	55,900	3.210	179,439.000	
WABTEC CORP	7,111	99.160	705,126.760	
TJX COMPANIES INC	48,400	78.160	3,782,944.000	
WATERS CORP	2,500	321.160	802,900.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	256.100	563,420.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,400	39.750	1,208,400.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	232.730	1,131,765.990	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	36.860	468,122.000	
WEC ENERGY GROUP INC	13,000	95.700	1,244,100.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	57.690	1,176,876.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	68,150	210.800	14,366,020.000	
PPL CORP	30,400	28.090	853,936.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,524	93.300	1,261,789.200	
PULTEGROUP INC	9,850	42.850	422,072.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	95,453	10.770	1,028,028.810	
PPG INDUSTRIES INC	9,800	128.470	1,259,006.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,200	92.320	757,024.000	
NVIDIA CORP	103,580	154.090	15,960,642.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,113	161.160	2,757,931.080	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	24.780	86,730.000	
TYSON FOODS INC-CL A	12,100	65.520	792,792.000	
NETFLIX INC	18,390	287.980	5,295,952.200	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,200	535.240	8,670,888.000	
NRG ENERGY INC	9,850	42.240	416,064.000	
GLOBE LIFE INC	3,855	113.720	438,390.600	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,400	121.950	902,430.000	
TEXTRON INC	8,900	70.070	623,623.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	17.830	272,567.210	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	250	2,703.890	675,972.500	
OMNICOM GROUP	8,300	77.200	640,760.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,220	126.040	657,928.800	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	20,900	1.380	28,842.000	
ORACLE CORP	66,233	79.730	5,280,757.090	
MASTERCARD INC - A	35,900	343.690	12,338,471.000	
ONEOK INC	18,500	64.470	1,192,695.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	5.870	219,256.240	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,400	433.010	1,905,244.000	
AMERCO NON VOTING SERIES N	3,600	58.000	208,800.000	
YUM! BRANDS INC	11,700	124.610	1,457,937.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	6,600	98.770	651,882.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	53.500	395,900.000	
BANK OF AMERICA CORP	299,901	37.190	11,153,318.190	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	407.090	773,471.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,700	88.310	679,987.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,500	152.500	4,041,250.000	
ANALOG DEVICES INC	21,491	161.850	3,478,318.350	
ADVANCED MICRO DEVICES	67,027	73.570	4,931,176.390	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	59.820	1,972,385.040	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	94.330	622,578.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	58.690	545,817.000	
AVERY DENNISON CORP	3,430	188.220	645,594.600	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,600	59.970	1,295,352.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,600	93.700	2,305,020.000	
AON PLC-CLASS A	8,800	301.320	2,651,616.000	
AMGEN INC	22,600	287.290	6,492,754.000	
EATON CORP PLC	16,536	165.010	2,728,605.360	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	247.650	1,659,255.000	
APPLIED MATERIALS INC	36,000	104.700	3,769,200.000	
CME GROUP INC	14,900	172.500	2,570,250.000	
ECOLAB INC	10,600	148.110	1,569,966.000	
EQUIFAX INC	5,100	200.180	1,020,918.000	
GILEAD SCIENCES INC	51,900	83.620	4,339,878.000	
KEURIG DR PEPPER INC	32,300	37.420	1,208,666.000	
HORMEL FOODS CORP	12,400	48.660	603,384.000	
STATE STREET CORP	15,213	75.590	1,149,950.670	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,140	79.810	4,799,773.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,800	55.000	1,144,000.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	51.560	443,416.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	80.400	400,392.000	
CARDINAL HEALTH INC	11,300	77.680	877,784.000	
FEDEX CORP	10,200	174.720	1,782,144.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	98.960	1,657,975.840	
FMC CORP	5,150	127.650	657,397.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,513	98.270	1,033,112.510	
INTEL CORP	169,200	29.870	5,054,004.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	33.100	529,600.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	73.690	991,130.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,900	226.880	2,926,752.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.390	246,654.000	
ILLUMINA INC	6,500	220.560	1,433,640.000	
SEALED AIR CORP	5,800	51.140	296,612.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,900	262.110	3,905,439.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	129.290	562,411.500	
SNAP-ON INC	2,200	236.380	520,036.000	
CARMAX INC	6,600	66.560	439,296.000	
DUKE ENERGY CORP	31,828	96.790	3,080,632.120	
TARGET CORP	19,400	162.880	3,159,872.000	
DOVER CORP	6,000	139.470	836,820.000	
WW GRAINGER INC	1,900	597.030	1,134,357.000	
CINTAS CORP	3,800	449.370	1,707,606.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,900	35.950	715,405.000	
CLOROX COMPANY	5,100	146.790	748,629.000	
ENTERGY CORP	8,400	111.920	940,128.000	
MICROSOFT CORP	294,100	241.220	70,942,802.000	

INCYTE CORP	7,600	77.450	588,620.000	
CVS HEALTH CORP	54,169	97.350	5,273,352.150	
MEDTRONIC PLC	54,998	81.300	4,471,337.400	
MICRON TECHNOLOGY INC	46,200	58.580	2,706,396.000	
BLACKROCK INC	6,300	720.610	4,539,843.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	26,000	29.670	771,420.000	
HASBRO INC	5,400	59.520	321,408.000	
KELLOGG CO	10,400	70.610	734,344.000	
KEYCORP	38,600	18.610	718,346.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	57,211	64.990	3,718,142.890	
COOPER COS INC/THE	2,000	307.400	614,800.000	
CHUBB LTD	17,599	210.140	3,698,253.860	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	108.070	291,789.000	
ALLSTATE CORP	11,400	132.740	1,513,236.000	
EBAY INC	24,900	45.680	1,137,432.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	45,550	84.920	3,868,106.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	84.250	438,100.000	
DISH NETWORK CORP-A	9,600	15.230	146,208.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,600	233.460	2,241,216.000	
TRIMBLE INC	10,200	57.990	591,498.000	
LENNAR CORP-A	10,600	84.710	897,926.000	
LEAR CORP	2,500	145.640	364,100.000	
PROGRESSIVE CORP	24,200	128.360	3,106,312.000	
PACCAR INC	14,437	103.870	1,499,571.190	
BIOGEN INC	6,100	302.890	1,847,629.000	
IDEXX LABORATORIES INC	3,500	413.890	1,448,615.000	
STARBUCKS CORP	47,400	97.950	4,642,830.000	
PTC INC	4,600	123.300	567,180.000	
EVERSOURCE ENERGY	14,300	79.650	1,138,995.000	
INTUIT INC	11,080	380.070	4,211,175.600	
BORGWARNER INC	9,700	42.220	409,534.000	
BEST BUY CO INC	8,850	72.050	637,642.500	
BALL CORP	13,004	55.090	716,390.360	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,097	42.960	2,538,807.120	
ELECTRONIC ARTS INC	11,600	130.080	1,508,928.000	
VULCAN MATERIALS CO	5,500	178.890	983,895.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,600	314.630	3,335,078.000	
VF CORP	13,400	33.080	443,272.000	

	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	25,225	18.660	470,698.500	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	99.970	219,934.000	
	CARNIVAL CORP	40,900	9.470	387,323.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	14.330	312,394.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	184,790	34.500	6,375,255.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	46.160	401,592.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	48,600	3.970	192,942.000	
アメリカ・ドル　小計				アメリカ・ドル 1,419,349,057.240 (199,219,833,674)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	23.445	7,157,688.160	
	HALEON PLC	204,162	2.872	586,353.260	
	BP PLC	788,177	4.760	3,752,116.600	
	UNILEVER PLC	104,121	40.405	4,207,009.000	
	BARCLAYS PLC	683,263	1.582	1,081,058.710	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.854	287,579.810	
	PRUDENTIAL PLC	112,204	9.786	1,098,028.340	
	NATWEST GROUP PLC	218,395	2.581	563,677.490	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	20.310	143,469.840	
	BAE SYSTEMS PLC	128,820	7.702	992,171.640	
	AVIVA PLC	115,648	4.551	526,314.040	
	AVEVA GROUP PLC	4,948	31.640	156,554.720	
	GSK	165,976	13.684	2,271,215.580	
	INFORMA PLC	60,095	5.916	355,522.020	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	178,792	1.308	233,859.930	
	AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.668	215,395.330	
	DCC PLC	3,964	43.420	172,116.880	
	OCADO GROUP PLC	23,827	6.782	161,594.710	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	114.000	330,600.000	
	HALMA PLC	15,260	22.250	339,535.000	
	ENTAIN PLC	24,059	13.400	322,390.600	
	JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.196	119,241.200	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	5.960	179,801.280	
	M&G PLC	104,504	1.983	207,283.680	
	RELX PLC	78,540	22.830	1,793,068.200	
	DIAGEO PLC	93,276	36.740	3,426,960.240	
	RIO TINTO PLC	45,886	53.850	2,470,961.100	

STANDARD CHARTERED PLC	104,659	5.816	608,696.740	
TESCO PLC	306,336	2.313	708,555.160	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	10.680	377,121.480	
GLENCORE PLC	402,288	5.058	2,034,772.700	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	8.374	110,955.500	
SMITHS GROUP PLC	15,383	15.750	242,282.250	
PEARSON PLC	28,363	9.770	277,106.510	
SAINSBURY (J) PLC	71,864	2.168	155,801.150	
NEXT PLC	5,311	57.320	304,426.520	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.031	151,293.190	
WHITBREAD PLC	8,127	25.120	204,150.240	
BUNZL PLC	13,562	30.260	410,386.120	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	0.974	1,053,113.120	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	69.140	387,253.140	
KINGFISHER PLC	78,711	2.461	193,707.770	
WPP PLC	45,847	8.688	398,318.730	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	27,881	10.260	286,059.060	
SEVERN TRENT PLC	10,232	27.300	279,333.600	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	5.344	399,228.860	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,182	58.120	1,696,057.840	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	11.880	258,176.160	
SCHRODERS PLC	27,352	4.593	125,627.730	
SSE PLC	43,575	16.965	739,249.870	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	3.992	157,684.000	
ASTRAZENECA PLC	63,233	109.200	6,905,043.600	
FERGUSON PLC	8,777	98.500	864,534.500	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.614	626,547.040	
3I GROUP PLC	39,073	13.135	513,223.850	
ASHTEAD GROUP PLC	17,854	50.100	894,485.400	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	8.002	320,992.220	
NATIONAL GRID PLC	148,817	10.175	1,514,212.970	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.454	1,296,043.410	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	21.210	809,394.810	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	37.280	157,768.960	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,850	33.110	2,908,713.500	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	15.340	211,692.000	

	HSBC HOLDINGS PLC	819,921	4.789	3,926,601.660	
	ANGLO AMERICAN PLC	51,856	31.605	1,638,908.880	
	MONDI PLC	19,853	15.750	312,684.750	
	COMPASS GROUP PLC	72,800	18.505	1,347,164.000	
	PERSIMMON PLC	12,832	12.995	166,751.840	
	BT GROUP PLC	345,300	1.228	424,028.400	
	COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	19.950	155,610.000	
	BURBERRY GROUP PLC	16,061	20.980	336,959.780	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,523	47.400	356,590.200	
	INTERTEK GROUP PLC	6,481	39.240	254,314.440	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,450	81.220	1,092,409.000	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	14.290	94,314.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,500	20.920	156,900.000	
	ANTOFAGASTA PLC	15,300	13.230	202,419.000	
	ABRDN PLC	84,362	2.025	170,833.050	
	EXPERIAN PLC	37,575	28.890	1,085,541.750	
イギリス・ポンド　小計				イギリス・ポンド 73,455,607.810 (12,236,969,704)	
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	51,498	19.920	1,025,840.160	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	263.000	480,238.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	150.500	683,420.500	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	89,000	6.135	546,015.000	
	ICL GROUP LTD	30,461	28.330	862,960.130	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	670.000	737,000.000	
	BANK HAPOALIM BM	54,645	32.950	1,800,552.750	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	66,426	32.480	2,157,516.480	
	NICE LTD	2,731	688.600	1,880,566.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	131.400	841,879.800	
イスラエル・シュケル　小計				イスラエル・シュケル 11,015,989.420 (445,136,304)	
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	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	84,950	4.500	382,275.000	
	TELSTRA GROUP LTD	156,394	3.940	616,192.360	

MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	2.830	297,416.020	
BHP GROUP LTD	197,318	43.940	8,670,152.920	
SOUTH32 LTD	177,077	3.910	692,371.070	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	74,059	37.890	2,806,095.510	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,005	19.960	1,317,459.800	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,031	30.660	3,833,450.460	
WESTPAC BANKING CORP	136,277	23.620	3,218,862.740	
SANTOS LTD	125,413	7.380	925,547.940	
AUST AND NZ BANKING GROUP	116,889	24.500	2,863,780.500	
RIO TINTO LTD	14,467	106.380	1,538,999.460	
ORIGIN ENERGY LTD	68,887	7.500	516,652.500	
AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	3.690	249,444.000	
XERO LTD	5,135	68.920	353,904.200	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	27.500	217,250.000	
COLES GROUP LTD	52,080	16.940	882,235.200	
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	58.800	317,520.000	
IDP EDUCATION LTD	7,900	30.210	238,659.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	10.000	445,840.000	
EVOLUTION MINING LTD	65,600	2.560	167,936.000	
REECE LTD	10,500	15.000	157,500.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.160	367,021.600	
SEEK LTD	12,845	21.560	276,938.200	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	13.460	370,540.340	
NEWCREST MINING LTD	34,097	19.060	649,888.820	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,519	105.820	7,039,040.580	
AMPOL LTD	8,800	28.820	253,616.000	
ORICA LTD	17,751	15.090	267,862.590	
QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	12.400	697,735.600	
WOOLWORTHS GROUP LTD	47,331	34.660	1,640,492.460	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	5.880	208,557.720	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,415	29.550	514,613.250	
MACQUARIE GROUP LTD	14,198	179.320	2,545,985.360	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	36.200	829,305.800	
CSL LTD	18,775	294.400	5,527,360.000	
WESFARMERS LTD	44,206	47.570	2,102,879.420	
COCHLEAR LTD	2,510	206.130	517,386.300	

	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	16.620	295,836.000	
	SUNCORP GROUP LTD	48,015	11.950	573,779.250	
	ASX LTD	7,365	72.800	536,172.000	
	COMPUTERSHARE LTD	20,689	27.090	560,465.010	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	96,410	4.900	472,409.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	31.900	552,763.200	
	BRAMBLES LTD	56,158	11.520	646,940.160	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,666	83.170	554,411.220	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	62.420	435,254.660	
	REA GROUP LTD	2,023	121.430	245,652.890	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	64.060	140,932.000	
オーストラリア・ドル　小計				オーストラリア・ドル 59,533,384.110 (5,561,013,410)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	61.720	2,067,620.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	75.580	718,010.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	2,022.290	1,617,832.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	89.380	1,044,584.060	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	49.550	886,945.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,150	194.260	1,388,959.000	
	BCE INC	4,930	63.370	312,414.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,800	185.680	1,448,304.000	
	SUNCOR ENERGY INC	58,230	47.660	2,775,241.800	
	METRO INC/CN	9,600	76.670	736,032.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	97.390	1,305,026.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	69.040	3,327,728.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,600	63.560	2,326,296.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	73,700	89.420	6,590,254.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,400	31.390	357,846.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	57,550	132.700	7,636,885.000	
	TOURMALINE OIL CORP	12,900	79.730	1,028,517.000	
	TC ENERGY CORP	39,750	64.000	2,544,000.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	22,329	47.070	1,051,026.030	
	BARRICK GOLD CORP	72,100	20.910	1,507,611.000	
	CAE INC	12,600	28.420	358,092.000	
	THOMSON REUTERS CORP	6,812	151.950	1,035,083.400	

EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	34.780	226,070.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	109.070	381,745.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,150	62.370	383,575.500	
HYDRO ONE LTD	13,100	35.510	465,181.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,760	110.940	749,954.400	
NORTHLAND POWER INC	9,400	37.000	347,800.000	
WSP GLOBAL INC	5,000	159.850	799,250.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	99.980	329,934.000	
PARKLAND CORP	5,800	25.820	149,756.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	27.150	162,900.000	
EMERA INC	10,400	51.320	533,728.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	140.170	462,561.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	35.850	172,080.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,400	59.710	859,824.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	93.310	149,296.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,600	10.400	255,840.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,517	63.960	1,184,347.320	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	10.280	274,476.000	
AIR CANADA	6,500	18.610	120,965.000	
KINROSS GOLD CORP	53,000	5.480	290,440.000	
BANK OF MONTREAL	27,300	132.270	3,610,971.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	33.080	734,376.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	46,300	49.020	2,269,626.000	
NUTRIEN LTD	22,319	104.110	2,323,631.090	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,300	41.250	218,625.000	
CAMECO CORP	15,800	31.890	503,862.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	165.910	248,865.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	37.020	262,842.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	20.150	106,795.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	40.190	104,494.000	
TELUS CORP	10,800	29.170	315,036.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	19,400	43.970	853,018.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	147.860	325,292.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	79.950	3,725,670.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	747.660	747,660.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	82.960	937,448.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,937	157.420	462,342.540	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	19.860	154,908.000	

	BLACKBERRY LTD	22,400	6.340	142,016.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	23,800	61.820	1,471,316.000	
	ENBRIDGE INC	82,100	53.970	4,430,937.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	57,125	59.870	3,420,073.750	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	78,000	23.570	1,838,460.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	10.140	114,582.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	37,720	105.090	3,963,994.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	72.970	321,068.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	38.390	287,925.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,750	166.490	3,954,137.500	
	CGI INC - CLASS A	8,700	114.230	993,801.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	69.510	201,579.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	36.450	692,550.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	38.880	120,528.000	
	TMX GROUP LTD	2,300	135.650	311,995.000	
	OPEN TEXT CORP	11,000	38.790	426,690.000	
	SAPUTO INC	10,200	34.500	351,900.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	29.510	687,583.000	
	FORTIS INC	19,300	53.430	1,031,199.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	73.420	323,048.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	7.680	188,928.000	
	CENOVUS ENERGY INC	55,500	27.130	1,505,715.000	
	DOLLARAMA INC	11,200	77.700	870,240.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	22.390	248,529.000	
	KEYERA CORP	8,800	29.380	258,544.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	18.970	542,542.000	
カナダ・ドル　小計				カナダ・ドル 96,969,372.290 (10,164,329,602)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	107,400	3.620	388,788.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,800	30.250	1,536,700.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	77,900	35.540	2,768,566.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.480	295,783.000	
	KEPPEL CORP LTD	62,700	7.410	464,607.000	
	UOL GROUP LTD	20,000	6.610	132,200.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.170	131,537.000	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	145,700	12.550	1,828,535.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.865	205,870.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.570	196,784.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,350	2.680	952,338.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	3.470	217,569.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.390	335,223.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.120	329,600.000	
シンガポール・ドル　小計				シンガポール・ドル 9,784,100.000 (998,663,087)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	140,483	17.485	2,456,345.250	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	364.800	430,464.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	674.500	188,860.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,360	33.170	210,961.200	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,061	308.000	8,642,788.000	
	SIKA AG-REG	5,834	245.000	1,429,330.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	98,800.000	395,200.000	
	ABB LTD-REG	65,605	29.280	1,920,914.400	
	SWISS RE AG	12,047	80.520	970,024.440	
	NESTLE SA-REG	112,433	110.880	12,466,571.040	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	968.400	871,560.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	176.600	282,736.600	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	4.056	422,022.740	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	52.560	457,692.480	
	SGS SA-REG	252	2,304.000	580,608.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	168.600	157,472.400	
	TEMENOS AG - REG	2,500	58.680	146,700.000	
	VAT GROUP AG	1,050	262.600	275,730.000	
	ALCON INC	19,959	62.200	1,241,449.800	
	SIG GROUP N AG	13,000	20.080	261,040.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,159	247.300	286,620.700	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,010	441.800	2,655,218.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	138.600	249,480.000	
	CLARIANT AG-REG	8,678	16.080	139,542.240	
	NOVARTIS AG-REG	86,320	81.510	7,035,943.200	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	1,927.000	271,707.000	

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	82.750	103,437.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,849	116.250	2,423,696.250	
	SWISSCOM AG-REG	1,036	499.700	517,689.200	
	GEBERIT AG-REG	1,433	465.100	666,488.300	
	GIVAUDAN-REG	369	3,205.000	1,182,645.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	108.800	477,523.200	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	251.800	531,298.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,929	55.800	386,638.200	
	LONZA GROUP AG-REG	2,974	495.200	1,472,724.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	45.880	87,172.000	
	HOLCIM LTD	21,829	48.080	1,049,538.320	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	502.600	621,716.200	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	225.900	482,296.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,025	81.200	245,630.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,980.000	419,160.000	
スイス・フラン　小計				スイス・フラン 55,114,634.960 (8,107,362,803)	
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	
	SAGAX CLASS B	7,924	226.900	1,797,955.600	
	INVESTOR CLASS A	21,458	199.000	4,270,142.000	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	50.670	1,257,021.360	
	ERICSSON LM-B SHS	125,588	64.920	8,153,172.960	
	VOLVO AB-B SHS	64,930	192.100	12,473,053.000	
	SKF AB-B SHARES	16,495	173.250	2,857,758.750	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	141.900	1,220,340.000	
	SWEDISH MATCH AB	65,778	115.100	7,571,047.800	
	TELE2 AB-B SHS	24,423	93.260	2,277,688.980	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	235.800	2,169,360.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	70,028	118.150	8,273,808.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	62,759	106.150	6,661,867.850	
	SWEDBANK AB - A SHARES	38,966	166.000	6,468,356.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	31,425	117.700	3,698,722.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	26,069	138.650	3,614,466.850	
	SKANSKA AB-B SHS	14,638	181.100	2,650,941.800	
	SANDVIK AB	45,700	190.900	8,724,130.000	
	INVESTOR AB-B SHS	78,394	191.480	15,010,883.120	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	115,575	129.460	14,962,339.500	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	202.000	1,616,000.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,906	419.100	1,637,004.600	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	90.260	1,078,607.000	
	TELIA CO AB	110,667	29.220	3,233,689.740	
	ALFA LAVAL AB	12,700	296.400	3,764,280.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,161	116.800	7,844,404.800	
	ASSA ABLOY AB-B	43,126	239.800	10,341,614.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	266.000	1,394,638.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	46.105	1,211,086.140	
	INDUTRADE AB	11,371	217.500	2,473,192.500	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	212.800	1,496,409.600	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	471.100	1,413,300.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	209.700	1,195,290.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	182.900	1,737,550.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,208	98.860	6,446,462.880	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,204	248.000	6,498,592.000	
	EMBRACER GROUP AB	26,594	45.915	1,221,063.510	
	BOLIDEN AB	11,387	369.900	4,212,051.300	
	EPIROC AB-A	27,436	189.100	5,188,147.600	
	EPIROC AB-B	16,780	162.050	2,719,199.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	80.060	1,365,023.000	
	NORDEA BANK ABP	146,748	108.340	15,898,678.320	
	EQT AB	12,318	241.500	2,974,797.000	
	EVOLUTION AB	7,867	999.000	7,859,133.000	
	KINNEVIK AB - B	10,431	157.150	1,639,231.650	
	HEXAGON AB-B SHS	83,750	121.100	10,142,125.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	264.900	1,642,380.000	
スウェーデン・クローナ　小計				スウェーデン・クローナ 222,357,007.710 (2,930,665,362)	
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	70,105	812.000	56,925,260.000	
	DANSKE BANK A/S	29,678	122.400	3,632,587.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	14,700.000	1,925,700.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	43,042	173.280	7,458,317.760	
	GN STORE NORD A/S	5,465	173.300	947,084.500	
	CARLSBERG AS-B	4,180	916.800	3,832,224.000	

	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,800	402.100	3,538,480.000	
	COLOPLAST-B	5,112	888.000	4,539,456.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	1,088.000	9,008,640.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,669.500	617,715.000	
	DEMANT A/S	4,275	203.300	869,107.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	15,020.000	3,454,600.000	
	TRYG A/S	14,990	162.700	2,438,873.000	
	PANDORA A/S	4,000	507.600	2,030,400.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	436.800	1,878,240.000	
	GENMAB A/S	2,829	3,131.000	8,857,599.000	
	ORSTED A/S	8,140	637.700	5,190,878.000	
デンマーク・クローネ　小計				デンマーク・クローネ 117,145,161.960 (2,280,816,303)	
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	52,500	4.700	246,750.000	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.660	169,800.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,530	5.120	412,313.600	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.915	412,474.390	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	20.500	496,100.000	
ニュージーランド・ドル　小計				ニュージーランド・ドル 1,737,437.990 (149,784,529)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	40,025	184.050	7,366,601.250	
	NORSK HYDRO ASA	57,866	71.220	4,121,216.520	
	ORKLA ASA	32,317	68.260	2,205,958.420	
	TELENOR ASA	29,131	98.180	2,860,081.580	
	EQUINOR ASA	42,051	342.550	14,404,570.050	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,124	457.800	3,261,367.200	
	MOWI ASA	17,800	150.350	2,676,230.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	189.800	1,527,890.000	
	AKER BP ASA	13,597	336.800	4,579,469.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	378.800	1,410,272.400	
	SALMAR ASA	2,452	341.800	838,093.600	
	ADEVINTA ASA	12,000	79.900	958,800.000	
ノルウェー・クローネ　小計				ノルウェー・クローネ	

				46,210,550.620 (634,932,966)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	29,169	20.720	604,381.680	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	30.115	539,118.730	
	EXOR NV	4,500	73.920	332,640.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	4,600	107.050	492,430.000	
	BAYER AG-REG	39,442	53.790	2,121,585.180	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	19.460	155,680.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	10.212	830,521.530	
	COMMERZBANK AG	42,031	8.068	339,106.100	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	188.600	226,320.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,451	141.860	1,056,998.860	
	SIEMENS AG-REG	30,742	132.500	4,073,315.000	
	E.ON SE	90,136	9.116	821,679.770	
	UNIPER SE	6,650	5.460	36,309.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,293	84.150	1,118,605.950	
	GEA GROUP AG	5,800	39.840	231,072.000	
	CONTINENTAL AG	4,342	56.760	246,451.920	
	BASF SE	36,875	49.625	1,829,921.870	
	ALLIANZ SE-REG	16,411	203.950	3,347,023.450	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,168	66.980	480,112.640	
	RHEINMETALL AG	1,813	180.550	327,337.150	
	RWE AG	25,791	41.210	1,062,847.110	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	7.336	161,025.200	
	BRENNTAG SE	6,090	65.700	400,113.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	24.410	402,350.030	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	19.590	75,206.010	
	SAP SE	41,960	105.160	4,412,513.600	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,625	293.300	1,649,812.500	
	ZALANDO SE	8,783	30.000	263,490.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	51.700	295,103.600	
	KION GROUP AG	2,700	27.090	73,143.000	
	COVESTRO AG	7,300	36.290	264,917.000	
	RATIONAL AG	190	590.000	112,100.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	377.300	456,533.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	58.920	355,582.200	

DELIVERY HERO SE	6,443	44.190	284,716.170	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	132.650	211,178.800	
BECHTLE AG	3,238	36.670	118,737.460	
NEMETSCHEK SE	2,284	47.000	107,348.000	
SCOUT24 AG	3,600	54.760	197,136.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	2.488	94,544.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	52.140	578,597.580	
KNORR-BREMSE AG	2,800	54.180	151,704.000	
HELLOFRESH SE	6,516	23.950	156,058.200	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	14.675	253,730.750	
BEIERSDORF AG	3,980	102.350	407,353.000	
MERCK KGAA	5,189	176.200	914,301.800	
ADIDAS AG	7,200	129.200	930,240.000	
PUMA SE	4,163	51.440	214,144.720	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	62.850	257,747.850	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	130,122	19.332	2,515,518.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	29.840	240,808.800	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	62.220	2,022,150.000	
QIAGEN N.V.	9,105	46.230	420,924.150	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,430	32.095	1,682,740.850	
HANNOVER RUECK SE	2,378	177.750	422,689.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,796	38.685	1,539,508.260	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,628	170.400	1,299,811.200	
MTU AERO ENGINES AG	2,104	193.300	406,703.200	
SYMRISE AG	5,228	111.700	583,967.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.377	98,198.620	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,200	80.200	176,440.000	
VONOVIA SE	28,770	24.340	700,261.800	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	63.340	177,352.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	13.726	479,037.400	
NN GROUP NV	11,292	42.380	478,554.960	
ARCELORMITTAL	25,700	25.075	644,427.500	
HEINEKEN NV	10,407	87.900	914,775.300	
AEGON NV	72,059	4.701	338,749.350	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,983	27.595	1,158,520.880	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	70.180	498,278.000	

KONINKLIJKE DSM NV	7,017	127.500	894,667.500	
WOLTERS KLUWER	10,540	102.250	1,077,715.000	
ING GROEP NV	156,862	11.438	1,794,187.550	
KONINKLIJKE KPN NV	132,781	2.802	372,052.360	
ASML HOLDING NV	16,320	571.400	9,325,248.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	11.680	195,056.000	
IMCD NV	2,246	137.150	308,038.900	
ADYEN NV	870	1,521.600	1,323,792.000	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	21.360	154,219.200	
PROSUS NV	35,480	59.030	2,094,384.400	
JDE PEET'S NV	3,700	28.220	104,414.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,883	252.000	474,516.000	
RANDSTAD NV	4,720	55.060	259,883.200	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	71.700	304,725.000	
OCI NV	4,386	35.520	155,790.720	
TOTALENERGIES SE	99,542	57.400	5,713,710.800	
MICHELIN (CGDE)	26,740	26.270	702,459.800	
AIR LIQUIDE SA	20,995	136.640	2,868,756.800	
KERING	3,004	551.100	1,655,504.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,787	142.280	3,099,854.360	
BOUYGUES SA	9,062	28.890	261,801.180	
BNP PARIBAS	44,602	53.310	2,377,732.620	
THALES SA	4,291	117.000	502,047.000	
DANONE	25,708	49.885	1,282,443.580	
CARREFOUR SA	24,454	16.250	397,377.500	
VIVENDI	29,591	8.450	250,043.950	
L'OREAL	9,688	348.100	3,372,392.800	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,987	44.315	885,723.900	
LEGRAND SA	10,737	79.440	852,947.280	
PERNOD RICARD SA	8,411	185.700	1,561,922.700	
EURAZEO SE	1,724	60.350	104,043.400	
SOCIETE GENERALE SA	31,964	24.030	768,094.920	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	11,146	698.200	7,782,137.200	
ACCOR SA	6,717	24.470	164,364.990	
CAPGEMINI SE	6,574	178.050	1,170,500.700	
VALEO SA	8,400	18.270	153,468.000	
PUBLICIS GROUPE	9,179	62.200	570,933.800	
BUREAU VERITAS SA	11,605	26.000	301,730.000	

EIFFAGE	3,285	93.200	306,162.000	
SODEXO SA	3,491	88.960	310,559.360	
IPSEN	1,400	104.000	145,600.000	
AMUNDI SA	2,250	54.100	121,725.000	
TELEPERFORMANCE	2,315	224.500	519,717.500	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	25.920	93,312.000	
EURONEXT NV	3,300	70.120	231,396.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	66.260	350,912.960	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	331.800	364,980.000	
SEB SA	997	74.000	73,778.000	
ESSILORLUXOTTICA	11,549	173.350	2,002,019.150	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	146.300	146,300.000	
WORLDLINE SA	9,606	44.200	424,585.200	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	35.790	148,993.770	
AXA SA	76,206	27.080	2,063,658.480	
EDENRED	10,044	51.020	512,444.880	
RENAULT SA	7,755	33.045	256,263.970	
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,470.000	1,869,840.000	
STMICROELECTRONICS NV	27,439	36.995	1,015,105.800	
REMY COINTREAU	900	162.300	146,070.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	26,758	36.245	969,843.710	
WENDEL	930	87.700	81,561.000	
ORANGE	80,096	9.806	785,421.370	
ALSTOM	12,525	24.500	306,862.500	
SANOFI	45,721	86.040	3,933,834.840	
VINCI SA	21,423	95.440	2,044,611.120	
AIRBUS SE	23,736	114.640	2,721,095.040	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	24.820	649,762.780	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	9.705	476,787.240	
BIOMERIEUX	1,691	97.440	164,771.040	
ENGIE	73,328	14.380	1,054,456.640	
EDF	22,120	11.930	263,891.600	
SAFRAN SA	13,722	114.740	1,574,462.280	
ARKEMA	2,395	86.880	208,077.600	
ADP	1,110	143.850	159,673.500	
GETLINK SE	17,345	15.790	273,877.550	
BOLLORE	35,675	5.070	180,872.250	
UCB SA	4,976	74.260	369,517.760	
KBC GROUP NV	9,843	52.460	516,363.780	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	78.540	329,868.000	
SOLVAY SA	2,984	98.860	294,998.240	
UMICORE	8,269	34.120	282,138.280	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,872	53.580	1,868,441.760	
AGEAS	6,290	37.810	237,824.900	
D'IETEREN GROUP	1,036	174.300	180,574.800	
PROXIMUS	6,035	10.690	64,514.150	
ELIA GROUP SA/NV	1,333	136.200	181,554.600	
SOFINA	600	225.800	135,480.000	
ARGENX SE	2,229	356.100	793,746.900	
PRYSMIAN SPA	10,040	32.620	327,504.800	
ASSICURAZIONI GENERALI	44,600	17.260	769,796.000	
MEDIOBANCA SPA	24,407	10.175	248,341.220	
TENARIS SA	18,608	16.415	305,450.320	
UNICREDIT SPA	83,217	13.102	1,090,309.130	
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.223	84,695.650	
INTESA SANPAOLO	663,075	2.216	1,469,705.730	
ATLANTIA SPA	19,531	22.960	448,431.760	
POSTE ITALIANE SPA	21,074	9.604	202,394.690	
MONCLER SPA	8,261	49.830	411,645.630	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,217	39.490	166,529.330	
ENI SPA	101,329	14.188	1,437,655.850	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	21,064	10.030	211,271.920	
DIASORIN SPA	1,000	132.100	132,100.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.514	121,779.200	
NEXI SPA	19,900	8.636	171,856.400	
AMPLIFON SPA	4,700	27.630	129,861.000	
ENEL SPA	326,535	5.157	1,683,940.990	
SNAM SPA	79,350	4.769	378,420.150	
TERNA SPA	55,464	7.316	405,774.620	
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	14.880	599,143.200	
FINECOBANK SPA	23,200	15.000	348,000.000	
STELLANTIS NV	88,350	14.410	1,273,123.500	
FERRARI NV	5,061	208.200	1,053,700.200	
TELEFONICA SA	210,478	3.541	745,302.590	
ENDESA SA	12,100	18.660	225,786.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,700	5.448	1,458,429.600	

IBERDROLA SA	239,538	10.590	2,536,707.420	
REPSOL SA	57,201	13.795	789,087.790	
GRIFOLS SA	11,830	9.730	115,105.900	
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.606	1,778,165.010	
AMADEUS IT GROUP SA	18,086	49.690	898,693.340	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.740	275,422.000	
CAIXABANK SA	174,927	3.397	594,227.010	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.450	234,770.200	
AENA SME SA	2,900	120.500	349,450.000	
CELLNEX TELECOM SA	21,460	33.330	715,261.800	
ACCIONA SA	1,028	180.400	185,451.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	43,794	24.120	1,056,311.280	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	18.020	169,640.280	
ENAGAS SA	9,884	17.305	171,042.620	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	17.290	271,453.000	
FERROVIAL SA	19,018	24.890	473,358.020	
UPM-KYMMENE OYJ	21,428	34.420	737,551.760	
NOKIA OYJ	217,254	4.696	1,020,333.410	
WARTSILA OYJ ABP	19,124	8.110	155,095.640	
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	14.140	302,596.000	
ELISA OYJ	5,725	49.400	282,815.000	
SAMPO OYJ-A SHS	19,622	47.770	937,342.940	
FORTUM OYJ	16,900	15.060	254,514.000	
KESKO OYJ-B SHS	10,400	21.030	218,712.000	
KONE OYJ-B	13,375	47.360	633,440.000	
NESTE OYJ	16,985	45.240	768,401.400	
ORION OYJ-CLASS B	4,000	47.370	189,480.000	
VERBUND AG	2,740	88.300	241,942.000	
OMV AG	5,650	48.380	273,347.000	
ERSTE GROUP BANK AG	13,546	29.270	396,491.420	
VOESTALPINE AG	4,250	25.760	109,480.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,948	35.110	349,274.280	
KINGSPAN GROUP PLC	6,076	58.240	353,866.240	
JERONIMO MARTINS	11,416	20.440	233,343.040	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.432	484,860.800	
GALP ENERGIA SGPS SA	20,196	11.255	227,305.980	
EDP RENOVAVEIS SA	11,594	22.300	258,546.200	

	KERRY GROUP PLC-A	6,272	92.100	577,651.200	
	CRH PLC	30,632	38.020	1,164,628.640	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,704	133.550	895,319.200	
ユーロ　小計				ユーロ 176,300,728.590 (25,530,108,508)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	39.350	2,282,300.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	94,000	45.900	4,314,600.000	
	MTR CORP	66,500	37.450	2,490,425.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	91.250	5,520,625.000	
	SINO LAND CO	142,000	9.980	1,417,160.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	43.550	4,863,184.950	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	21,500	60.750	1,306,125.000	
	CLP HOLDINGS LTD	70,000	57.200	4,004,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	23.100	1,374,611.700	
	HONG KONG & CHINA GAS	482,475	6.590	3,179,510.250	
	HANG SENG BANK LTD	32,900	122.100	4,017,090.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	19.220	1,220,470.000	
	WH GROUP LTD	361,000	4.330	1,563,130.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	51,100	301.000	15,381,100.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	87,000	12.860	1,118,820.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	78,000	13.700	1,068,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	17.560	790,200.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	46.900	4,275,826.100	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	38.750	1,026,875.000	
	AIA GROUP LTD	509,600	76.100	38,780,560.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	15.000	810,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	36.650	2,638,800.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	74,100	22.400	1,659,840.000	
	ESR CAYMAN LTD	86,200	17.080	1,472,296.000	
	SANDS CHINA LTD	104,400	19.620	2,048,328.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	16.400	1,344,800.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	92.600	5,324,500.000	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	159,000	24.000	3,816,000.000	
香港・ドル　小計				香港・ドル 119,109,777.000 (2,138,020,497)	
合計				270,397,636,749 [270,397,636,749]	

(2)　株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,837	987,562.030	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,607	1,604,265.300	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,200	439,518.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	151,002.060	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,500	1,308,060.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,800	931,364.000	
		EQUINIX INC	3,808	2,465,337.280	
		AMERICAN TOWER CORP	18,900	4,081,077.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	532,358.190	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	416,000.000	
		KIMCO REALTY CORP	25,000	553,750.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15,500	301,165.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,000	551,540.000	
		INVITATION HOMES INC	25,200	788,004.000	
		VICI PROPERTIES INC	39,800	1,285,540.000	
		VENTAS INC	16,500	727,155.000	
		WEYERHAEUSER CO	30,814	994,367.780	
		CROWN CASTLE INTL CORP	17,900	2,431,536.000	
		IRON MOUNTAIN INC	11,800	617,140.000	
		SUN COMMUNITIES INC	5,000	715,000.000	
		PROLOGIS INC	38,154	4,370,922.240	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,400	961,088.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,200	482,244.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,700	571,293.000	
		WELLTOWER INC	18,800	1,274,264.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	539,835.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	761,808.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	469,656.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	17,900	356,389.000	

	REALTY INCOME CORP	24,895	1,610,706.500	
	PUBLIC STORAGE	6,500	1,907,815.000	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	413,217.000	
	UDR INC	12,900	518,580.000	
	WP CAREY INC	8,000	637,760.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	1,303,428.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,600	885,584.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	299,354.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 39,245,685.380 (5,508,524,400)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	176,924.610	
	SEGRO PLC	48,274	403,377.540	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	144,057.650	
イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 724,359.800 (120,671,100)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	40,978	308,974.120	
	LENDLEASE GROUP	25,300	197,340.000	
	TRANSURBAN GROUP	119,689	1,666,070.880	
	APA GROUP	45,041	496,351.820	
	SCENTRE GROUP	203,007	580,600.020	
	GPT GROUP	73,031	312,572.680	
	MIRVAC GROUP	144,900	307,188.000	
	STOCKLAND	91,123	334,421.410	
	GOODMAN GROUP	65,537	1,203,259.320	
	VICINITY CENTRES	151,865	290,821.470	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 5,697,599.720 (532,212,790)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	145,146.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	121,974.000	
カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 267,120.000 (27,999,519)	

	シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	144,500	397,375.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	446,742.100	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	140,800	232,320.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	101,300	177,275.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 1,253,712.100 (127,966,394)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	236,900.000	
		GECINA SA	1,817	173,886.900	
		KLEPIERRE	8,527	189,128.860	
		COVIVIO	2,000	114,500.000	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	166,069.440	
	ユーロ　小計			ユーロ 880,485.200 (127,503,062)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	90,800	5,003,080.000	
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	603,480.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	163,000	1,524,050.000	
	香港・ドル　小計			香港・ドル 7,130,610.000 (127,994,450)	
投資証券　合計				6,572,871,715 [6,572,871,715]	
合計				6,572,871,715 [6,572,871,715]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式　598銘柄 投資証券　37銘柄	97.3%	2.7%	73.8%

イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	99.0%	1.0%	4.5%
イスラエル・シュケル	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 10銘柄	91.3%	8.7%	2.2%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資証券 4銘柄	88.6%	11.4%	0.4%
スイス・フラン	株式 41銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	100%	-%	1.1%
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 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 224銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	9.3%
香港・ドル	株式 28銘柄 投資証券 3銘柄	94.4%	5.6%	0.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）

【純資産額計算書】

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	912,231円
Ⅱ	負債総額	72円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	912,159円
Ⅳ	発行済数量	1,039,100口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8778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

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	79,724,988,849円
Ⅱ	負債総額	9,413,351円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	79,715,575,498円
Ⅳ	発行済数量	31,500,797,366口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5306円

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）

純資産額計算書

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	17,692,029円
Ⅱ	負債総額	1,170円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,690,859円
Ⅳ	発行済数量	16,656,044口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0621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

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	299,342,893,917円

Ⅱ　負債総額	**969,629,529円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**298,373,264,388円**
Ⅳ　発行済数量	**69,133,888,947口**
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**4.3159円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2022年11月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

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。

2022年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	81	277,536
追加型株式投資信託	770	21,155,993
株式投資信託　　合計	851	21,433,528
単位型公社債投資信託	79	159,741
追加型公社債投資信託	14	1,428,018
公社債投資信託　合計	93	1,587,759
総合計	944	23,021,287

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。

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63期事業年度（2021年４月１日から2022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64期事業年度に係る中間会計期間（2022年４月１日から2022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 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,860		3,168
有価証券		333		486
前払費用		237		332
未収委託者報酬		13,150		13,811
未収収益		49		52
関係会社短期貸付金		18,700		24,900
その他		207		45
流動資産計		37,539		42,799
固定資産				
有形固定資産	※1	224	※1	203
建物		6		4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

（単位:百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		68		65
未払金		8,405		9,856
未払収益分配金		13		26
未払償還金		39		12
未払手数料		4,734		4,917
その他未払金	※2	3,617	※2	4,900
未払費用		3,777		4,246
未払法人税等		804		980
未払消費税等		631		1,016
賞与引当金		950		866
その他		88		2
流動負債計		14,725		17,033
固定負債				
退職給付引当金		2,452		2,399
役員退職慰労引当金		74		13
その他		3		1
固定負債計		2,530		2,415
負債合計		17,256		19,449
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	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	△109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	－	－	－	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△ 363	△ 363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 10,564
当期純利益	－	－	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

当事業年度（自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	－	－	－	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

	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
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 9,388
当期純利益	－	－	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

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．収益及び費用の計上基準

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

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

５．その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 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、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「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。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年８月12日）を適用する予定であります。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

※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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
未払金	3,473百万円	4,694百万円

３ 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2022年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万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　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。

① 剰余金の配当の総額　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日
⑤ 効力発生日　2021年６月23日

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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
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

（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

2022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。

①	剰余金の配当の総額	12,737百万円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	4,883円
④	基準日	2022年３月31日
⑤	効力発生日	2022年６月24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関係す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

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。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。

前事業年度（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）2019年適用指針第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、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（2022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）	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

（※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486百万円、投資有価証券10,022百万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、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	1,677	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（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。

当事業年度（2022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（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。

当事業年度（2022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	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

（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　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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,574　百万円	2,452　百万円
勤務費用	155	152
退職給付の支払額	△ 378	△ 303
その他	101	98
退職給付債務の期末残高	2,452	2,399

(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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,452百万円	2,399百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399
退職給付引当金	2,452	2,399
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
勤務費用	155　百万円	152　百万円
その他	108	67
確定給付制度に係る退職給付費用	263	219

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	750	734
賞与引当金	243	227

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	△254	△ 356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
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	△453	△ 562
繰延税金負債合計	△612	△ 722
繰延税金資産の純額	973	885

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（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。

当事業年度（2022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。

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が74,402百万円、その他545百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３） 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 ―

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は１年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は１年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（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。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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）	1,900	―	―

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　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。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022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3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

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

(注３) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。

(注４) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）		当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）	
１株当たり純資産額	14,784.79円	１株当たり純資産額	16,078.50円
１株当たり当期純利益	3,599.54円	１株当たり当期純利益	4,883.43円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
当期純利益（百万円）	9,389	12,738
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 （2022年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	※１	196
無形固定資産		
ソフトウエア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2022年９月30日）
負債の部	
流動負債	
未払金	5,646

未払費用		4,193
未払法人税等		1,623
賞与引当金		486
その他	※２	655
流動負債合計		12,605
固定負債		
退職給付引当金		2,344
役員退職慰労引当金		33
その他		1
固定負債合計		2,379
負債合計		14,984
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		6,692
利益剰余金合計		7,067
株主資本合計		33,737
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		394
評価・換算差額等合計		394
純資産合計		34,131
負債・純資産合計		49,116

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	※１	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	※２	579
営業外費用	※３	274
経常利益		8,686
特別利益		―
特別損失	※４	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2022年４月１日 至　2022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	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,737	△12,737	△12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
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	-	-	-	△7,232	△7,232	△7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	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	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△576	△576	△576
当中間期変動額合計	△576	△576	△7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

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エアについては、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。

当社は証券投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当社が日々サービスを提供する時に当該履行義務が充足されるため、証券投資信託の運用期間にわたり収益を認識しております。

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。この変更による当中間財務諸表への影響はありません。

（追加情報）

（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、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(１)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2022年９月30日現在）
有形固定資産	326百万円

※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（2022年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万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　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却損	244百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022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
2022年６月23日定時株主総会	普通株式	12,737	4,883	2022年３月31日	2022年６月24日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2022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。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
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	－	7,364
資産合計	57	7,306	－	7,364

（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

有価証券及び投資有価証券

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。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。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	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022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　1,454百万円）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	57	55	2
（２）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
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	2,692	3,171	△478
小計	2,692	3,171	△478
合計	7,364	6,797	567

（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）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

（３） 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日　至　2022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　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,084.78円
１株当たり中間純利益	2,110.46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おりません。

（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　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
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。

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

・監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2022年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行ないます。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2022年11月10日	半期報告書、有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

2022年５月23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

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2022年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記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

2023年1月13日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）の2022年2月18日から2022年11月21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、ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月13日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）の2022年2月18日から2022年11月21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、ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11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	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2022年４月１日から2023年３月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年４月１日から2022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2022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（2022年４月１日から2022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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。