

## 【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21日提出
【計算期間】	第6計算期間 (自 2021年12月1日 至 2022年11月30日)
【ファンド名】	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)
【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、特定の指数の動きに連動する投資成果をめざすマザーファンドを通じて、特定の有価証券に投資し、各市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

<FWO TOPIXインデックス>

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< FWO 日本債券インデックス >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO J - R E I Tインデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>



## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

< 信託金の限度額 >

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

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

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

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

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

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

※各ファンド (FWO 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)、FWO 外国債券インデックスEM+ (為替ヘッジなし) および FWO 外国REITインデックス (為替ヘッジあり) を除きます。) において、マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態  
で高位に維持することを基本とします。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。



## ●各ファンドの運用方針

## FWO TOPIXインデックス

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

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

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。

TOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行いません。

## FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。

MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。なお、保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行いません。

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

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

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

## FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## FWO 日本債券インデックス

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

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

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

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

## FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

## FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

**FWO J-REITインデックス**

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

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

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

**FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）**

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

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

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

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

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

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

**FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）**

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

## ●特定の指数について

## ◆東証株価指数（TOPIX）

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

## ◆MSCIコクサイ指数

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

## ◆FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社（FTSE International Limited）の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリアーした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標（株主資本、キャッシュフロー、売上、配当）に着目し、リサーチ・アフィリエイツ社（Research Affiliates LLC）独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている確定利付公募債券で、残存額が50億円以上、残存期間が1年以上である国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

## ◆FTSE世界国債インデックス

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

## ◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

## －エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与える制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

## ◆東証REIT指数（配当込み）

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

## ◆S&amp;P先進国REIT指数

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

# 3 毎年11月30日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

（注）第1計算期間は、2017年11月30日（休業日の場合翌営業日）までとします。

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
  - ②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ※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

### ●FWO TOPIXインデックス

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

### ●FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

### ●FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）

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

### ●FWO 日本債券インデックス

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

### ●FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

### ●FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）

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

### ●FWO J-REITインデックス

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

### ●FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

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

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

\*「FWO TOPIXインデックス」を除きます。

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

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

\*「FWO 日本債券インデックス」を除きます。

### FWO J-REITインデックス

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

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

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

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

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

本ファンドは、M S C I Inc. ([M S C I]) によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、M S C I 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>]

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

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

FTSE<sup>®</sup> is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index<sup>®</sup> and RAFI<sup>®</sup> are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

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



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

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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年1月11日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2022年2月22日

< FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） > 商品分類の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約( 1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金( 3)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)( 2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金( 3)	
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
	損益 投資	

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

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1: 受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2: 「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。
- 3: 販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

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

< 委託会社の概況(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
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

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

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

#### 投資態度

##### <FWO TOPIXインデックス>

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

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

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

ロ．マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。

このため、マザーファンドにおいて、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

#### <FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の80%

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の20%

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。

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

#### <FWO J-REITインデックス>

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

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

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

#### <FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

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

#### <FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

## (2)【投資対象】

### <FWO TOPIXインデックス>

### <FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

### <FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

### <FWO 日本債券インデックス>

### <FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

### <FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

### <FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

### <FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

以下同じ。)

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

## 2. 次に掲げる特定資産以外の資産

### イ. 為替手形

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

<FWO T O P I Xインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

#### 1. 株券または新株引受権証券

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

<FWO T O P I Xインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

#### 2. 国債証券

#### 3. 地方債証券

#### 4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

#### 10. コマーシャル・ペーパー



11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

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

#### <FWO J - REITインデックス>

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

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

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

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

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

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

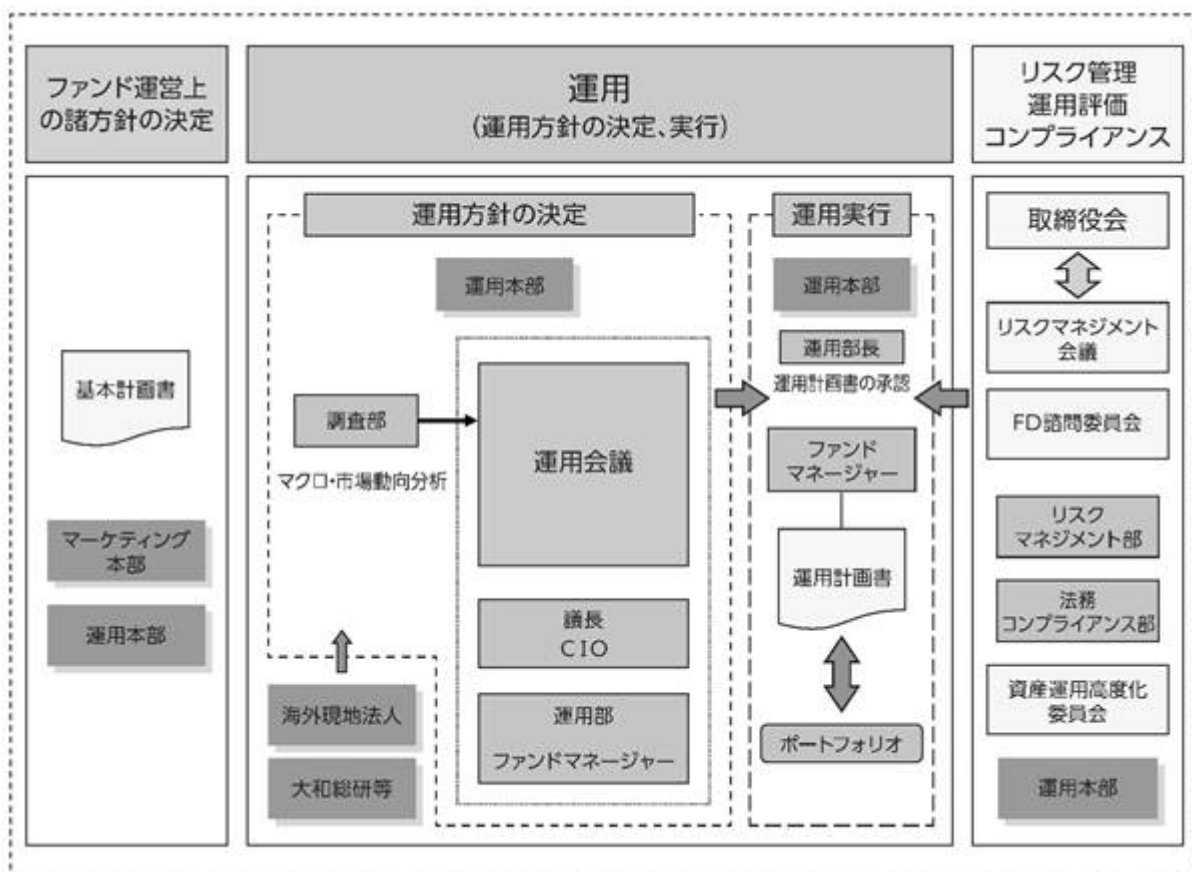
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

＜各ファンド共通＞

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

### イ．基本計画書の策定

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

### ロ．基本的な運用方針の決定

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

### ハ．運用計画書の作成・承認

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

## 職務権限

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

### イ．CIO（Chief Investment Officer）（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。

## 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。

#### 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>

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5)【投資制限】

##### マザーファンドの受益証券（信託約款）

##### <各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

##### 株式（信託約款）

##### <FWO TOPIXインデックス>

##### <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

##### <FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

##### <FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

##### <FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

##### <FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

##### <FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

<FWO 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

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

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

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

<FWO J-REITインデックス>

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

投資信託証券(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

#### <FWO J-REITインデックス>

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

#### <FWO TOPIXインデックス>

#### <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

#### <FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

#### <FWO 日本債券インデックス>

#### <FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

#### <FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

#### <FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

#### <FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

#### <FWO J-REITインデックス>

（規定なし）

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

#### <FWO TOPIXインデックス>

#### <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

#### <FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

#### <FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用取引（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

先物取引等（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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



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

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

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

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

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

#### < FWO J-REITインデックス >

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

#### スワップ取引(信託約款)

#### < FWO TOPIXインデックス >

#### < FWO 日本債券インデックス >

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

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

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

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

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

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

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

<FWO J-REITインデックス>

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価

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

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

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

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

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

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

#### < 上記以外の各ファンド >

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

#### < FWO 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

デリバティブ取引等(信託約款)

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

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

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

<FWO J-REITインデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FWO J-REITインデックス>

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用リスク集中回避(信託約款)

## &lt;各ファンド共通&gt;

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

## 資金の借入れ（信託約款）

## &lt;各ファンド共通&gt;

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。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの概要

## トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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



主な投資制限	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>八．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>二．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 二．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、</p>
--------	---

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

#### 外国株式インデックスマザーファンド

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

#### ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

## 日本債券インデックスマザーファンド

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

## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

## 株式

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

す。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

## スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。  
ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

## 主な投資制限

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

#### 外国債券インデックスマザーファンド

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

#### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

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

## 先進国リート・インデックス( 為替ヘッジあり ) マザーファンド

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



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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。  投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。  同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。  外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。  先物取引  委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
--------	--

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### <FWO TOPIXインデックス>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

#### <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

#### （FWO TOPIXインデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の

要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

#### <FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

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

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、

政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

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

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 日本債券インデックス>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FWO 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

## 外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の と同内容）

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

## &lt;FWO J - R E I Tインデックス&gt;

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

(FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

## ロ．カントリー・リスク

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

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

## (3)その他の留意点

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

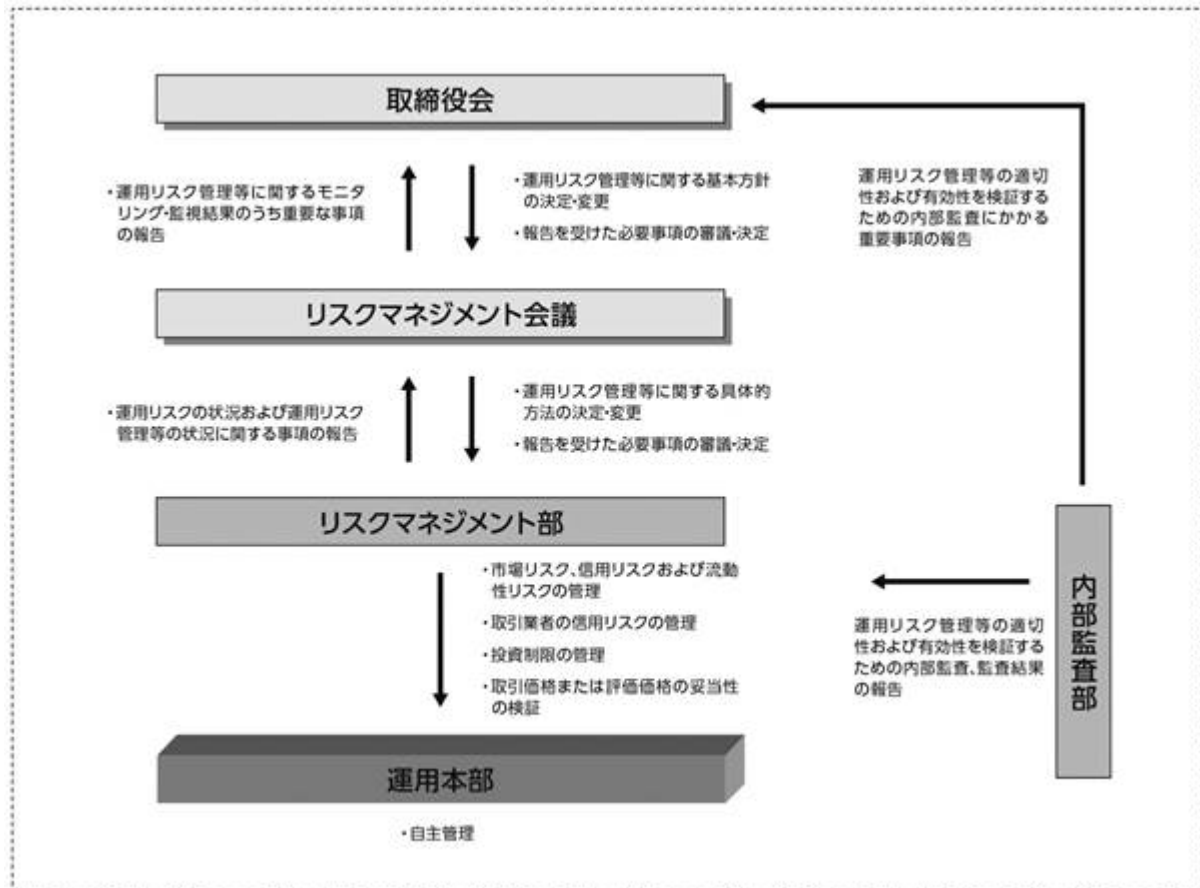
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

### 流動性リスクに関する事項

- 当ファンドは、大量の解約が発生し短時間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

## (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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



## 参考情報

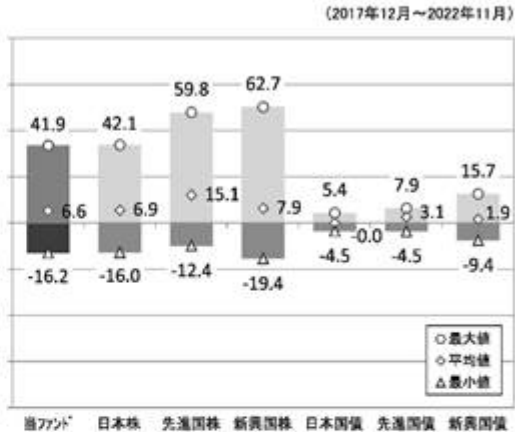
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

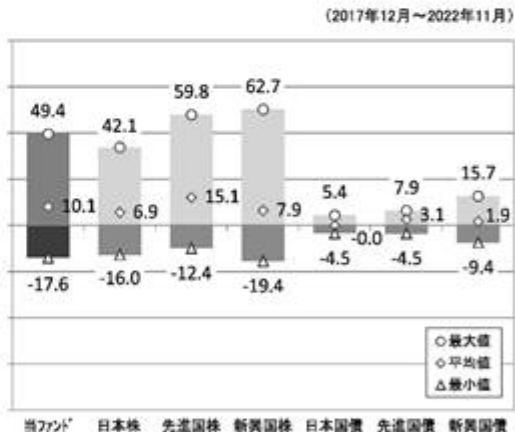
#### [FWO TOPIXインデックス]



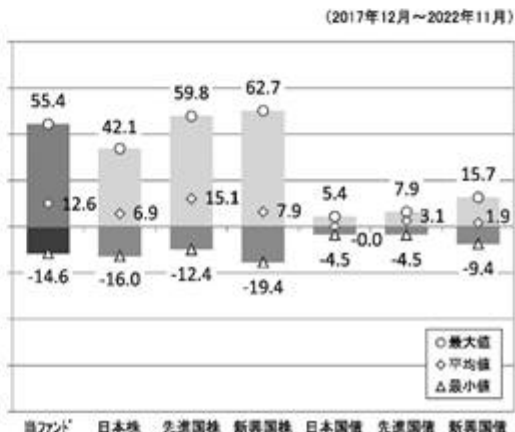
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



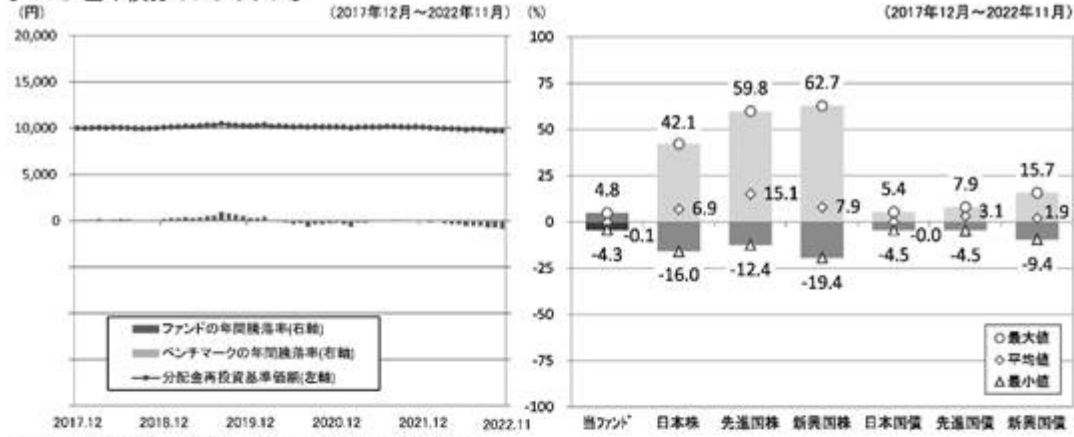
#### [FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



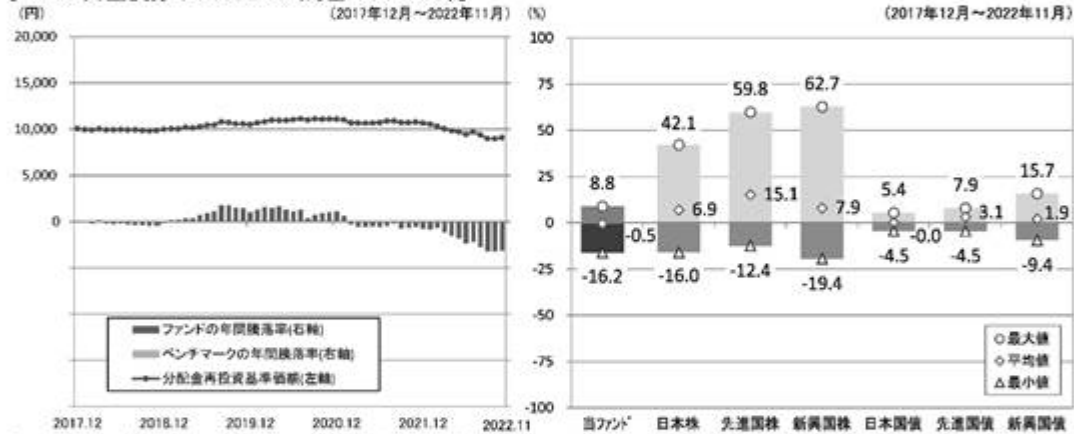
#### [FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



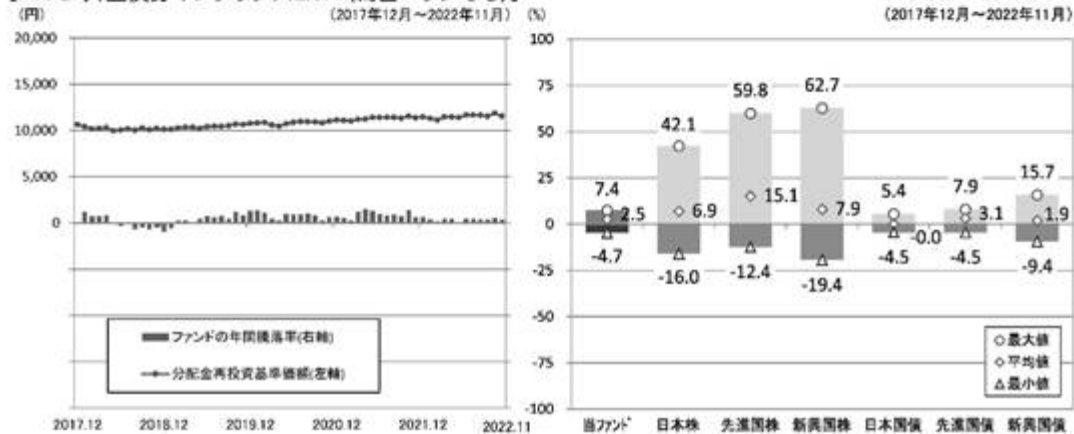
## [FWO 日本債券インデックス]



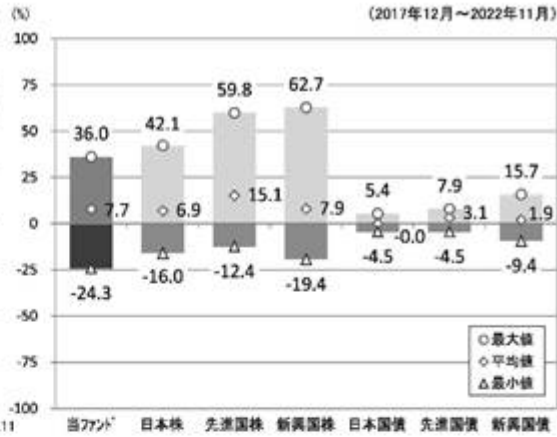
## [FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



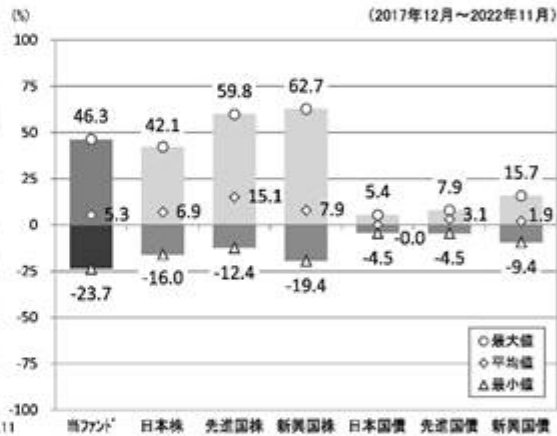
## [FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



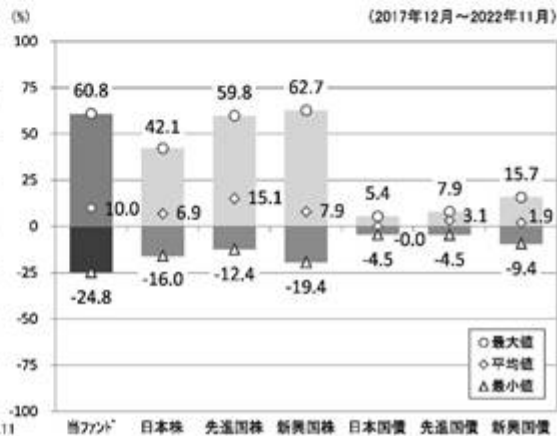
## [FWO J-REITインデックス]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

●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 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」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 J P X が有します。J P X 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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率
-------	-------

FWO TOPIXインデックス	年率0.231% (税抜0.21%)
FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.3355% (税抜0.305%)
FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	年率0.3465% (税抜0.315%)
FWO 日本債券インデックス	年率0.2255% (税抜0.205%) 以内 (* )
FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.264% (税抜0.24%)
FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)	年率0.275% (税抜0.25%)
FWO J-REITインデックス	年率0.231% (税抜0.21%)
FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	年率0.3245% (税抜0.295%)
FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	年率0.3245% (税抜0.295%)

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

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.11%(税抜0.10%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.2255%(税抜0.205%)

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

<FWO TOPIXインデックス>

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FWO 日本債券インデックス>

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.17% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.18% （税抜）	年率0.05% （税抜）	年率0.02% （税抜）

## &lt; FWO J - R E I Tインデックス &gt;

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

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

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

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

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2022年11月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



## 5【運用状況】

## 【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

## (1)【投資状況】（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	4,455,445,104	99.99
内 日本	4,455,445,104	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	312,702	0.01
純資産総額	4,455,757,806	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）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,206,509,611	1.3180 4,226,431,072	1.3895 4,455,445,104	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,308,490,516	1,308,490,516	1.1827	1.1827
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,014,835,042	2,014,835,042	1.1209	1.1209
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,849,716,102	2,849,716,102	1.1793	1.1793
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,646,152,629	2,646,152,629	1.2343	1.2343
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,521,561,254	3,521,561,254	1.3823	1.3823
2021年12月末日	3,695,994,798	-	1.4306	-
2022年1月末日	3,544,688,199	-	1.3617	-
2月末日	3,542,886,043	-	1.3556	-
3月末日	3,719,176,501	-	1.4133	-
4月末日	4,181,083,195	-	1.3793	-
5月末日	4,242,466,041	-	1.3894	-
6月末日	4,194,176,036	-	1.3608	-
7月末日	4,303,815,206	-	1.4112	-
8月末日	4,391,886,834	-	1.4279	-
9月末日	4,157,823,307	-	1.3494	-
10月末日	4,350,577,620	-	1.4177	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	4,455,757,806	4,455,757,806	1.4592	1.4592

## 【分配の推移】

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

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	18.3
第2計算期間	5.2
第3計算期間	5.2
第4計算期間	4.7
第5計算期間	12.0
第6計算期間	5.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,207,147,382	101,755,106
第2計算期間	1,072,657,156	381,496,133
第3計算期間	1,209,913,301	590,980,566
第4計算期間	931,798,024	1,204,458,870
第5計算期間	891,127,877	487,424,798
第6計算期間	939,195,196	433,167,059

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (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	199,365,246,780	97.11
内 日本	199,365,246,780	97.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,925,487,458	2.89
純資産総額	205,290,734,238	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,810,800,000	2.83
内 日本	5,810,800,000	2.83

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

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

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

## (2) 投資資産（2022年11月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,820,100	2,045.84 7,815,317,504	2,010.50 7,680,311,050	3.74
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	492,200	10,331.71 5,085,270,371	11,255.00 5,539,711,000	2.70
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	69,600	51,163.44 3,560,975,492	57,140.00 3,976,944,000	1.94
4	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	894,000	3,920.17 3,504,633,319	3,820.00 3,415,080,000	1.66
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,495,600	732.92 3,294,940,986	755.10 3,394,627,560	1.65
6	第一三共	日本	株式	医薬品	607,900	4,224.99 2,568,373,615	4,518.00 2,746,492,200	1.34
7	任天堂	日本	株式	その他製品	439,200	6,179.50 2,714,037,107	5,894.00 2,588,644,800	1.26
8	日立	日本	株式	電気機器	352,800	6,721.49 2,371,342,713	7,299.00 2,575,087,200	1.25
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	617,500	3,839.93 2,371,160,027	4,050.00 2,500,875,000	1.22
10	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	403,400	5,508.63 2,222,181,990	5,952.00 2,401,036,800	1.17
11	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	501,300	4,349.70 2,180,508,030	4,673.00 2,342,574,900	1.14
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	529,500	4,399.45 2,329,510,950	4,329.00 2,292,205,500	1.12
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	539,100	4,369.69 2,355,704,037	4,111.00 2,216,240,100	1.08
14	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	49,100	40,994.50 2,012,830,090	45,090.00 2,213,919,000	1.08

15	三井物産	日本	株式	卸売業	538,600	3,316.73 1,786,391,553	3,983.00 2,145,243,800	1.04
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	460,200	4,366.11 2,009,284,631	4,605.00 2,119,221,000	1.03
17	HOYA	日本	株式	精密機器	150,300	14,484.34 2,176,996,556	14,060.00 2,113,218,000	1.03
18	信越化学	日本	株式	化学	119,300	15,859.31 1,892,016,470	17,570.00 2,096,101,000	1.02
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	690,300	2,633.22 1,817,714,357	2,827.00 1,951,478,100	0.95
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	453,500	3,801.04 1,723,774,996	4,287.00 1,944,154,500	0.95
21	本田技研	日本	株式	輸送用機器	565,400	3,541.56 2,002,398,024	3,356.00 1,897,482,400	0.92
22	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,900	24,072.20 2,019,658,300	22,405.00 1,879,779,500	0.92
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	992,400	1,664.42 1,651,773,972	1,717.00 1,703,950,800	0.83
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,120,800	1,502.54 1,684,048,730	1,497.50 1,678,398,000	0.82
25	村田製作所	日本	株式	電気機器	210,900	7,386.52 1,557,817,848	7,464.00 1,574,157,600	0.77
26	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	75,700	20,308.56 1,537,358,674	19,720.00 1,492,804,000	0.73
27	日本電産	日本	株式	電気機器	170,600	9,179.11 1,565,957,085	8,534.00 1,455,900,400	0.71
28	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	668,700	1,977.98 1,322,677,890	2,128.00 1,422,993,600	0.69
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	253,600	5,987.08 1,518,324,512	5,579.00 1,414,834,400	0.69
30	SMC	日本	株式	機械	22,800	63,079.48 1,438,212,258	61,760.00 1,408,128,000	0.69

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.11%
合計	97.11%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.09%
鉱業	0.31%
建設業	1.90%
食料品	3.40%
繊維製品	0.44%
パルプ・紙	0.17%
化学	5.99%
医薬品	5.60%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.73%
ガラス・土石製品	0.68%
鉄鋼	0.70%
非鉄金属	0.71%
金属製品	0.55%
機械	5.02%
電気機器	16.92%
輸送用機器	7.52%
精密機器	2.67%
その他製品	2.30%
電気・ガス業	1.16%
陸運業	3.09%
海運業	0.58%
空運業	0.50%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.58%
卸売業	5.78%
小売業	4.35%
銀行業	5.39%
証券、商品先物取引業	0.72%
保険業	2.29%
その他金融業	1.08%
不動産業	2.04%
サービス業	5.24%
合計	97.11%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 041 2月	買建	292	5,578,261,850	5,810,800,000	2.83%

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

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

## (参考情報) 運用実績

## ●FWO TOPIXインデックス

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	14,592円
純資産総額	44億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.9%
3カ月間	2.2%
6カ月間	5.0%
1年間	5.6%
3年間	24.8%
5年間	23.4%
設定来	45.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

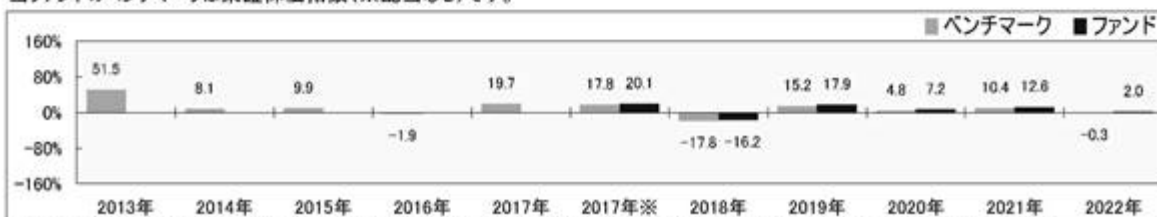
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,152	97.1%	電気機器	16.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
国内株式先物	1	2.8%	情報・通信業	8.6%	TOPIX先物 0412月	-	2.8%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.5%	ソニーグループ	電気機器	2.7%
コール・ローン、その他		2.9%	化学	6.0%	キーエンス	電気機器	1.9%
合計	2,153	-	卸売業	5.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
株式市場・上場別構成			医薬品	5.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.7%
東証プライム市場		96.6%	銀行業	5.4%	第一三共	医薬品	1.3%
東証スタンダード市場		0.5%	サービス業	5.2%	任天堂	その他製品	1.3%
東証グロース市場		-	機械	5.0%	日立	電気機器	1.3%
地方市場・その他		-	その他	31.1%	武田薬品	医薬品	1.2%
合計		97.1%	合計	97.1%	合計	合計	19.6%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(※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。

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】



## (1) 【投資状況】(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	4,518,016,837	99.98
内 日本	4,518,016,837	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	691,768	0.02
純資産総額	4,518,708,605	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)

## 【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	1,785,354,002	2.8767 5,135,935,071	2.5306 4,518,016,837	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,294,661,850	1,294,661,850	1.1363	1.1363
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,198,184,300	2,198,184,300	1.1423	1.1423
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,353,172,110	2,353,172,110	1.3050	1.3050
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,369,427,354	3,369,427,354	1.4661	1.4661
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,374,668,404	3,374,668,404	1.8402	1.8402
2021年12月末日	3,478,174,059	-	1.8911	-
2022年1月末日	3,232,427,537	-	1.7591	-
2月末日	3,224,794,490	-	1.7434	-
3月末日	3,386,126,164	-	1.8221	-
4月末日	4,168,749,514	-	1.6674	-
5月末日	4,241,919,263	-	1.6623	-
6月末日	3,958,410,992	-	1.5236	-
7月末日	4,494,141,533	-	1.6064	-
8月末日	4,442,983,031	-	1.5745	-
9月末日	4,101,395,751	-	1.4353	-
10月末日	4,432,347,810	-	1.5304	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	4,518,708,605	4,518,708,605	1.5660	1.5660

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	13.6
第2計算期間	0.5
第3計算期間	14.2
第4計算期間	12.3
第5計算期間	25.5
第6計算期間	14.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,218,074,496	79,711,026
第2計算期間	1,148,408,392	363,438,941
第3計算期間	570,028,310	691,152,610
第4計算期間	1,186,063,315	691,086,927
第5計算期間	503,558,139	967,841,476
第6計算期間	1,347,521,936	295,924,245

(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)

## 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。

□ . 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。

#### 八．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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI 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



## ●FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

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	15,660円
純資産総額	45億円



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	-14.9%
3年間	19.5%
5年間	37.8%
設定来	56.6%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,215	92.4%	日本円	97.9%	情報技術	18.8%	APPLE INC	アメリカ	4.3%
外国リート	59	2.1%	米ドル	0.6%	金融	13.0%	S&P500 EMINI DEC 22	アメリカ	3.7%
外国投資証券	5	0.1%	ユーロ	0.6%	ヘルスケア	12.9%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.2%
			英ポンド	0.3%	一般消費財・サービス	8.8%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.6%
コール・ローン、その他		10.2%	豪ドル	0.2%	資本財・サービス	8.8%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
合計	1,279	-	カナダドル	0.1%	生活必需品	7.1%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			香港ドル	0.1%	コミュニケーション・サービス	5.7%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
アメリカ		69.1%	スイス・フラン	0.1%	エネルギー	5.4%	TESLA INC	アメリカ	0.9%
イギリス		4.4%	スウェーデン・クローネ	0.1%	素材	4.0%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
その他		21.1%	その他	0.1%	公益事業、他	3.2%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
合計		94.6%	合計	100.0%	合計	87.7%	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。

※先物の残玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは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。

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】（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	3,443,555,449	99.20
内 日本	3,443,555,449	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	27,666,413	0.80
純資産総額	3,471,221,862	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）

## 【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	637,435,268	4.1488 2,644,627,369	4.3159 2,751,106,873	79.25
2	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	351,550,275	1.8805 661,097,188	1.9697 692,448,576	19.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.20%
合計	99.20%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	915,626,043	915,626,043	1.1391	1.1391
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,637,273,973	1,637,273,973	1.1550	1.1550
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,845,455,269	1,845,455,269	1.2622	1.2622
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,513,652,732	2,513,652,732	1.3420	1.3420
第5計算期間末 (2021年11月30日)	2,628,949,371	2,628,949,371	1.7840	1.7840
2021年12月末日	2,743,420,822	-	1.8533	-
2022年1月末日	2,586,031,072	-	1.7592	-
2月末日	2,567,136,686	-	1.7402	-
3月末日	2,818,012,131	-	1.9013	-
4月末日	3,302,239,198	-	1.8255	-
5月末日	3,338,745,290	-	1.8239	-
6月末日	3,321,138,189	-	1.7937	-
7月末日	3,424,920,018	-	1.8375	-
8月末日	3,507,180,896	-	1.8651	-
9月末日	3,334,068,043	-	1.7686	-
10月末日	3,555,922,350	-	1.9073	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	3,471,221,862	3,471,221,862	1.8759	1.8759

【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.9
第2計算期間	1.4
第3計算期間	9.3
第4計算期間	6.3
第5計算期間	32.9
第6計算期間	5.2

## (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	866,066,727	72,233,916
第2計算期間	874,852,673	261,158,636
第3計算期間	481,206,327	436,632,747
第4計算期間	950,256,999	539,288,288
第5計算期間	415,335,713	814,761,474
第6計算期間	645,807,754	269,063,761

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (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 ニューゼaland	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）

### 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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI 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。

### ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況（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		19,364,127,639	82.19
	内 中国	6,818,030,522	28.94
	内 台湾	2,573,616,985	10.92
	内 タイ	883,689,225	3.75
	内 シンガポール	26,161,277	0.11

	内 マレーシア	98,825,330	0.42
	内 インドネシア	342,540,443	1.45
	内 インド	2,565,922,931	10.89
	内 サウジアラビア	565,036,319	2.40
	内 トルコ	780,889,119	3.31
	内 カナダ	25,361,550	0.11
	内 メキシコ	661,604,390	2.81
	内 チリ	148,330,031	0.63
	内 ブラジル	2,972,870,024	12.62
	内 南アフリカ	901,249,493	3.83
投資証券		2,137,550,365	9.07
	内 アメリカ	2,137,550,365	9.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,058,933,254	8.74
純資産総額		23,560,611,258	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,905,301,260	8.09
内 アメリカ	1,905,301,260	8.09
為替予約取引(買建)	1,119,041,403	4.75
内 日本	1,119,041,403	4.75
為替予約取引(売建)	440,539	0.00
内 日本	440,539	0.00

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	871,600	2,512.15 2,189,597,174	2,452.44 2,137,550,365	9.07

2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	357,000	2,006.18 716,210,069	2,186.72 780,661,682	3.31
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	390,400	1,935.60 755,664,483	1,400.17 546,628,320	2.32
4	VALE SA	ブラジル	株式	素材	209,090	1,952.42 408,236,390	2,218.39 463,845,096	1.97
5	CHINA CONSTRUCTION BANK- H	中国	株式	金融	4,838,000	91.67 443,540,962	83.92 406,012,701	1.72
6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	471,500	919.29 433,453,471	840.10 396,109,508	1.68
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネル ギー	82,302	4,159.84 342,363,987	4,637.86 381,705,318	1.62
8	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	71,800	5,998.20 430,671,961	5,081.52 364,853,423	1.55
9	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	5,240,000	75.72 396,871,004	68.98 361,488,736	1.53
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	ブラジル	株式	金融	476,736	608.24 289,983,839	676.23 322,387,336	1.37
11	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネル ギー	433,800	763.88 331,376,038	666.78 289,249,521	1.23
12	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	5,275,000	54.78 289,003,599	49.07 258,859,020	1.10
13	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネル ギー	3,725,800	62.58 233,218,758	63.65 237,156,112	1.01
14	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネル ギー	297,500	827.61 246,222,985	771.86 229,630,856	0.97
15	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	546,359	449.56 245,632,490	407.47 222,628,819	0.94
16	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	41,893	3,856.59 161,564,492	4,557.57 190,930,594	0.81
17	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	4,042,000	51.40 207,780,776	45.69 184,697,573	0.78
18	AMERICA MOVIL SAB DE C- SER L	メキシコ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	1,257,500	142.58 179,297,938	134.62 169,286,924	0.72

19	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	60,275	2,551.97 153,820,117	2,785.67 167,906,591	0.71
20	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,634,000	65.05 171,403,816	61.87 162,977,170	0.69
21	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	340,902	451.86 154,041,295	449.02 153,071,816	0.65
22	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,098,100	134.72 147,938,857	130.67 143,491,472	0.61
23	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	147,600	879.21 129,774,187	926.08 136,690,069	0.58
24	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション・サービス	74,050	2,611.25 193,364,171	1,745.10 129,225,173	0.55
25	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財・サービス	34,195	4,505.43 154,063,529	3,748.02 128,163,681	0.54
26	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	326,000	441.86 144,050,463	379.60 123,750,578	0.53
27	TURK HAVA YOLLARI AO	トルコ	株式	資本財・サービス	135,146	394.29 53,286,828	897.68 121,319,057	0.51
28	CHINA RESOURCES LAND LTD	中国	株式	不動産	182,000	645.32 117,450,084	635.63 115,685,570	0.49
29	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	メキシコ	株式	生活必需品	104,100	1,022.51 106,444,527	1,091.56 113,631,740	0.48
30	CHINA SHENHUA ENERGY CO- H	中国	株式	エネルギー	274,000	401.11 109,907,634	410.71 112,536,732	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	82.19%
投資証券	9.07%
合計	91.26%

(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	10.06%
素材	9.19%

資本財・サービス	2.85%
一般消費財・サービス	7.57%
生活必需品	3.65%
ヘルスケア	0.76%
金融	27.15%
情報技術	9.60%
コミュニケーション・サービス	5.63%
公益事業	3.37%
不動産	2.36%
合計	82.19%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) DEC 22	買建	287	1,970,843,943	1,905,301,260	8.09%
為替予約取引	日本	香港ドル買/円売 2022年 12月	買建	3,000,000	53,334,900	53,331,900	0.23%
		米ドル買/円売 2022年12 月	買建	7,680,168	1,117,089,424	1,065,709,503	4.52%
		メキシコ・ペソ売/円買 2022年12月	売建	61,020	440,698	440,539	0.00%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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	18,759円
純資産総額	34億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.6%
3カ月間	0.6%
6カ月間	2.9%
1年間	5.2%
3年間	48.0%
5年間	64.7%
設定来	87.6%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円						設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月	第6期 22年11月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,620	95.5%	米ドル	61.7%	情報技術	17.2%	S&P500 EMINI DEC 22	アメリカ	4.4%
外国投資証券	6	1.9%	ユーロ	7.6%	金融	15.9%	APPLE INC	アメリカ	3.5%
外国リート	59	1.7%	香港ドル	5.5%	ヘルスケア	10.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.6%
			英ポンド	3.7%	一般消費財・サービス	8.7%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.8%
コール・ローン、その他		9.0%	カナダドル	3.0%	資本財・サービス	7.7%	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) DEC 22	アメリカ	1.6%
合計	1,685	-	ブラジル・リアル	2.6%	生活必需品	6.4%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.3%
国・地域別構成			スイス・フラン	2.4%	エネルギー	6.4%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
アメリカ		61.3%	インド・ルピー	2.3%	コミュニケーション・サービス	5.8%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.8%
中国		5.8%	台湾ドル	2.2%	素材	5.0%	EURO STOXX 50 DEC 22	ドイツ	0.8%
その他		32.0%	その他	9.1%	公益事業、他	3.7%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.8%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計	87.5%	合計		18.5%

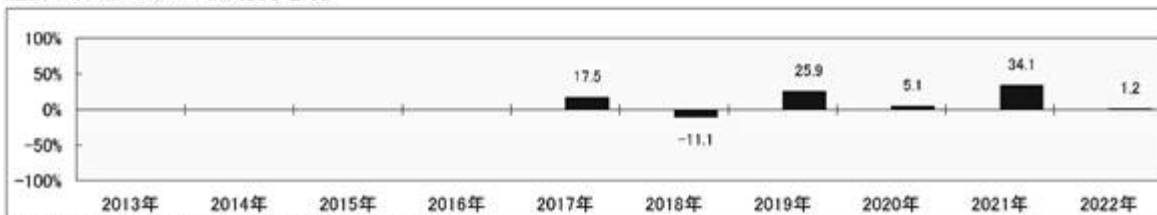
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2017年は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】（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	2,871,296,462	99.90
内 日本	2,871,296,462	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,864,227	0.10
純資産総額	2,874,160,689	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）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,111,247,399	1.4153 2,988,135,775	1.3600 2,871,296,462	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,379,006,108	1,379,006,108	1.0010	1.0010
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,161,576,187	2,161,576,187	1.0025	1.0025
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,135,143,578	2,135,143,578	1.0249	1.0249
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,402,441,089	2,402,441,089	1.0153	1.0153
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,041,324,471	3,041,324,471	1.0151	1.0151
2021年12月末日	3,035,926,927	-	1.0127	-
2022年1月末日	3,028,621,708	-	1.0054	-
2月末日	3,005,613,758	-	1.0003	-
3月末日	2,978,545,909	-	0.9974	-
4月末日	3,031,665,537	-	0.9948	-
5月末日	3,053,225,793	-	0.9932	-
6月末日	3,032,926,819	-	0.9837	-
7月末日	2,978,463,852	-	0.9902	-
8月末日	3,002,854,682	-	0.9879	-
9月末日	2,971,456,385	-	0.9772	-
10月末日	2,888,110,192	-	0.9761	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	2,874,160,689	2,874,160,689	0.9712	0.9712

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】



	収益率(%)
第1計算期間	0.1
第2計算期間	0.1
第3計算期間	2.2
第4計算期間	0.9
第5計算期間	0.0
第6計算期間	4.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,498,842,558	122,203,095
第2計算期間	1,389,815,832	611,289,476
第3計算期間	844,707,447	917,630,059
第4計算期間	862,550,219	579,555,037
第5計算期間	1,226,825,775	597,072,806
第6計算期間	723,779,301	760,465,609

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (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(%)
国債証券	104,845,798,810	92.72
内 日本	104,845,798,810	92.72
地方債証券	2,911,753,400	2.58
内 日本	2,911,753,400	2.58
特殊債券	2,016,980,400	1.78
内 日本	2,016,980,400	1.78
社債券	2,780,464,900	2.46
内 日本	2,780,464,900	2.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	521,740,967	0.46
純資産総額	113,076,738,477	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）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	143 5年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	100.52 2,513,180,000	100.26 2,506,600,000	0.100000 2025/03/20	2.22
2	436 2年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	100.17 2,304,136,000	100.09 2,302,277,000	0.005000 2024/05/01	2.04
3	355 10年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	100.22 1,583,481,500	99.48 1,571,815,600	0.100000 2029/06/20	1.39
4	349 10年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	101.03 1,566,039,000	99.87 1,548,047,000	0.100000 2027/12/20	1.37
5	352 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	100.44 1,506,631,000	99.74 1,496,115,000	0.100000 2028/09/20	1.32
6	145 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	100.75 1,259,473,500	100.30 1,253,850,000	0.100000 2025/09/20	1.11
7	150 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.91 1,248,921,000	99.81 1,247,725,000	0.005000 2026/12/20	1.10
8	141 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	100.60 1,247,517,100	100.24 1,243,013,200	0.100000 2024/09/20	1.10
9	151 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	99.99 1,239,912,800	99.72 1,236,540,400	0.005000 2027/03/20	1.09
10	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.47 1,205,676,000	100.19 1,202,328,000	0.100000 2023/12/20	1.06
11	147 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.45 1,205,440,920	100.00 1,200,000,000	0.005000 2026/03/20	1.06
12	364 10年国債	日本	国債証券	1,210,000,000	99.97 1,209,671,800	98.32 1,189,744,600	0.100000 2031/09/20	1.05
13	144 5年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.69 1,188,249,300	100.29 1,183,457,400	0.100000 2025/06/20	1.05
14	363 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	99.72 1,196,723,300	98.41 1,180,968,000	0.100000 2031/06/20	1.04
15	359 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.53 1,186,274,720	98.88 1,166,878,400	0.100000 2030/06/20	1.03
16	140 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.56 1,126,344,000	100.22 1,122,520,000	0.100000 2024/06/20	0.99
17	365 10年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	99.01 1,118,813,500	98.41 1,112,033,000	0.100000 2031/12/20	0.98

18	347 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.69 1,107,668,000	100.04 1,100,495,000	0.100000 2027/06/20	0.97
19	361 10年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	100.47 1,075,065,960	98.62 1,055,244,700	0.100000 2030/12/20	0.93
20	148 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	100.06 1,050,670,000	99.96 1,049,622,000	0.005000 2026/06/20	0.93
21	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	100.66 1,056,943,500	99.95 1,049,496,000	0.100000 2027/09/20	0.93
22	142 5年国債	日本	国債証券	1,040,000,000	100.63 1,046,611,600	100.25 1,042,662,400	0.100000 2024/12/20	0.92
23	433 2年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.08 1,000,854,000	100.08 1,000,870,000	0.005000 2024/02/01	0.89
24	351 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.22 1,012,242,000	99.77 997,790,000	0.100000 2028/06/20	0.88
25	360 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.81 1,008,169,000	98.73 987,380,000	0.100000 2030/09/20	0.87
26	367 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	99.85 958,592,700	99.67 956,860,800	0.200000 2032/06/20	0.85
27	139 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.52 955,023,000	100.20 951,966,500	0.100000 2024/03/20	0.84
28	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	101.00 959,505,500	100.20 951,919,000	0.100000 2026/12/20	0.84
29	149 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.38 953,628,900	99.90 949,097,500	0.005000 2026/09/20	0.84
30	357 10年国債	日本	国債証券	940,000,000	101.25 951,762,800	99.20 932,489,400	0.100000 2029/12/20	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	92.72%
地方債証券	2.58%
特殊債券	1.78%
社債券	2.46%
合計	99.54%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （参考情報）運用実績

## ●FWO 日本債券インデックス

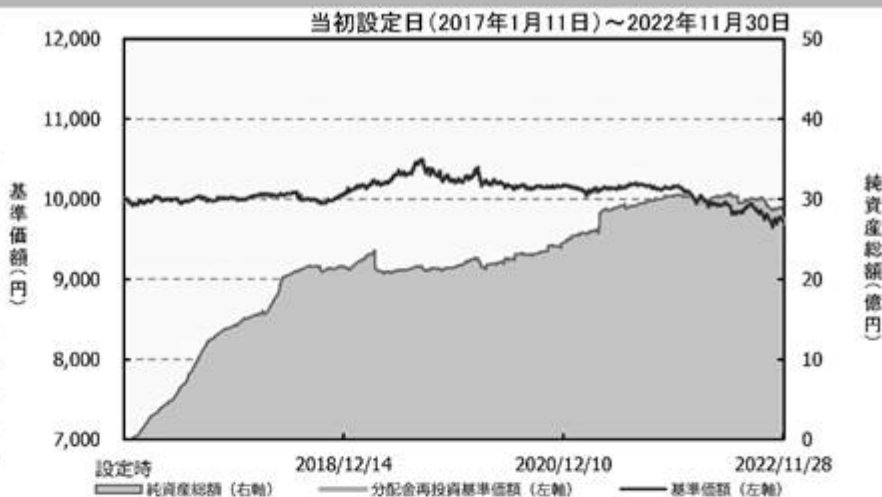
2022年11月30日現在

※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	9,712円
純資産総額	28億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	-1.7%
6カ月間	-2.2%
1年間	-4.3%
3年間	-5.5%
5年間	-3.0%
設定来	-2.9%



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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円						設定来分配金合計額: 0円					
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月	第6期 22年11月						
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円						

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
国内債券	336	99.4%	直接利回り(%)	143 5年国債	0.100	2025/03/20	2.2%
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	436 2年国債	0.005	2024/05/01	2.0%
コール・ローン、その他		0.6%	修正デュレーション	355 10年国債	0.100	2029/06/20	1.4%
合計	336	100.0%	残存年数	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.4%
債券種別構成		比率	格付別構成	352 10年国債	0.100	2028/09/20	1.3%
国債		92.5%	AAA	145 5年国債	0.100	2025/09/20	1.1%
地方債		3.0%	AA	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.1%
事業債		3.0%	A	141 5年国債	0.100	2024/09/20	1.1%
政府保証債		0.7%	BBB	151 5年国債	0.005	2027/03/20	1.1%
その他		0.3%	BB以下・無格付	138 5年国債	0.100	2023/12/20	1.1%
合計		99.4%	合計	合計			13.8%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しております。  
 ※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。  
 ・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。  
 ・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】(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	3,781,856,738	99.80
内 日本	3,781,856,738	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,485,203	0.20
純資産総額	3,789,341,941	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)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	4,269,907,123	1.0346 4,417,926,457	0.8857 3,781,856,738	99.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	2,166,190,168	2,166,190,168	1.0078	1.0078
第2計算期間末 (2018年11月30日)	3,598,169,224	3,598,169,224	0.9860	0.9860
第3計算期間末 (2019年12月2日)	3,539,153,139	3,539,153,139	1.0567	1.0567
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,993,652,896	3,993,652,896	1.1094	1.1094
第5計算期間末 (2021年11月30日)	5,184,444,357	5,184,444,357	1.0770	1.0770
2021年12月末日	5,169,302,945	-	1.0671	-
2022年1月末日	5,139,662,651	-	1.0537	-
2月末日	5,045,993,720	-	1.0314	-
3月末日	4,877,341,816	-	1.0039	-
4月末日	3,910,100,094	-	0.9817	-
5月末日	3,905,038,258	-	0.9717	-
6月末日	3,833,911,343	-	0.9446	-
7月末日	3,943,281,565	-	0.9719	-
8月末日	3,844,711,336	-	0.9382	-
9月末日	3,723,360,002	-	0.8986	-
10月末日	3,724,124,565	-	0.8972	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	3,789,341,941	3,789,341,941	0.9096	0.9096

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	0.8
第2計算期間	2.2
第3計算期間	7.2
第4計算期間	5.0
第5計算期間	2.9
第6計算期間	15.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,296,791,192	148,346,007
第2計算期間	2,190,846,317	691,122,259
第3計算期間	1,134,630,067	1,434,493,694
第4計算期間	1,133,997,978	883,504,385
第5計算期間	1,938,477,119	724,498,228
第6計算期間	881,042,439	1,528,864,291

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## (1) 投資状況（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(%)
国債証券	112,059,642,208	92.35
内 ユーロ	38,476,605,077	31.71
内 中国	3,950,979,746	3.26
内 シンガポール	389,855,206	0.32
内 マレーシア	710,667,276	0.59
内 イスラエル	479,106,049	0.39
内 ノルウェー	278,864,737	0.23
内 スウェーデン	325,791,766	0.27
内 デンマーク	497,054,354	0.41
内 イギリス	5,466,749,194	4.51
内 ポーランド	515,849,296	0.43
内 カナダ	2,193,062,525	1.81
内 アメリカ	55,563,277,080	45.79
内 メキシコ	1,061,728,954	0.87



	内 オーストラリア	1,928,936,461	1.59
	内 ニュージーランド	221,114,487	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,280,843,725	7.65
純資産総額		121,340,485,933	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
債券先物取引(買建)		1,900,130,818	1.57
	内 ドイツ	135,708,227	0.11
	内 アメリカ	1,764,422,591	1.45
為替予約取引(売建)		112,941,783,967	93.08
	内 日本	112,941,783,967	93.08

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	16,580,000	98.31 2,263,598,997	96.88 2,230,673,753	2.500000 2024/05/15	1.84
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,905,000	99.28 2,192,846,600	98.12 2,167,225,363	2.750000 2023/11/15	1.79
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,800,000	97.33 2,135,606,184	95.98 2,106,116,862	2.500000 2025/01/31	1.74
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000,000	98.99 2,062,052,856	97.64 2,034,056,664	2.750000 2024/02/15	1.68
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,300,000	95.96 2,038,872,675	94.82 2,014,735,958	2.125000 2025/05/15	1.66
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,500,000	95.12 2,047,599,744	92.84 1,998,431,648	2.625000 2029/02/15	1.65
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,700,000	97.29 1,986,108,185	95.96 1,958,916,884	2.125000 2024/07/31	1.61

8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,820,000	95.19 1,959,081,611	94.17 1,938,171,789	2.000000 2025/08/15	1.60
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,850,000	93.29 1,923,968,304	92.34 1,904,397,841	2.000000 2026/11/15	1.57
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,000,000	93.53 1,818,410,995	92.58 1,800,019,053	2.250000 2027/08/15	1.48
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,810,000	97.05 1,726,517,578	95.78 1,704,014,180	2.250000 2024/11/15	1.40
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,800,000	95.60 1,699,484,394	94.50 1,679,771,520	2.250000 2025/11/15	1.38
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	93.16 1,552,522,161	92.27 1,537,674,181	1.625000 2026/02/15	1.27
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,750,000	91.67 1,495,946,870	91.01 1,485,112,233	1.500000 2026/08/15	1.22
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,950,000	112.09 1,393,188,764	109.32 1,358,773,237	6.125000 2027/11/15	1.12
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	96.00 1,066,521,600	94.46 1,049,412,816	2.875000 2028/08/15	0.86
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,050,000	94.35 1,054,842,563	93.27 1,042,702,131	2.375000 2027/05/15	0.86
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,670,000	95.55 1,017,830,379	93.01 990,775,972	2.250000 2027/02/15	0.82
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	97.28 986,187,110	95.62 969,358,843	3.125000 2028/11/15	0.80
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	96.07 973,991,685	94.65 959,535,596	2.875000 2028/05/15	0.79
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.57 938,747,313	95.38 927,198,883	1.875000 2024/08/31	0.76
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	93.50 908,972,196	92.56 899,824,829	1.875000 2026/06/30	0.74
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	92.61 882,957,269	91.87 875,912,068	1.625000 2026/05/15	0.72
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	97.51 756,038,868	96.00 744,365,239	0.500000 2025/05/25	0.61
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	79.63 696,685,237	79.30 693,780,633	0.625000 2030/08/15	0.57
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,300,000	98.28 723,418,096	92.98 684,372,468	2.875000 2032/05/15	0.56
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	87.73 670,099,131	87.09 665,218,545	1.250000 2028/03/31	0.55

28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,400,000	88.58 664,297,143	87.87 658,972,867	1.750000 2029/11/15	0.54
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,700,000	82.53 653,313,220	81.65 646,355,417	1.250000 2031/08/15	0.53
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,300,000	85.43 628,825,718	85.09 626,308,560	0.750000 2028/01/31	0.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	92.35%
合計	92.35%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND MAR 23	買建	2	35,447,442	35,177,507	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 23	買建	10	157,535,031	156,901,409	0.13%
		US 5YR NOTE MAR 23	買建	15	225,643,183	225,213,513	0.19%
		US 2YR NOTE MAR 23	買建	40	1,138,751,220	1,138,473,647	0.94%
		US ULTRA T-BOND MAR 23	買建	11	210,690,138	208,656,515	0.17%
	ドイツ	EURO-SCHATZ DEC 22	買建	5	77,711,526	76,739,921	0.06%
		EURO-OAT DEC 22	買建	3	59,473,306	58,968,306	0.05%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル売/円買 2022年12月	売建	22,562,000	2,449,642,075	2,303,354,580	1.90%
		オフショア人民元売/円 買 2022年12月	売建	211,470,000	4,279,772,154	4,104,188,613	3.38%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2022年12月	売建	29,094,000	573,067,290	561,630,576	0.46%

ユーロ売/円買 2022年12月	売建	269,263,000	39,499,063,491	38,649,472,494	31.85%
イスラエル・シケル 売/円買 2022年12月	売建	12,420,000	523,588,698	500,616,666	0.41%
ノルウェー・クローネ 売/円買 2022年12月	売建	20,526,000	292,633,024	285,147,192	0.23%
マレーシア・リングギット 売/円買 2022年12月	売建	23,280,000	721,109,640	714,428,280	0.59%
米ドル売/円買 2022年12月	売建	400,428,000	59,273,186,456	55,562,588,424	45.79%
シンガポール・ドル売/ 円買 2022年12月	売建	4,103,000	429,402,747	414,230,674	0.34%
スウェーデン・クローネ 売/円買 2022年12月	売建	25,378,000	340,765,632	333,365,408	0.27%
ポーランド・ズロチ売/ 円買 2022年12月	売建	20,395,000	630,101,485	624,796,746	0.51%
英ポンド売/円買 2022年 12月	売建	32,924,000	5,618,230,378	5,469,664,120	4.51%
豪ドル売/円買 2022年12 月	売建	21,688,000	2,055,441,161	2,011,301,744	1.66%
ニュージーランド・ドル 売/円買 2022年12月	売建	3,019,000	259,816,649	259,833,254	0.21%
メキシコ・ペソ売/円買 2022年12月	売建	159,187,000	1,180,085,068	1,147,165,196	0.95%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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	9,096円
純資産総額	37億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	-3.0%
6カ月間	-6.4%
1年間	-15.5%
3年間	-14.0%
5年間	-9.7%
設定来	-9.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	562	93.7%	日本円	98.9%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	1.8%
			米ドル	0.7%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	1.8%
コール・ローン、その他		7.8%	ユーロ	0.3%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31	1.7%
合計	562	-	英ポンド	0.1%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	1.7%
債券種別構成			マレーシア・リンギット	0.0%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	1.7%
国債		92.2%	メキシコ・ペソ	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	1.6%
			豪ドル	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.6%
			シンガポール・ドル	0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.6%
			ノルウェー・クローネ	0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.6%
			その他	-0.1%	BB	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.5%
合計		92.2%	合計	100.0%	合計	合計		16.6%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

※先物の連玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】（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	2,428,166,009	99.80
内 日本	2,428,166,009	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,815,308	0.20
純資産総額	2,432,981,317	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）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	612,758,959	3.1388 1,923,378,566	3.1615 1,937,237,448	79.62
2	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	329,482,256	1.3945 459,465,320	1.4900 490,928,561	20.18

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,406,787,686	1,406,787,686	1.0477	1.0477
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,442,336,372	2,442,336,372	1.0222	1.0222
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,833,746,066	2,833,746,066	1.0673	1.0673
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,462,912,432	2,462,912,432	1.1005	1.1005
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,297,505,349	3,297,505,349	1.1365	1.1365
2021年12月末日	3,361,226,425	-	1.1481	-
2022年1月末日	3,328,189,410	-	1.1318	-
2月末日	3,279,604,650	-	1.1133	-
3月末日	3,365,379,395	-	1.1467	-
4月末日	2,503,234,911	-	1.1480	-
5月末日	2,508,469,661	-	1.1412	-
6月末日	2,581,060,890	-	1.1668	-
7月末日	2,440,706,536	-	1.1682	-
8月末日	2,461,387,555	-	1.1651	-
9月末日	2,454,392,229	-	1.1544	-
10月末日	2,493,835,805	-	1.1865	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	2,432,981,317	2,432,981,317	1.1571	1.1571

【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.4
第4計算期間	3.1
第5計算期間	3.3
第6計算期間	1.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,434,988,289	93,204,954
第2計算期間	1,446,419,314	399,973,906
第3計算期間	1,008,953,213	743,168,804
第4計算期間	695,143,661	1,112,174,309
第5計算期間	1,085,864,243	422,369,928
第6計算期間	442,770,444	1,241,538,970

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (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(%)
国債証券	236,705,030,945	98.07
内 ユーロ	81,126,760,924	33.61
内 中国	7,534,316,737	3.12
内 シンガポール	1,047,303,699	0.43
内 マレーシア	1,197,267,343	0.50
内 イスラエル	855,180,021	0.35
内 ノルウェー	485,804,163	0.20
内 スウェーデン	612,648,139	0.25
内 デンマーク	871,107,851	0.36
内 イギリス	11,154,519,094	4.62



内 ポーランド	981,527,558	0.41
内 カナダ	4,759,828,807	1.97
内 アメリカ	120,068,309,446	49.75
内 メキシコ	1,972,998,607	0.82
内 オーストラリア	3,580,216,305	1.48
内 ニュージーランド	457,242,251	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,647,287,639	1.93
純資産総額	241,352,318,584	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,127,572,068	0.88
内 日本	2,127,572,068	0.88

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	92.58 1,337,098,117	85.43 1,233,864,393	1.875000 2032/02/15	0.51
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	96.91 1,439,994,411	82.21 1,221,625,225	1.125000 2031/02/15	0.51
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	100.49 1,297,918,585	92.98 1,200,879,991	2.875000 2032/05/15	0.50
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	97.64 1,396,725,436	81.65 1,167,975,578	1.250000 2031/08/15	0.48
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	94.91 1,291,750,131	80.69 1,098,253,672	0.875000 2030/11/15	0.46
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	98.51 1,231,228,003	82.05 1,025,535,508	1.375000 2031/11/15	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.16 1,222,183,760	84.81 1,024,672,292	1.625000 2031/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	102.16 1,096,553,009	91.87 986,150,673	1.625000 2026/05/15	0.41

9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	98.95 1,030,661,894	92.85 967,149,699	0.375000 2024/09/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.40 962,466,886	91.84 956,567,805	2.750000 2032/08/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	93.01 1,033,315,005	79.30 880,991,280	0.625000 2030/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	109.49 1,018,745,320	94.46 878,883,233	2.875000 2028/08/15	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	106.76 932,980,628	100.09 874,684,231	2.250000 2024/05/25	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	117.32 993,694,882	102.76 870,422,782	2.750000 2027/10/25	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	95.26 926,098,511	89.29 868,037,486	1.125000 2026/10/31	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	109.25 986,150,587	94.65 854,381,010	2.875000 2028/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	108.20 991,725,940	92.84 850,945,089	2.625000 2029/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	108.34 955,395,118	94.24 831,049,045	2.750000 2028/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	105.91 941,329,739	93.27 828,980,576	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.50 938,066,850	85.09 827,199,985	0.750000 2028/01/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	104.36 893,051,870	96.29 823,986,955	2.375000 2024/08/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	97.44 879,556,058	90.33 815,413,394	0.250000 2025/06/30	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	100.21 904,617,864	90.21 814,357,287	1.500000 2027/01/31	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	104.19 856,775,516	95.78 787,624,353	2.250000 2024/11/15	0.33
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	94.75 789,549,756	93.37 777,985,846	2.750000 2029/05/31	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	104.66 848,850,207	94.50 766,395,756	2.250000 2025/11/15	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	104.00 835,987,006	94.82 762,175,929	2.125000 2025/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	105.28 862,667,522	92.58 758,579,458	2.250000 2027/08/15	0.31

29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	103.53 825,755,011	94.92 757,087,642	2.000000 2025/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	93.24 880,499,124	79.72 752,827,601	0.625000 2030/05/15	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.07%
合計	98.07%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2022年12月	買建	959,000	90,011,493	88,942,453	0.04%
		英ポンド買/円売 2022年12月	買建	1,078,000	179,447,652	179,112,796	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2022年12月	買建	4,386,000	32,514,295	31,607,270	0.01%
		ユーロ買/円売 2022年12月	買建	4,108,000	592,268,599	589,735,514	0.24%
		米ドル買/円売 2022年12月	買建	6,729,000	941,267,656	934,036,875	0.39%
		カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	1,656,000	176,541,309	169,074,798	0.07%
		オフショア人民元買/円売 2022年12月	買建	4,379,000	88,623,078	84,987,194	0.04%
		シンガポール・ドル買/円売 2022年12月	買建	496,000	51,909,276	50,075,168	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

### (1) 投資状況 (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(%)
国債証券	27,182,896,727	96.22
内 中国	2,592,278,910	9.18
内 タイ	2,889,474,816	10.23
内 マレーシア	2,758,733,744	9.77
内 フィリピン	22,457,197	0.08
内 インドネシア	2,628,130,211	9.30
内 ポーランド	1,999,375,268	7.08
内 ハンガリー	847,908,429	3.00
内 ルーマニア	936,145,526	3.31
内 トルコ	279,838,190	0.99
内 チェコ	1,546,100,744	5.47
内 メキシコ	2,687,343,896	9.51
内 ドミニカ共和国	26,697,079	0.09
内 コロンビア	1,040,789,550	3.68
内 ペルー	675,922,874	2.39
内 チリ	549,921,635	1.95
内 ブラジル	2,514,753,897	8.90
内 ウルグアイ	30,233,291	0.11
内 エジプト	287,039,948	1.02
内 南アフリカ	2,869,751,522	10.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,067,508,890	3.78
純資産総額	28,250,405,617	100.00

#### その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	104,554,854	0.37
内 日本	104,554,854	0.37

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

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

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

## (2) 投資資産（2022年11月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	28,500,000	82.90 620,768,148	86.83 650,138,886	- 2024/01/01	2.30
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,950,000	106.04 510,125,494	105.98 509,821,765	10.500000 2026/12/21	1.80
3	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	18,000,000	88.09 416,577,260	92.66 438,183,765	- 2023/07/01	1.55
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	53,500,000	87.28 381,058,543	88.82 387,774,420	8.000000 2030/01/31	1.37
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,020,000	77.59 367,379,481	79.13 374,659,276	8.750000 2048/02/28	1.33
6	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	52,400,000	88.94 336,591,237	89.43 338,464,531	5.750000 2026/03/05	1.20
7	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	42,900,000	84.20 294,761,936	85.47 299,199,700	8.250000 2032/03/31	1.06
8	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	12,350,000	90.57 293,886,476	91.23 296,009,490	10.000000 2027/01/01	1.05
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	44,350,000	92.36 295,849,316	91.55 293,254,849	7.750000 2031/05/29	1.04
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	39,000,000	97.28 274,025,494	96.60 272,111,696	8.000000 2024/09/05	0.96
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	41,400,000	79.13 267,333,121	80.10 270,613,915	8.500000 2037/01/31	0.96
12	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	10,890,000	94.22 269,587,241	94.50 270,385,463	10.000000 2025/01/01	0.96
13	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,030,000	93.49 270,291,214	93.43 270,110,489	7.500000 2027/06/03	0.96
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	38,800,000	83.93 265,743,139	84.94 268,926,835	8.875000 2035/02/28	0.95
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	35,230,000	97.20 247,329,622	96.51 245,560,760	8.500000 2029/05/31	0.87

16	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	35,900,000	78.15 228,947,796	79.21 232,055,589	8.750000 2044/01/31	0.82
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,550,000	101.11 223,099,585	99.64 219,850,531	10.000000 2024/12/05	0.78
18	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	10,200,000	78.40 210,115,247	81.77 219,129,872	- 2024/07/01	0.78
19	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	83.99 211,266,561	85.51 215,096,273	2.500000 2026/07/25	0.76
20	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	11,200,000	69.70 205,105,577	72.80 214,228,218	- 2025/07/01	0.76
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,250,000	78.61 199,176,652	78.75 199,531,375	2.750000 2029/10/25	0.71
22	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,100,000	95.13 199,943,544	93.68 196,885,629	8.500000 2038/11/18	0.70
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	29,100,000	81.31 193,084,379	81.83 194,322,117	9.000000 2040/01/31	0.69
24	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	51,000,000	94.08 188,581,969	95.81 192,037,995	2.000000 2031/12/17	0.68
25	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	8,100,000	87.43 186,070,153	88.18 187,664,043	10.000000 2029/01/01	0.66
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,300,000	89.44 189,277,092	88.34 186,951,493	8.000000 2047/11/07	0.66
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,120,000	87.50 184,022,480	86.23 181,357,022	7.750000 2042/11/13	0.64
28	THAILAND GOVERNMENT BOND	タイ	国債証券	48,000,000	93.84 177,038,445	94.87 178,968,427	1.000000 2027/06/17	0.63
29	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,950,000	81.27 173,471,253	82.08 175,204,279	2.750000 2028/04/25	0.62
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,150,000	89.74 169,508,727	90.97 171,831,928	3.250000 2025/07/25	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.22%
合計	96.22%

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	チェコ・コロナ買/円売 2022年12月	買建	2,202,000	13,042,655	12,966,917	0.05%
		メキシコ・ペソ買/円売 2022年12月	買建	3,681,000	26,421,739	26,526,758	0.09%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2022年12月	買建	615,000	18,887,461	18,840,402	0.07%
		ルーマニア・レイ買/円 売 2022年12月	買建	831,000	24,458,559	24,231,627	0.09%
		オフショア人民元買/円 売 2022年12月	買建	1,133,000	22,151,396	21,989,150	0.08%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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	11,571円
純資産総額	24億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.5%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	1.4%
1年間	1.8%
3年間	8.6%
5年間	10.4%
設定来	15.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

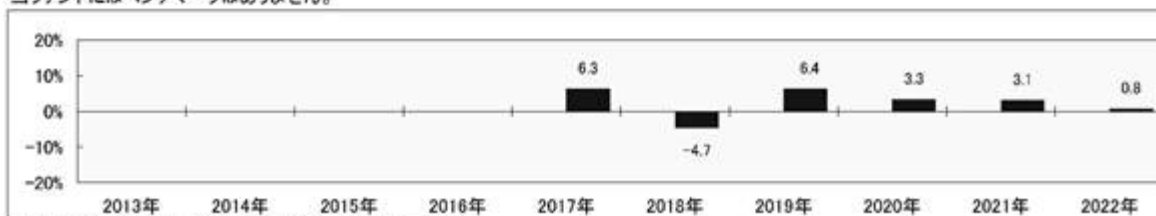
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	1,153	97.5%	米ドル	40.2%	直接利回り(%)	Brazil Letras do Tesouro Nacional	2024/01/01	0.5%
			ユーロ	27.2%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.5%	オフショア人民元	4.5%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
合計	1,153	100.0%	英ポンド	3.8%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.4%
債券種別構成			メキシコ・ペソ	2.7%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
国債		97.5%	マレーシア・リンギット	2.4%	AAA	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.4%
			南アフリカ・ランド	2.1%	AA	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
			タイ・バーツ	2.1%	A	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	1.9%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.3%
			その他	13.1%	BB以下・無格付	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.3%
合計		97.5%	合計	100.0%	合計	合計		3.8%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を0.0%保有しております。

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

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン J - REIT インデックス】



## (1) 【投資状況】（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	1,672,821,341	99.95
内 日本	1,672,821,341	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	837,633	0.05
純資産総額	1,673,658,974	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（2022年11月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	494,464,054	3.3176 1,640,472,604	3.3831 1,672,821,341	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	564,311,815	564,311,815	0.9372	0.9372
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,027,403,305	1,027,403,305	1.0585	1.0585
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,183,900,381	1,183,900,381	1.3333	1.3333
第4計算期間末 (2020年11月30日)	1,177,153,445	1,177,153,445	1.0596	1.0596
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,679,344,805	1,679,344,805	1.2998	1.2998
2021年12月末日	1,765,251,301	-	1.3445	-
2022年1月末日	1,689,704,723	-	1.2706	-
2月末日	1,661,575,272	-	1.2331	-
3月末日	1,787,443,012	-	1.3178	-
4月末日	1,659,094,748	-	1.3020	-
5月末日	1,698,578,320	-	1.3250	-
6月末日	1,687,762,801	-	1.3025	-
7月末日	1,679,769,802	-	1.3432	-
8月末日	1,719,843,811	-	1.3588	-
9月末日	1,654,936,094	-	1.3020	-
10月末日	1,673,974,250	-	1.3237	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	1,673,658,974	1,673,658,974	1.3237	1.3237

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.3
第2計算期間	12.9
第3計算期間	26.0
第4計算期間	20.5
第5計算期間	22.7
第6計算期間	1.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	639,909,329	38,785,261
第2計算期間	587,481,644	218,964,687
第3計算期間	281,360,657	364,052,038
第4計算期間	494,302,320	271,347,931
第5計算期間	469,805,021	288,734,255
第6計算期間	340,231,260	367,796,144

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REITマザーファンド

## (1) 投資状況 (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(%)
投資証券	487,800,240,150	97.79
内 日本	487,800,240,150	97.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,034,717,408	2.21
純資産総額	498,834,957,558	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	11,032,000,000	2.21
内 日本	11,032,000,000	2.21

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年11月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	51,700	671,096.26 34,695,676,712	640,000.00 33,088,000,000	6.63
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	44,318	642,856.76 28,490,126,178	609,000.00 26,989,662,000	5.41
3	野村不動産マスターフ	日本	投資証券	143,315	167,027.13 23,937,494,282	172,500.00 24,721,837,500	4.96
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	223,609	108,777.01 24,323,518,856	110,100.00 24,619,350,900	4.94
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	72,619	332,594.24 24,152,661,241	337,500.00 24,508,912,500	4.91
6	GLP投資法人	日本	投資証券	143,041	163,058.27 23,324,019,189	154,000.00 22,028,314,000	4.42
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	66,803	315,131.43 21,051,725,336	307,500.00 20,541,922,500	4.12
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	88,303	194,430.18 17,168,768,284	193,500.00 17,086,630,500	3.43
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	99,572	151,136.81 15,048,994,454	154,200.00 15,354,002,400	3.08
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	44,312	358,182.01 15,871,761,462	344,000.00 15,243,328,000	3.06
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	30,309	409,463.28 12,410,422,591	393,000.00 11,911,437,000	2.39
12	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	134,416	83,037.57 11,161,579,031	80,500.00 10,820,488,000	2.17
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	142,917	71,729.52 10,251,368,483	74,700.00 10,675,899,900	2.14
14	産業ファンド	日本	投資証券	66,228	176,691.39 11,701,917,999	159,100.00 10,536,874,800	2.11
15	API投資法人	日本	投資証券	23,397	440,660.28 10,310,128,725	427,000.00 9,990,519,000	2.00

16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	15,303	672,989.26 10,298,754,756	627,000.00 9,594,981,000	1.92
17	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	29,883	319,882.59 9,559,051,627	320,500.00 9,577,501,500	1.92
18	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	195,061	45,309.62 8,838,140,796	47,650.00 9,294,656,650	1.86
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	54,253	169,492.78 9,195,492,098	161,300.00 8,751,008,900	1.75
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	17,507	521,188.60 9,124,448,862	499,500.00 8,744,746,500	1.75
21	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	25,787	355,121.15 9,157,509,134	337,500.00 8,703,112,500	1.74
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	16,443	536,576.78 8,822,932,006	529,000.00 8,698,347,000	1.74
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	52,114	157,951.88 8,231,504,736	161,500.00 8,416,411,000	1.69
24	イオンリート投資	日本	投資証券	49,058	157,597.51 7,731,418,922	159,600.00 7,829,656,800	1.57
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	61,412	119,216.84 7,321,344,636	118,000.00 7,246,616,000	1.45
26	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	41,464	170,243.45 7,058,974,417	172,400.00 7,148,393,600	1.43
27	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	15,226	464,268.10 7,068,946,187	440,500.00 6,707,053,000	1.34
28	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	31,785	221,777.02 7,049,182,735	208,900.00 6,639,886,500	1.33
29	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	20,616	334,072.88 6,887,246,686	315,500.00 6,504,348,000	1.30
30	東急リアル・エステート	日本	投資証券	29,714	199,531.57 5,928,881,259	215,600.00 6,406,338,400	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.79%
合計	97.79%

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 041 2月	買建	5,600	11,208,400,000	11,032,000,000	2.21%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●FWO J-REITインデックス

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	13,237円
純資産総額	16億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	-2.6%
6カ月間	-0.1%
1年間	1.8%
3年間	-1.2%
5年間	41.2%
設定来	32.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

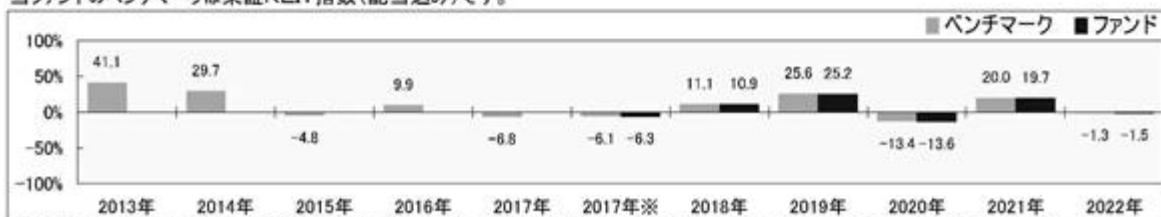
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	97.7%	オフィス不動産	27.0%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.6%
国内リート 先物	1	2.2%	各種不動産	24.9%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	5.4%
			工業用不動産	20.0%	野村不動産マスターF	各種不動産	5.0%
			店舗用不動産	10.1%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産	4.9%
			住宅用不動産	9.7%	日本プロロジスリート	工業用不動産	4.9%
			ホテル・リゾート不動産	5.6%	GLP投資法人	工業用不動産	4.4%
			ヘルスケア不動産	0.4%	大和ハウスリート投資法人	各種不動産	4.1%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産	3.4%
					ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.3%			アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.1%
合計	62	-	合計	97.7%	合計		44.9%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】(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	855,348,711	99.98
内 日本	855,348,711	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	204,942	0.02
純資産総額	855,553,653	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)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	991,363,829	1.0094 1,000,768,008	0.8628 855,348,711	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】



## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	451,251,233	451,251,233	1.0301	1.0301
第2計算期間末 (2018年11月30日)	767,151,864	767,151,864	1.0317	1.0317
第3計算期間末 (2019年12月2日)	839,510,983	839,510,983	1.1735	1.1735
第4計算期間末 (2020年11月30日)	822,409,605	822,409,605	1.0306	1.0306
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,062,472,724	1,062,472,724	1.3476	1.3476
2021年12月末日	1,109,424,223	-	1.4182	-
2022年1月末日	1,023,913,911	-	1.3168	-
2月末日	1,026,580,033	-	1.3124	-
3月末日	1,080,255,223	-	1.3859	-
4月末日	889,138,323	-	1.3471	-
5月末日	836,936,861	-	1.2462	-
6月末日	788,792,324	-	1.1401	-
7月末日	912,630,332	-	1.2161	-
8月末日	874,415,711	-	1.1554	-
9月末日	755,929,913	-	0.9822	-
10月末日	831,063,371	-	1.0414	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	855,553,653	855,553,653	1.0736	1.0736

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	3.0
第2計算期間	0.2
第3計算期間	13.7
第4計算期間	12.2
第5計算期間	30.8
第6計算期間	20.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	464,575,492	36,518,861
第2計算期間	460,818,025	155,301,672
第3計算期間	207,870,721	236,041,881
第4計算期間	336,517,235	253,930,894
第5計算期間	216,237,612	225,812,573
第6計算期間	256,539,172	248,047,491

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## (1) 投資状況（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(%)
投資信託受益証券	102,480,880	0.50
内 アメリカ	102,480,880	0.50
投資証券	19,017,277,784	91.97
内 ガーンジー	47,533,913	0.23
内 韓国	46,978,478	0.23
内 香港	244,963,773	1.18
内 シンガポール	718,799,147	3.48
内 イスラエル	31,974,919	0.15
内 イギリス	871,211,154	4.21
内 アイルランド	7,370,078	0.04
内 オランダ	35,579,621	0.17
内 ベルギー	178,098,223	0.86
内 フランス	306,443,978	1.48
内 ドイツ	8,821,146	0.04

内 スペイン	73,601,721	0.36
内 イタリア	3,132,666	0.02
内 カナダ	368,410,602	1.78
内 アメリカ	14,698,087,455	71.08
内 オーストラリア	1,297,464,919	6.27
内 ニュージーランド	78,805,991	0.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,558,266,584	7.54
純資産総額	20,678,025,248	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	408,018,994	1.97
内 ドイツ	69,665,016	0.34
内 アメリカ	338,353,978	1.64
為替予約取引(売建)	18,777,706,497	90.81
内 日本	18,777,706,497	90.81

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

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

(注3) 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)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	98,267	19,039.49 1,870,967,832	15,804.79 1,553,089,761	7.51
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	9,694	97,842.24 948,482,744	93,176.21 903,250,230	4.37
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	16,816	48,710.73 819,121,682	40,355.62 678,620,140	3.28
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	65,732	10,345.39 680,032,213	8,651.60 568,687,037	2.75
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	34,842	16,088.08 560,541,214	16,311.67 568,331,213	2.75
6	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	102,508	4,914.60 503,786,770	4,675.75 479,302,078	2.32

7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	49,319	11,468.02 565,597,107	9,609.80 473,945,923	2.29
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	30,591	18,250.29 558,294,787	15,102.11 461,988,723	2.23
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	14,883	30,295.87 450,893,570	23,717.60 352,989,149	1.71
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	15,804	23,620.39 373,296,775	21,180.45 334,735,870	1.62
11	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	184,893	1,859.04 343,732,668	1,734.24 320,649,779	1.55
12	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	36,029	11,104.04 400,067,645	8,829.35 318,112,817	1.54
13	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	14,253	29,434.88 419,535,419	21,319.32 303,864,302	1.47
14	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	12,287	26,078.39 320,425,268	22,485.83 276,283,398	1.34
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	61,716	5,497.86 339,306,131	4,432.73 273,570,389	1.32
16	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	42,544	7,285.12 309,938,154	6,304.69 268,227,072	1.30
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	13,126	23,830.36 312,798,552	20,109.76 263,960,771	1.28
18	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	22,091	12,175.70 268,976,009	10,862.41 239,961,530	1.16
19	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	30,939	7,503.14 232,139,837	7,479.53 231,409,432	1.12
20	LINK REIT	香港	投資証券	229,700	1,170.54 268,876,059	935.22 214,821,872	1.04
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	65,829	3,242.61 213,458,070	3,155.12 207,698,816	1.00
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	6,932	41,262.44 286,031,256	29,786.22 206,478,121	1.00
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	57,431	3,939.74 226,263,317	3,560.62 204,490,358	0.99
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	76,090	2,712.13 206,366,055	2,591.31 197,173,097	0.95
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	27,192	7,195.13 195,653,565	7,161.52 194,736,212	0.94
26	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	11,338	20,236.13 229,437,315	16,351.94 185,398,324	0.90

27	UDR INC	アメリカ	投資証券	32,508	6,953.35 226,039,879	5,658.95 183,961,228	0.89
28	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	128,986	1,779.32 229,520,247	1,343.80 173,331,814	0.84
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	18,617	10,670.77 198,657,740	9,086.26 169,158,979	0.82
30	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	564,480	264.35 149,263,538	272.80 153,991,612	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.50%
投資証券	91.97%
合計	92.46%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE DEC 22	買建	72	365,316,421	338,353,978	1.64%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE DEC 22	買建	80	63,091,636	69,665,016	0.34%
為替予約取引	日本	英ポンド売/円買 2022年 12月	売建	5,625,800	957,966,273	934,520,202	4.52%
		香港ドル売/円買 2022年 12月	売建	13,589,700	256,680,896	241,370,738	1.17%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2022年12月	売建	6,396,400	670,040,810	645,680,120	3.12%
		カナダ・ドル売/円買 2022年12月	売建	3,571,300	388,729,493	364,552,232	1.76%

ユーロ売/円買 2022年12月	売建	4,389,100	644,282,492	629,971,912	3.05%
イスラエル・シケル 売/円買 2022年12月	売建	858,100	36,062,888	34,583,917	0.17%
豪ドル売/円買 2022年12月	売建	13,285,800	1,261,413,638	1,231,982,933	5.96%
ニュージーランド・ドル 売/円買 2022年12月	売建	940,400	81,269,838	80,926,404	0.39%
米ドル売/円買 2022年12月	売建	105,335,100	15,608,081,589	14,614,118,039	70.67%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

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	10,736円
純資産総額	8.5億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.1%
3カ月間	-7.1%
6カ月間	-13.9%
1年間	-20.3%
3年間	-8.9%
5年間	4.2%
設定来	7.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

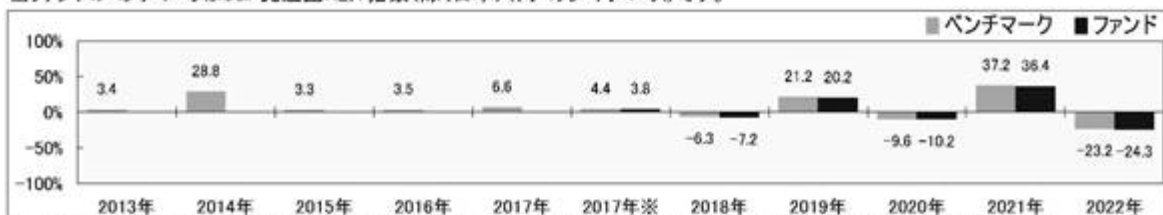
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	321	93.8%	日本円	97.0%	商業施設	17.8%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.5%
外国投資信託等	4	0.6%	米ドル	1.8%	産業施設	15.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		7.6%	豪ドル	0.3%	住宅	13.7%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.3%
合計	325	-	韓国ウォン	0.2%	特殊用途施設	11.8%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.7%
国・地域別構成			ユーロ	0.2%	各種不動産	8.9%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.7%
アメリカ		73.2%	シンガポール・ドル	0.1%	ヘルスケア	8.0%	VICI PROPERTIES INC	特殊用途施設	アメリカ	2.3%
オーストラリア		6.3%	香港ドル	0.1%	オフィス	6.8%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.3%
イギリス		4.2%	カナダ・ドル	0.1%	貸倉庫	6.6%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.2%
シンガポール		3.5%	英ポンド	0.0%	ホテル/リゾート	2.9%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.7%
その他		7.3%	その他	-0.0%			DOW JONES US REAL ESTATE DEC 22	-	アメリカ	1.6%
合計		94.4%	合計	100.0%	合計	91.8%	合計			30.8%

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

※先物の残玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】（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	792,157,613	99.99
内 日本	792,157,613	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	109,636	0.01
純資産総額	792,267,249	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）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザー ファンド	日本	親投資信 託受益証 券	253,344,510	3.1582 800,117,376	3.1268 792,157,613	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。



## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	312,291,612	312,291,612	1.0273	1.0273
第2計算期間末 (2018年11月30日)	561,256,874	561,256,874	1.0501	1.0501
第3計算期間末 (2019年12月2日)	595,752,247	595,752,247	1.1725	1.1725
第4計算期間末 (2020年11月30日)	602,823,641	602,823,641	0.9969	0.9969
第5計算期間末 (2021年11月30日)	912,628,770	912,628,770	1.4202	1.4202
2021年12月末日	963,817,439	-	1.5134	-
2022年1月末日	885,930,493	-	1.4047	-
2月末日	890,846,930	-	1.4042	-
3月末日	997,587,068	-	1.5780	-
4月末日	835,706,136	-	1.6028	-
5月末日	777,292,867	-	1.4809	-
6月末日	775,958,040	-	1.4430	-
7月末日	835,696,536	-	1.5209	-
8月末日	822,619,903	-	1.4870	-
9月末日	737,418,690	-	1.3212	-
10月末日	816,268,842	-	1.4377	-
第6計算期間末 (2022年11月30日)	792,267,249	792,267,249	1.4048	1.4048

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	2.2
第3計算期間	11.7
第4計算期間	15.0
第5計算期間	42.5
第6計算期間	1.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	323,203,250	29,221,075
第2計算期間	333,551,014	103,078,923
第3計算期間	146,810,171	173,148,380
第4計算期間	262,282,042	165,703,268
第5計算期間	194,621,133	156,693,618
第6計算期間	125,371,635	204,019,892

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (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(%)
投資信託受益証券	1,305,824,050	4.61
内 アメリカ	1,305,824,050	4.61
投資証券	26,349,822,171	92.95
内 ガーンジー	58,845,369	0.21
内 韓国	58,963,392	0.21
内 香港	351,685,377	1.24
内 シンガポール	1,019,492,474	3.60
内 イスラエル	38,208,309	0.13
内 イギリス	1,233,653,720	4.35
内 アイルランド	9,087,305	0.03
内 オランダ	44,890,105	0.16
内 ベルギー	234,853,312	0.83
内 フランス	410,651,137	1.45

内 ドイツ	11,609,520	0.04
内 スペイン	98,797,489	0.35
内 イタリア	3,238,756	0.01
内 カナダ	514,718,627	1.82
内 アメリカ	20,277,903,332	71.53
内 オーストラリア	1,873,911,896	6.61
内 ニュージーランド	109,312,051	0.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	692,705,338	2.44
純資産総額	28,348,351,559	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	702,427,932	2.48
内 ドイツ	208,995,048	0.74
内 アメリカ	493,432,884	1.74
為替予約取引(買建)	355,314,846	1.25
内 日本	355,314,846	1.25

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

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

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

## (2) 投資資産 (2022年11月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	135,822	20,199.75 2,743,587,702	15,804.79 2,146,638,826	7.57
2	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	109,200	11,672.02 1,274,598,728	11,958.09 1,305,824,050	4.61
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	13,398	111,670.36 1,496,159,946	93,176.21 1,248,374,931	4.40
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	23,242	45,914.17 1,067,139,526	40,355.62 937,945,367	3.31
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	90,854	9,606.74 872,822,605	8,651.60 786,032,557	2.77
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	48,158	21,539.43 1,037,298,789	16,311.67 785,537,413	2.77

7	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	141,684	3,991.54 565,546,471	4,675.75 662,479,374	2.34
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	68,168	11,320.96 771,729,969	9,609.80 655,081,119	2.31
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	42,282	22,944.24 970,129,810	15,102.11 638,547,521	2.25
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	20,571	32,973.84 678,307,168	23,717.60 487,894,900	1.72
11	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	271,299	2,209.05 599,318,273	1,734.24 470,498,961	1.66
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	21,844	27,675.12 604,537,892	21,180.45 462,665,802	1.63
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	49,799	11,826.03 588,931,008	8,829.35 439,693,030	1.55
14	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	19,700	27,924.81 550,119,724	21,319.32 419,990,651	1.48
15	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	16,983	28,688.18 487,212,330	22,485.83 381,876,858	1.35
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	85,302	5,646.73 481,684,445	4,432.73 378,120,769	1.33
17	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	58,803	6,821.98 401,158,361	6,304.69 370,735,156	1.31
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	18,143	26,600.54 482,613,846	20,109.76 364,851,461	1.29
19	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	30,533	11,039.47 337,070,034	10,862.41 331,662,007	1.17
20	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	42,755	6,543.83 279,785,051	7,479.53 319,787,656	1.13
21	LINK REIT	香港	投資証券	337,000	1,203.68 405,644,283	935.22 315,171,836	1.11
22	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	90,987	3,199.56 291,122,737	3,155.12 287,075,486	1.01
23	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	9,581	47,176.08 451,995,379	29,786.22 285,381,834	1.01
24	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	79,379	4,636.03 368,010,501	3,560.62 282,638,995	1.00
25	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	105,170	2,288.57 240,699,708	2,591.31 272,528,514	0.96
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	37,584	6,392.74 240,268,372	7,161.52 269,158,789	0.95

27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	15,672	22,820.22 357,640,247	16,351.94 256,267,643	0.90
28	UDR INC	アメリカ	投資証券	44,932	7,827.40 351,706,609	5,658.95 254,268,054	0.90
29	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	186,572	2,269.03 423,369,623	1,343.80 250,716,072	0.88
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	25,715	11,613.55 298,645,455	9,086.26 233,653,281	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	4.61%
投資証券	92.95%
合計	97.56%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE DEC 22	買建	105	550,545,255	493,432,884	1.74%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE DEC 22	買建	240	220,138,148	208,995,048	0.74%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	90,000	9,193,563	9,193,347	0.03%
		米ドル買/円売 2022年12 月	買建	1,783,000	264,153,329	247,372,171	0.87%
		ユーロ買/円売 2022年12 月	買建	688,000	100,749,421	98,749,328	0.35%

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

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

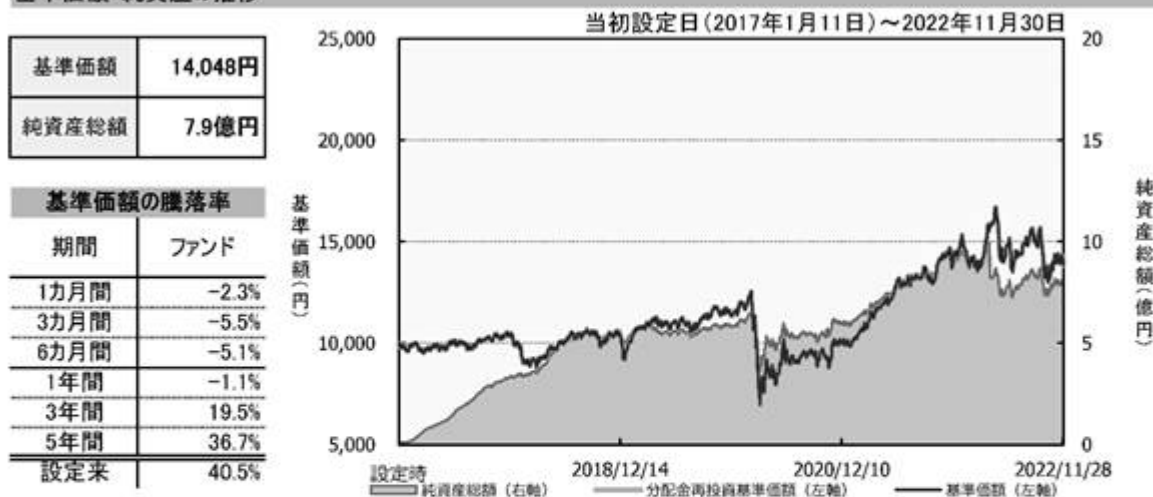
(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報) 運用実績

### ●FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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



#### 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円					

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

#### 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	322	95.3%	米ドル	77.7%	商業施設	18.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.6%
外国投資信託等	4	4.7%	豪ドル	6.8%	産業施設	15.7%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	4.6%
コール・ローン、その他		2.5%	英ポンド	4.6%	住宅	13.8%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
合計	326	-	ユーロ	3.6%	特殊用途施設	11.8%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.3%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.4%	各種不動産	8.9%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.8%
アメリカ		77.9%	カナダ・ドル	1.9%	ヘルスケア	8.1%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.8%
オーストラリア		6.6%	香港ドル	1.4%	オフィス	6.8%	VICI PROPERTIES INC	特殊用途施設	アメリカ	2.3%
イギリス		4.4%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.6%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.3%
シンガポール		3.6%	韓国ウォン	0.2%	ホテル/リゾート	2.9%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.3%
その他		7.6%	その他	0.1%	その他	0.0%	DOW JONES US REAL ESTATE DEC 22	-	アメリカ	1.7%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	92.8%	合計			34.1%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

#### 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2022年は11月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 2【換金（解約）手続等】



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

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

#### <一部解約>

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合せください。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FWO TOPIXインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等\*）があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

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

FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	6営業日目
------------------------------	-------

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

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

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

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

[ 別表 A ]

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

[ 別表 B ]

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

### 3 【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

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

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

\*「FWO J-REITインデックス」は除きます。

### (注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

### (注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

#### (4)【計算期間】

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

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

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合（「FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）」を除きます。）、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資

信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。

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發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を計算期間の末日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。

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

##### < 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

##### < 換金請求権 >

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



### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（2021年12月1日から2022年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,403,000	7,841,491
親投資信託受益証券	3,521,316,023	4,455,445,104
流動資産合計	3,526,719,023	4,463,286,595
資産合計	3,526,719,023	4,463,286,595
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	996,860	2,425,208
未払受託者報酬	387,040	474,724
未払委託者報酬	3,677,201	4,510,253
その他未払費用	96,668	118,604
流動負債合計	5,157,769	7,528,789
負債合計	5,157,769	7,528,789
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,547,528,267	1 3,053,556,404
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	974,032,987	1,402,201,402
（分配準備積立金）	480,976,012	632,685,155
元本等合計	3,521,561,254	4,455,757,806
純資産合計	3,521,561,254	4,455,757,806
負債純資産合計	3,526,719,023	4,463,286,595

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	310,693,220	227,189,081
<b>営業収益合計</b>	<b>310,693,220</b>	<b>227,189,081</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	955	1,223
受託者報酬	701,042	889,453
委託者報酬	6,660,590	8,450,461
その他費用	175,082	222,204
<b>営業費用合計</b>	<b>7,537,669</b>	<b>9,563,341</b>
<b>営業利益</b>	<b>303,155,551</b>	<b>217,625,740</b>
<b>経常利益</b>	<b>303,155,551</b>	<b>217,625,740</b>
<b>当期純利益</b>	<b>303,155,551</b>	<b>217,625,740</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	46,112,865	1,519,344
期首剰余金又は期首欠損金( )	502,327,441	974,032,987
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>336,669,178</b>	<b>375,969,617</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	336,669,178	375,969,617
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>122,006,318</b>	<b>166,946,286</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	122,006,318	166,946,286
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>974,032,987</b>	<b>1,402,201,402</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,143,825,188円	2,547,528,267円
期中追加設定元本額	891,127,877円	939,195,196円
期中一部解約元本額	487,424,798円	433,167,059円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,547,528,267口	3,053,556,404口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(257,042,681円)、投資信託約款に規定される収益調整金(493,057,897円)及び分配準備積立金(223,933,331円)より分配対象額は974,033,909円(1万口当たり3,823.45円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(219,145,464円)、投資信託約款に規定される収益調整金(769,517,437円)及び分配準備積立金(413,539,691円)より分配対象額は1,402,202,592円(1万口当たり4,592.03円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期 2022年11月30日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	289,822,505	229,014,032
合計	289,822,505	229,014,032

## （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5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

## （1口当たり情報）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3823円 (13,823円)	1.4592円 (14,592円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,206,509,611	4,455,445,104	
親投資信託受益証券 合計			4,455,445,104	
合計			4,455,445,104	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,845,838,998	12,597,232,619
株式	177,548,758,040	199,365,246,780
派生商品評価勘定	-	252,089,300

未収入金		-	22,308,117
未収配当金		1,233,193,430	1,574,706,818
未収利息		551,974	656,842
前払金		211,095,600	-
その他未収収益	4	21,961,225	15,277,058
差入委託証拠金		18,795,000	13,280,000
流動資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534
資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		355,476,200	1,899,900
前受金		-	257,225,000
未払解約金		44,822,370	298,031,030
受入担保金		4,816,603,995	7,992,907,366
流動負債合計		5,216,902,565	8,550,063,296
負債合計		5,216,902,565	8,550,063,296
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,094,932,448	147,745,976,638
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		43,568,359,254	57,544,757,600
元本等合計		182,663,291,702	205,290,734,238
純資産合計		182,663,291,702	205,290,734,238
負債純資産合計		187,880,194,267	213,840,797,534

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	142,709,508,970円	139,094,932,448円
期中追加設定元本額	20,968,397,493円	22,455,105,001円
期中一部解約元本額	24,582,974,015円	13,804,060,811円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	2,975,507,036円	2,868,987,712円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	5,686,561,941円	4,779,931,786円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	924,307円	917,791円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	24,862,174円	22,001,280円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	418,851,032円	283,754,331円



ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	21,795,176円	20,586,631円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	711,622,184円	571,049,427円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	242,143,159円	461,873,574円
D-I's TOPIXイン デックス	48,516,772円	29,463,339円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	150,899,876円	216,770,163円
iFree TOPIXイン デックス	4,912,109,453円	6,249,961,543円
iFree 8資産バランス	3,289,496,110円	4,259,741,459円
iFree 年金バランス	524,441,173円	788,377,659円
DCダイワ日本株式インデッ クス	66,361,817,159円	69,173,293,158円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,933,677,304円	3,306,033,755円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,117,458,139円	4,756,270,267円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,042,208,265円	4,672,940,801円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,020,854,667円	6,732,752,455円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	53,651,007円	57,574,140円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	58,568,334円	70,614,624円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,539,852,892円	2,701,356,905円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,210,048円	11,751,428円
ダイワつみたてインデックス バランス50	9,943,370円	10,416,225円
ダイワつみたてインデックス バランス70	19,590,190円	26,427,874円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	721,071円	1,913,542,032円

	ダイワ世界バランスファンド 40VA	108,723,511円	79,912,966円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	125,845,796円	34,293,201円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,927,962,438円	5,068,797,182円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	524,674,963円	454,578,946円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	75,481,125円	62,260,889円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	141,439,467円	104,389,988円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	200,182,570円	200,763,198円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,416,484,453円	11,679,378,364円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,750,254,771円	1,850,371,567円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,681,477,325円	3,206,509,611円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,175,509,780円	1,201,006,985円
	ダイワライフスタイル25	150,358,577円	135,418,737円
	ダイワライフスタイル50	597,518,476円	552,924,023円
	ダイワライフスタイル75	479,645,847円	422,585,053円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	10,563,090,510円	8,706,395,569円
	計	139,094,932,448円	147,745,976,638円
2.	期末日における受益権の総数	139,094,932,448口	147,745,976,638口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 4,435,964,100円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 7,569,896,520円

4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 952,550,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 902,690,000円
5. 4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分21,209,315円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分14,368,166円が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	12,356,661,736	4,104,712,548
合計	12,356,661,736	4,104,712,548

（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9月22日から2021年11月30日まで、及び2022年9月21日から2022年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	5,891,635,600	-	5,536,320,000	355,315,600	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000
合計	5,891,635,600	-	5,536,320,000	355,315,600	5,560,450,000	-	5,810,800,000	250,350,000

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3132円	1.3895円
(1万口当たり純資産額)	(13,132円)	(13,895円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,695.00	14,041,000	
日本水産	97,600	522.00	50,947,200	
マルハニチロ	15,100	2,456.00	37,085,600	
雪国まいたけ	8,300	1,001.00	8,308,300	
カネコ種苗	3,300	1,429.00	4,715,700	
サカタのタネ	12,300	4,690.00	57,687,000	貸付株式数 4,400株
ホクト	8,700	1,890.00	16,443,000	
ホクリヨウ	1,300	680.00	884,000	貸付株式数 400株
ショーボンドHD	13,400	6,060.00	81,204,000	
ミライト・ワン	34,000	1,514.00	51,476,000	
タマホーム	6,900	2,479.00	17,105,100	貸付株式数 2,500株
サンヨーホームズ	1,200	704.00	844,800	貸付株式数 400株
日本アクア	4,100	880.00	3,608,000	貸付株式数 1,500株
ファーストコーポレーション	2,300	715.00	1,644,500	貸付株式数 1,000株
ベステラ	2,100	991.00	2,081,100	貸付株式数 800株
キャンディル	2,100	499.00	1,047,900	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	15,200	254.00	3,860,800	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	3,800	3,145.00	11,951,000	
三井松島HLDGS	4,400	3,225.00	14,190,000	貸付株式数 1,700株
INPEX	360,700	1,533.00	552,953,100	貸付株式数 146,700株
石油資源開発	11,300	4,335.00	48,985,500	
K&Oエナジーグループ	4,400	2,427.00	10,678,800	

ダイセキ環境ソリューション	1,900	825.00	1,567,500	貸付株式数	700株
第一カッター興業	2,500	1,161.00	2,902,500		
明豊ファシリティワークス	3,500	716.00	2,506,000	貸付株式数	1,200株
安藤・間	56,700	874.00	49,555,800		
東急建設	27,900	656.00	18,302,400		
コムシスホールディングス	33,000	2,467.00	81,411,000		
ビーアールホールディングス	16,100	337.00	5,425,700	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクションG P	6,400	1,960.00	12,544,000		
東建コーポレーション	3,100	7,950.00	24,645,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,100	964.00	1,060,400	貸付株式数	400株 (100株)
ヤマウラ	4,700	1,004.00	4,718,800	貸付株式数	700株
オリエンタル白石	34,900	278.00	9,702,200		
大成建設	67,900	4,165.00	282,803,500		
大 林 組	244,000	1,024.00	249,856,000		
清水建設	205,100	738.00	151,363,800		
飛島建設	8,100	1,022.00	8,278,200		
長谷工コーポレーション	70,400	1,517.00	106,796,800		
松井建設	6,400	562.00	3,596,800	貸付株式数	400株
銭 高 組	900	2,686.00	2,417,400	貸付株式数	300株
鹿島建設	151,300	1,550.00	234,515,000		
不動産テトラ	5,100	1,524.00	7,772,400		
大末建設	2,500	1,196.00	2,990,000	貸付株式数	900株
鉄建建設	5,300	1,819.00	9,640,700		
西松建設	11,600	3,915.00	45,414,000	貸付株式数	5,800株
三井住友建設	55,500	422.00	23,421,000	貸付株式数	400株
大豊建設	2,900	4,440.00	12,876,000		
佐田建設	4,600	452.00	2,079,200	貸付株式数	1,300株
ナカノフドー建設	4,800	321.00	1,540,800	貸付株式数	1,500株
奥 村 組	11,100	2,936.00	32,589,600		
東鉄工業	9,500	2,552.00	24,244,000		
イチケン	1,600	1,801.00	2,881,600		
富士ピー・エス	3,500	433.00	1,515,500	貸付株式数	1,300株 (200株)
浅沼組	5,500	2,920.00	16,060,000	貸付株式数	200株
戸田建設	83,900	732.00	61,414,800		
熊 谷 組	11,900	2,539.00	30,214,100		

北野建設	1,300	2,446.00	3,179,800	貸付株式数	100株
植木組	2,100	1,299.00	2,727,900	貸付株式数	700株
矢作建設	9,300	739.00	6,872,700		
ピーエス三菱	9,400	603.00	5,668,200		
日本ハウスHLDGS	13,500	437.00	5,899,500	貸付株式数	100株
大東建託	25,100	15,320.00	384,532,000		
新日本建設	9,500	748.00	7,106,000		
東亜道路	1,400	6,100.00	8,540,000		
日本道路	1,400	6,210.00	8,694,000		
東亜建設	5,900	2,354.00	13,888,600		
日本国土開発	20,600	572.00	11,783,200		
若築建設	3,100	2,733.00	8,472,300		
東洋建設	22,300	837.00	18,665,100		
五洋建設	97,200	647.00	62,888,400	貸付株式数	700株
世紀東急	9,500	798.00	7,581,000		
福田組	2,600	4,865.00	12,649,000	貸付株式数	1,000株
日本ドライケミカル	1,500	1,550.00	2,325,000	貸付株式数	600株
住友林業	52,400	2,371.00	124,240,400		
日本基礎技術	4,400	537.00	2,362,800		
巴コーポレーション	7,900	382.00	3,017,800	貸付株式数	300株
大和ハウス	190,600	3,159.00	602,105,400		
ライト工業	13,200	2,068.00	27,297,600		
積水ハウス	213,700	2,567.00	548,567,900		
日特建設	7,100	911.00	6,468,100		
北陸電気工事	5,100	690.00	3,519,000		
ユアテック	15,900	719.00	11,432,100		
日本リーテック	4,700	734.00	3,449,800		
四電工	3,000	1,774.00	5,322,000		
中電工	11,100	2,085.00	23,143,500		
関電工	38,300	868.00	33,244,400		
きんでん	48,700	1,471.00	71,637,700		
東京エネシス	6,700	941.00	6,304,700		
トーエネック	2,400	3,420.00	8,208,000	貸付株式数	100株
住友電設	6,700	2,540.00	17,018,000		
日本電設工業	11,500	1,695.00	19,492,500		
エクシオグループ	33,600	2,127.00	71,467,200		
新日本空調	3,800	1,918.00	7,288,400	貸付株式数	1,300株
日本工営	5,100	3,525.00	17,977,500		
九電工	16,800	3,290.00	55,272,000		
三機工業	15,500	1,598.00	24,769,000		

日揮ホールディングス	67,400	1,893.00	127,588,200	
中外炉工業	2,100	1,597.00	3,353,700	
ヤマト	5,900	690.00	4,071,000	
太平電業	4,200	3,145.00	13,209,000	
高砂熱学	16,700	1,794.00	29,959,800	
三晃金属	1,000	3,000.00	3,000,000	
NEC ネットエスアイ	23,300	1,642.00	38,258,600	
朝日工業社	2,900	2,132.00	6,182,800	
明星工業	12,300	724.00	8,905,200	
大気社	8,400	3,535.00	29,694,000	
ダイダン	4,800	2,200.00	10,560,000	
日比谷総合設備	6,000	1,895.00	11,370,000	
ニッポン	18,500	1,587.00	29,359,500	
日清製粉G本社	63,300	1,615.00	102,229,500	
日東富士製粉	1,200	4,475.00	5,370,000	
昭和産業	6,000	2,448.00	14,688,000	
鳥越製粉	5,600	620.00	3,472,000	貸付株式数 1,900株
中部飼料	9,500	1,039.00	9,870,500	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	10,100	669.00	6,756,900	
東洋精糖	1,300	898.00	1,167,400	貸付株式数 400株
日本甜菜糖	4,100	1,627.00	6,670,700	
DM三井製糖ホールディ	6,800	1,956.00	13,300,800	貸付株式数 100株
塩水港精糖	8,500	196.00	1,666,000	貸付株式数 2,800株
日新製糖	3,500	1,683.00	5,890,500	
L I F U L L	24,700	249.00	6,150,300	
M I X I	16,300	2,464.00	40,163,200	貸付株式数 100株
ジェイエイシーリクルート メント	6,500	2,587.00	16,815,500	
日本M&Aセンターホール デ	122,600	1,840.00	225,584,000	
メンバーズ	2,100	2,266.00	4,758,600	貸付株式数 800株
中広	1,100	394.00	433,400	貸付株式数 400株
UTグループ	10,500	2,695.00	28,297,500	
アイティメディア	2,700	1,862.00	5,027,400	貸付株式数 1,300株
E・Jホールディングス	4,600	1,305.00	6,003,000	貸付株式数 1,800株
夢真ビーネックスグルー フ	26,100	1,922.00	50,164,200	
コシダカホールディングス	21,400	1,147.00	24,545,800	貸付株式数 8,500株
アルトナー	1,700	1,052.00	1,788,400	
パソナグループ	8,700	2,058.00	17,904,600	
C D S	1,800	1,839.00	3,310,200	



リンクアンドモチベーション	20,600	711.00	14,646,600	貸付株式数	8,200株
エス・エム・エス	27,200	3,610.00	98,192,000		
サニーサイドアップG	2,500	625.00	1,562,500	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	80,100	3,150.00	252,315,000		
リニカル	4,000	728.00	2,912,000	貸付株式数	1,600株
クックパッド	19,600	212.00	4,155,200	貸付株式数	7,300株
エスクリ	2,900	342.00	991,800	貸付株式数	1,300株
アイ・ケイ・ケイホールディング	3,400	635.00	2,159,000	貸付株式数	1,400株
森永製菓	14,100	3,695.00	52,099,500		
中村屋	1,700	3,110.00	5,287,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	19,600	3,585.00	70,266,000		
名糖産業	2,700	1,610.00	4,347,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,231.00	8,477,800		
不二家	4,700	2,633.00	12,375,100	貸付株式数	1,800株
山崎製パン	45,800	1,581.00	72,409,800		
第一屋製パン	1,300	404.00	525,200	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,200	3,590.00	7,898,000		
亀田製菓	4,400	4,355.00	19,162,000	貸付株式数	1,600株
寿スピリッツ	7,300	7,770.00	56,721,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,400	2,904.00	91,185,600		
森永乳業	12,400	4,445.00	55,118,000		
六甲バター	5,000	1,395.00	6,975,000	貸付株式数	1,000株
ヤクルト	49,000	8,750.00	428,750,000		
明治ホールディングス	42,400	6,600.00	279,840,000		
雪印メグミルク	16,600	1,729.00	28,701,400		
プリマハム	9,200	2,041.00	18,777,200		
日本ハム	26,800	3,700.00	99,160,000		
林兼産業	2,200	477.00	1,049,400		
丸大食品	6,900	1,425.00	9,832,500	貸付株式数	2,700株
S Foods	7,600	2,913.00	22,138,800	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,700	2,171.00	5,861,700	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久HLDGS	53,300	684.00	36,457,200		
学情	3,200	1,498.00	4,793,600	貸付株式数	1,100株
スタジオアリス	3,500	2,087.00	7,304,500	貸付株式数	1,400株 (100株)
クロスキャット	4,000	1,599.00	6,396,000	貸付株式数	1,500株
シミックホールディングス	3,900	1,737.00	6,774,300	貸付株式数	1,500株
エプロ	1,400	739.00	1,034,600	貸付株式数	600株

システナ	117,200	420.00	49,224,000	
N J S	1,600	2,070.00	3,312,000	
デジタルアーツ	4,400	6,450.00	28,380,000	
日鉄ソリューションズ	11,900	3,435.00	40,876,500	
総合警備保障	26,500	3,725.00	98,712,500	
キューブシステム	4,100	1,017.00	4,169,700	貸付株式数 1,500株 (200株)
いちご	79,300	309.00	24,503,700	
日本駐車場開発	81,600	246.00	20,073,600	貸付株式数 29,400株
コア	3,000	1,470.00	4,410,000	貸付株式数 600株
カカクコム	53,400	2,428.00	129,655,200	
アイロムグループ	2,600	2,218.00	5,766,800	
セントケア・ホールディング	4,500	854.00	3,843,000	
サイネックス	1,600	557.00	891,200	貸付株式数 400株
ルネサンス	5,000	901.00	4,505,000	貸付株式数 1,900株
ディップ	12,500	4,095.00	51,187,500	貸付株式数 4,000株
S B Sホールディングス	6,200	2,965.00	18,383,000	貸付株式数 2,300株
デジタルホールディングス	5,600	1,187.00	6,647,200	貸付株式数 1,800株
新日本科学	7,600	2,763.00	20,998,800	貸付株式数 3,100株
キャリアデザインセンター	1,500	1,607.00	2,410,500	
ベネフィット・ワン	33,100	2,160.00	71,496,000	貸付株式数 6,100株
エムスリー	141,300	4,205.00	594,166,500	
ツカダ・グローバルHOLD	4,500	395.00	1,777,500	貸付株式数 600株
プラス	1,000	953.00	953,000	貸付株式数 300株
アウトソーシング	42,600	1,008.00	42,940,800	
ウェルネット	6,300	642.00	4,044,600	貸付株式数 2,500株
ワールドホールディングス	3,200	2,905.00	9,296,000	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	30,500	1,850.00	56,425,000	
博報堂D Y H L D G S	91,200	1,331.00	121,387,200	
ぐるなび	13,100	419.00	5,488,900	貸付株式数 100株
タカミヤ	9,700	385.00	3,734,500	
ジャパンベストレスキュー	4,500	872.00	3,924,000	
ファンコミュニケーションズ	14,000	441.00	6,174,000	貸付株式数 1,500株
ライク	2,700	2,082.00	5,621,400	
ビジネス・ブレークスルー	2,500	392.00	980,000	貸付株式数 1,000株
エスプール	20,600	939.00	19,343,400	

WDBホールディングス	3,600	2,377.00	8,557,200	
手間いらず	1,200	5,150.00	6,180,000	
ティア	4,000	423.00	1,692,000	貸付株式数 300株
CDG	700	1,181.00	826,700	貸付株式数 200株
アドウェイズ	9,800	547.00	5,360,600	貸付株式数 4,300株
バリューコマース	5,400	2,091.00	11,291,400	
インフォマート	74,200	454.00	33,686,800	
サッポロホールディングス	22,600	3,590.00	81,134,000	
アサヒグループホールディングン	158,300	4,398.00	696,203,400	貸付株式数 63,600株
麒麟HD	309,200	2,165.00	669,418,000	
宝ホールディングス	46,800	1,068.00	49,982,400	
オエノンホールディングス	20,600	282.00	5,809,200	貸付株式数 5,800株
養命酒	2,300	1,790.00	4,117,000	
コカ・コーラボトラーズJHD	53,700	1,460.00	78,402,000	
サントリー食品インター	48,200	4,665.00	224,853,000	
ダイドーグループHD	3,900	4,850.00	18,915,000	貸付株式数 1,500株
伊藤園	25,500	5,270.00	134,385,000	
キーコーヒー	7,700	2,070.00	15,939,000	
ユニカフェ	2,300	990.00	2,277,000	貸付株式数 800株
ジャパンフーズ	1,000	1,082.00	1,082,000	貸付株式数 300株
日清オイリオグループ	9,700	3,335.00	32,349,500	
不二製油グループ	16,000	2,113.00	33,808,000	貸付株式数 100株
かどや製油	800	3,500.00	2,800,000	貸付株式数 100株
J-オイルミルズ	7,100	1,514.00	10,749,400	
ローソン	18,100	4,925.00	89,142,500	
サンエー	5,400	4,360.00	23,544,000	
カワチ薬品	5,400	2,111.00	11,399,400	貸付株式数 300株
エービーシー・マート	10,700	6,970.00	74,579,000	
ハードオフコーポレーション	3,000	1,424.00	4,272,000	
高千穂交易	2,600	2,190.00	5,694,000	貸付株式数 1,000株
アスクル	17,800	1,581.00	28,141,800	貸付株式数 4,200株
ゲオホールディングス	7,800	1,961.00	15,295,800	
アダストリア	8,900	2,007.00	17,862,300	貸付株式数 3,600株
ジーフット	3,500	294.00	1,029,000	貸付株式数 1,800株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	402.00	402,000	貸付株式数 300株

オルパヘルスケアHLDGS	1,500	1,575.00	2,362,500	貸付株式数	300株
伊藤忠食品	1,700	5,190.00	8,823,000		
くら寿司	8,600	3,350.00	28,810,000	貸付株式数	3,400株
キャンドゥ	2,600	2,153.00	5,597,800	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,400	1,536.00	9,830,400		
アイケイ	2,300	425.00	977,500	貸付株式数	800株
パルグループHLDGS	7,200	2,421.00	17,431,200		
エディオン	29,200	1,254.00	36,616,800	貸付株式数	14,000株 (300株)
あらた	5,600	4,025.00	22,540,000	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	15,500	750.00	11,625,000	貸付株式数	6,200株
ワッツ	3,000	692.00	2,076,000	貸付株式数	1,400株
トーメンデバイス	1,100	5,570.00	6,127,000		
ハローズ	3,200	2,994.00	9,580,800	貸付株式数	1,300株
J Pホールディングス	20,500	278.00	5,699,000	貸付株式数	1,200株
フジオフードG本社	6,200	1,388.00	8,605,600	貸付株式数	2,400株 (100株)
あみやき亭	1,800	2,900.00	5,220,000	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,700	6,870.00	18,549,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,900	186.00	2,957,400	貸付株式数	5,000株
円谷フィールズホールディ	6,300	2,372.00	14,943,600	貸付株式数	2,500株
双日	78,200	2,438.00	190,651,600		
アルフレッサホールディングス	74,000	1,666.00	123,284,000		
大黒天物産	2,600	5,280.00	13,728,000	貸付株式数	400株 (100株)
ハニーズホールディングス	6,500	1,228.00	7,982,000	貸付株式数	2,100株
ファーマライズHD	1,500	676.00	1,014,000	貸付株式数	500株
キッコーマン	45,400	7,720.00	350,488,000		
味の素	167,600	4,335.00	726,546,000		
ブルドックソ - ス	2,700	1,720.00	4,644,000	貸付株式数	1,100株
キューピー	36,800	2,447.00	90,049,600		
ハウス食品G本社	21,000	2,714.00	56,994,000		
カゴメ	31,900	3,050.00	97,295,000	貸付株式数	12,000株
焼津水産化工	3,000	832.00	2,496,000	貸付株式数	1,000株
アリアケジャパン	6,000	4,605.00	27,630,000		
ピエトロ	1,000	1,807.00	1,807,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,800	3,195.00	5,751,000	貸付株式数	500株
やまみ	600	1,303.00	781,800		

ニチレイ	31,400	2,781.00	87,323,400		
横浜冷凍	20,100	995.00	19,999,500	貸付株式数	200株
東洋水産	34,600	5,770.00	199,642,000		
イトアンドHLDGS	2,900	2,232.00	6,472,800	貸付株式数	1,100株
大冷	900	1,899.00	1,709,100	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,400	529.00	2,327,600	貸付株式数	1,600株
日清食品HD	24,400	10,480.00	255,712,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,003.00	6,810,200		
一正蒲鉾	2,800	742.00	2,077,600	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,000	1,895.00	13,265,000		
ロックフィールド	8,300	1,476.00	12,250,800	貸付株式数	3,200株
日本たばこ産業	450,900	2,815.50	1,269,508,950	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	4,700	1,651.00	7,759,700	貸付株式数	1,600株
わらべや日洋HD	5,000	1,848.00	9,240,000		
なとり	4,300	2,060.00	8,858,000	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,200	960.00	1,152,000	貸付株式数	300株
ファーマフーズ	10,600	1,285.00	13,621,000	貸付株式数	4,200株
北の達人コーポ	29,400	302.00	8,878,800	貸付株式数	11,700株 (2,600株)
ユーグレナ	44,100	901.00	39,734,100	貸付株式数	17,000株
紀文食品	5,400	943.00	5,092,200	貸付株式数	2,300株
ピクルスホールディングス	4,000	1,083.00	4,332,000		
スター・マイカ・HLDGS	6,200	716.00	4,439,200		
SREホールディングス	3,400	4,575.00	15,555,000	貸付株式数	1,300株
ADワークスグループ	17,200	156.00	2,683,200	貸付株式数	6,500株 (1,000株)
片倉工業	6,500	1,975.00	12,837,500	貸付株式数	2,100株
ゲンゼ	5,400	3,980.00	21,492,000	貸付株式数	600株
ヒューリック	159,600	1,153.00	184,018,800		
神栄	1,100	801.00	881,100		
ラサ商事	3,100	1,009.00	3,127,900	貸付株式数	100株
アルペン	6,100	2,030.00	12,383,000	貸付株式数	2,400株
ハブ	2,500	668.00	1,670,000	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,900	1,260.00	8,694,000	貸付株式数	1,900株
クオールホールディングス	10,100	1,140.00	11,514,000	貸付株式数	4,000株
アルコニックス	9,600	1,315.00	12,624,000		
神戸物産	56,900	3,575.00	203,417,500	貸付株式数	22,700株

ソリトンシステムズ	3,600	1,165.00	4,194,000	貸付株式数	1,400株
ジンズホールディングス	4,400	4,325.00	19,030,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	49,000	1,265.00	61,985,000	貸付株式数	11,000株
D C Mホールディングス	45,000	1,148.00	51,660,000		
ペッパーフードサービス	15,500	212.00	3,286,000	貸付株式数	6,100株
ハイパー	1,400	490.00	686,000	貸付株式数	500株
M o n o t a R O	104,300	2,336.00	243,644,800		
東京一番フーズ	2,000	581.00	1,162,000	貸付株式数	600株
D Dホールディングス	4,900	684.00	3,351,600	貸付株式数	1,300株
あい ホールディングス	11,800	2,220.00	26,196,000		
ディーブイエックス	2,500	1,021.00	2,552,500	貸付株式数	1,000株
きちりホールディングス	2,100	568.00	1,192,800	貸付株式数	700株
アークランドサービスHD	6,000	2,222.00	13,332,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
J . フロント リテイリ ング	91,200	1,159.00	105,700,800		
ドトール・日レスHD	13,100	1,691.00	22,152,100		
マツキヨココカラ&カンパ ニー	44,600	5,720.00	255,112,000		
ブロンコビリー	3,900	2,500.00	9,750,000	貸付株式数	1,500株
Z O Z O	48,600	3,425.00	166,455,000		
トレジャー・ファクトリー	2,200	2,396.00	5,271,200	貸付株式数	800株
物語コーポレーション	4,100	7,020.00	28,782,000	貸付株式数	1,600株
三越伊勢丹HD	123,600	1,324.00	163,646,400		
東洋紡	31,100	1,035.00	32,188,500		
ユニチカ	21,800	268.00	5,842,400		
富士紡ホールディングス	2,700	3,385.00	9,139,500		
日清紡ホールディングス	56,900	1,014.00	57,696,600		
倉敷紡績	5,200	2,179.00	11,330,800		
ダイワボウHD	30,000	2,176.00	65,280,000		
シキボウ	3,700	878.00	3,248,600		
日東紡績	8,200	2,184.00	17,908,800		
トヨタ紡織	29,200	1,911.00	55,801,200		
マクニカホールディングス	17,900	3,445.00	61,665,500		
H a m e e	2,900	881.00	2,554,900	貸付株式数	1,100株
マーケットエンタープライ ズ	800	1,006.00	804,800	貸付株式数	300株
ラクト・ジャパン	2,900	2,121.00	6,150,900	貸付株式数	1,000株 (400株)
ウエルシアHD	38,000	3,020.00	114,760,000		

クリエイトSDH	11,900	3,065.00	36,473,500	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,100	1,815.00	5,626,500	貸付株式数	1,300株 (100株)
バイタルKSKHD	11,000	826.00	9,086,000		
八洲電機	5,700	1,015.00	5,785,500	貸付株式数	2,200株 (400株)
メディアスホールディングス	5,100	765.00	3,901,500	貸付株式数	1,800株
レスターホールディングス	7,000	2,219.00	15,533,000		
ジュテックHD	1,800	1,153.00	2,075,400		
丸善CHI HD	9,100	330.00	3,003,000	貸付株式数	3,200株
大光	3,300	676.00	2,230,800	貸付株式数	1,200株 (100株)
OCHIホールディングス	1,700	1,251.00	2,126,700	貸付株式数	700株
TOKAIホールディングス	36,100	876.00	31,623,600		
黒谷	2,000	587.00	1,174,000	貸付株式数	800株
ミサワ	1,200	618.00	741,600	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,329.00	1,329,000	貸付株式数	400株
Cominix	700	739.00	517,300	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	451.00	766,700	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,500	1,139.00	8,542,500		
チムニー	2,300	1,127.00	2,592,100	貸付株式数	900株
シュッピン	5,500	1,470.00	8,085,000	貸付株式数	2,400株
ビューティガレージ	1,300	3,015.00	3,919,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,900	1,927.00	19,077,300	貸付株式数	4,100株
ウイン・パートナーズ	6,000	992.00	5,952,000	貸付株式数	2,000株
ネクステージ	16,800	3,085.00	51,828,000	貸付株式数	6,200株
ジョイフル本田	23,700	1,849.00	43,821,300	貸付株式数	7,500株
鳥貴族ホールディングス	2,700	2,445.00	6,601,500	貸付株式数	900株
ホットランド	5,600	1,527.00	8,551,200	貸付株式数	2,200株 (2,000株)
すかいらくHD	100,600	1,596.00	160,557,600	貸付株式数	40,200株
SFPホールディングス	4,000	1,711.00	6,844,000	貸付株式数	1,500株 (100株)
綿半ホールディングス	5,800	1,357.00	7,870,600	貸付株式数	1,600株
日本毛織	20,000	1,008.00	20,160,000	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	10,700	86.00	920,200	貸付株式数	5,500株
トーア紡コーポレーション	2,600	354.00	920,400	貸付株式数	900株

ダイドーリミテッド	10,100	247.00	2,494,700	貸付株式数 4,600株 (1,000株)
ヨシックスホールディングス	1,500	2,113.00	3,169,500	貸付株式数 600株
ユナイテッド・スーパーマーケ	23,300	1,101.00	25,653,300	貸付株式数 9,300株
三栄建築設計	3,300	1,538.00	5,075,400	
野村不動産HLDGS	42,800	3,320.00	142,096,000	
三重交通グループHD	14,700	492.00	7,232,400	貸付株式数 1,800株
サムティ	10,400	2,274.00	23,649,600	貸付株式数 4,100株
地主	5,200	2,036.00	10,587,200	貸付株式数 2,000株
プレサンスコーポレーション	9,000	1,589.00	14,301,000	貸付株式数 900株
フィル・カンパニー	1,200	1,068.00	1,281,600	
ハウスコム	1,000	1,092.00	1,092,000	貸付株式数 400株
JPMC	3,300	1,046.00	3,451,800	
サンセイランディック	1,800	856.00	1,540,800	貸付株式数 400株
エストラスト	900	606.00	545,400	貸付株式数 200株
フージャースHD	10,500	797.00	8,368,500	貸付株式数 100株
オープンハウスグループ	25,000	5,780.00	144,500,000	
東急不動産HD	205,900	742.00	152,777,800	
飯田GHD	60,000	2,193.00	131,580,000	
イーグランド	1,000	1,585.00	1,585,000	貸付株式数 400株
帝国繊維	7,800	1,663.00	12,971,400	貸付株式数 2,900株
日本コークス工業	62,700	88.00	5,517,600	貸付株式数 8,100株
ゴルフダイジェスト・オン	3,300	1,741.00	5,745,300	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	1,900	1,108.00	2,105,200	貸付株式数 100株
B E E N O S	4,200	3,180.00	13,356,000	貸付株式数 1,400株
あさひ	6,200	1,332.00	8,258,400	貸付株式数 2,100株
日本調剤	5,000	1,198.00	5,990,000	貸付株式数 2,000株
コスモス薬品	8,300	13,960.00	115,868,000	貸付株式数 3,300株
シップヘルスケアHD	26,600	2,773.00	73,761,800	貸付株式数 9,000株
トーエル	3,200	731.00	2,339,200	貸付株式数 1,300株
ソフトクリエイイトHD	2,900	3,520.00	10,208,000	
セブン&アイ・HLDGS	253,600	5,579.00	1,414,834,400	
クリエイイト・レストランツ・ホール	55,400	939.00	52,020,600	貸付株式数 20,100株
明治電機工業	2,400	1,040.00	2,496,000	貸付株式数 600株
ツルハホールディングス	18,000	8,870.00	159,660,000	貸付株式数 7,200株
デリカフーズHLDGS	3,000	487.00	1,461,000	貸付株式数 1,100株



スターティアホールディングス	1,400	1,153.00	1,614,200	貸付株式数	600株
サンマルクホールディングス	6,000	1,690.00	10,140,000		
フェリシモ	1,700	1,027.00	1,745,900	貸付株式数	200株
トリドールホールディングス	18,300	2,692.00	49,263,600	貸付株式数	6,600株
帝人	66,900	1,328.00	88,843,200		
東レ	467,300	738.60	345,147,780		
クラレ	111,500	1,096.00	122,204,000		
旭化成	435,600	1,019.00	443,876,400		
TOKYO BASE	7,600	300.00	2,280,000	貸付株式数	3,000株
稲葉製作所	4,100	1,387.00	5,686,700	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,405.00	7,150,500		
トーカロ	19,200	1,242.00	23,846,400		
アルファCO	2,600	957.00	2,488,200	貸付株式数	800株
SUMCO	136,600	2,023.00	276,341,800	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,800	3,370.00	6,066,000		
RS TECHNOLOGIES	2,300	8,200.00	18,860,000	貸付株式数	900株
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,940.00	1,940,000	貸付株式数	300株
信和	3,800	789.00	2,998,200		
ビーロット	4,700	575.00	2,702,500	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,500	857.00	1,285,500	貸付株式数	500株
AND DOホールディングス	4,000	853.00	3,412,000	貸付株式数	1,600株
シーアールイー	3,100	1,491.00	4,622,100	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェント	800	1,298.00	1,038,400	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	3,300	4,930.00	16,269,000	貸付株式数	1,300株
アグレ都市デザイン	1,200	1,550.00	1,860,000	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,700	4,365.00	7,420,500		
ロードスターキャピタル	2,900	1,740.00	5,046,000	貸付株式数	1,100株
テンポイノベーション	2,000	994.00	1,988,000	貸付株式数	800株
グローバルリンクマネジメント	1,300	1,254.00	1,630,200	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	900	1,376.00	1,238,400	貸付株式数	300株
住江織物	1,200	1,761.00	2,113,200		
日本フエルト	3,700	413.00	1,528,100	貸付株式数	1,700株
イチカワ	700	1,312.00	918,400	貸付株式数	100株

エコナックホールディングス	11,900	94.00	1,118,600	貸付株式数	4,700株
日東製網	700	1,383.00	968,100	貸付株式数	100株
芦森工業	1,400	1,284.00	1,797,600		
アツギ	3,800	380.00	1,444,000	貸付株式数	200株
ウイルプラスHLDGS	1,300	1,191.00	1,548,300	貸付株式数	500株
JMホールディングス	5,900	1,759.00	10,378,100	貸付株式数	100株
コマダホールディングス	18,100	2,412.00	43,657,200	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	3,400	703.00	2,390,200	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	5,600	984.00	5,510,400	貸付株式数	2,000株
串カツ田中HLDGS	2,000	1,803.00	3,606,000	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,500	799.00	3,595,500	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,400	7,580.00	56,092,000	貸付株式数	2,900株
ダイニック	1,600	619.00	990,400	貸付株式数	800株
共和レザー	3,800	510.00	1,938,000	貸付株式数	1,400株
ピーバンドットコム	800	529.00	423,200	貸付株式数	300株
力の源HD	4,200	909.00	3,817,800	貸付株式数	1,600株
FOOD & LIFE COMPANY	42,300	2,495.00	105,538,500		
アセンテック	2,400	512.00	1,228,800	貸付株式数	900株
セーレン	13,400	2,623.00	35,148,200	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,100	832.00	1,747,200	貸付株式数	1,100株
東海染工	500	1,127.00	563,500		
小松マテーレ	10,000	799.00	7,990,000		
ワコールホールディングス	13,300	2,329.00	30,975,700		
ホギメディカル	9,500	3,490.00	33,155,000		
クラウドディアHLDGS	1,600	285.00	456,000	貸付株式数	500株
TSIホールディングス	24,800	481.00	11,928,800	貸付株式数	9,100株
マツオカコーポレーション	1,800	1,043.00	1,877,400		
ワールド	9,000	1,315.00	11,835,000		
TIS	78,400	3,890.00	304,976,000		
JNSホールディングス	3,000	359.00	1,077,000	貸付株式数	1,400株
グリー	37,400	768.00	28,723,200	貸付株式数	14,900株
GMOペパボ	1,000	2,022.00	2,022,000	貸付株式数	400株
コーエーテクモHD	43,700	2,375.00	103,787,500		
三菱総合研究所	3,400	5,150.00	17,510,000		
ボルテージ	2,100	327.00	686,700	貸付株式数	600株
電算	700	1,631.00	1,141,700	貸付株式数	200株
AGS	2,700	653.00	1,763,100	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	5,500	552.00	3,036,000	貸付株式数	2,200株

ブレインパッド	6,900	893.00	6,161,700	貸付株式数	700株
K L a b	13,700	490.00	6,713,000	貸付株式数	5,400株
ポールトゥウィンホール ディン	11,900	937.00	11,150,300		
ネクソン	180,300	2,894.00	521,788,200		
アイスタイル	22,300	538.00	11,997,400	貸付株式数	8,900株
エムアップホールディング ス	8,600	1,354.00	11,644,400	貸付株式数	3,400株
エイチーム	5,100	829.00	4,227,900		
エニグモ	8,900	597.00	5,313,300	貸付株式数	3,200株
テクノスジャパン	5,600	489.00	2,738,400	貸付株式数	300株
e n i s h	5,300	424.00	2,247,200	貸付株式数	2,000株
コロプラ	27,100	686.00	18,590,600	貸付株式数	10,100株
オルトプラス	5,400	290.00	1,566,000	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	40,600	496.00	20,137,600	貸付株式数	16,000株
クロス・マーケティングG	2,800	783.00	2,192,400	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツH L D G S	4,400	1,890.00	8,316,000	貸付株式数	200株
システム情報	6,100	898.00	5,477,800	貸付株式数	100株
メディアドゥ	2,800	1,910.00	5,348,000		
じげん	20,300	357.00	7,247,100		
ブイキューブ	8,400	795.00	6,678,000	貸付株式数	3,300株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	516.00	670,800	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,200	1,131.00	2,488,200	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	336.00	1,444,800		
フィックスターズ	7,900	1,376.00	10,870,400		
C A R T A H O L D I N G S	3,300	1,700.00	5,610,000	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,800	1,162.00	6,739,600	貸付株式数	2,100株 (1,900株)
セレス	2,800	958.00	2,682,400	貸付株式数	1,100株
S H I F T	5,100	28,870.00	147,237,000		
特種東海製紙	3,400	2,833.00	9,632,200	貸付株式数	1,300株
ティーガイア	7,400	1,652.00	12,224,800	貸付株式数	2,200株
セック	900	2,336.00	2,102,400	貸付株式数	100株
テクマトリックス	12,700	1,646.00	20,904,200		
プロシップ	3,000	1,527.00	4,581,000	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エ ンター	21,400	2,080.00	44,512,000	貸付株式数	7,300株

GMOペイメントゲートウェイ	15,900	12,160.00	193,344,000		
ザッパラス	2,500	365.00	912,500	貸付株式数	900株
システムリサーチ	2,100	2,031.00	4,265,100	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	38,900	2,450.00	95,305,000		
さくらインターネット	7,700	527.00	4,057,900	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,100	1,682.00	3,532,200		
GMOグローバルサインHD	2,100	4,000.00	8,400,000	貸付株式数	800株
SRAホールディングス	3,500	3,125.00	10,937,500		
システムインテグレータ	1,900	461.00	875,900	貸付株式数	900株
朝日ネット	7,500	571.00	4,282,500		
eBASE	9,700	620.00	6,014,000	貸付株式数	3,600株
アバントグループ	8,800	1,500.00	13,200,000	貸付株式数	3,300株
アドソル日進	2,800	1,508.00	4,222,400	貸付株式数	1,100株
ODKソリューションズ	1,500	603.00	904,500	貸付株式数	600株
フリービット	4,300	1,156.00	4,970,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	9,200	2,607.00	23,984,400	貸付株式数	1,300株
サイバーコム	1,100	1,567.00	1,723,700	貸付株式数	400株
アステリア	5,500	812.00	4,466,000	貸付株式数	2,100株
アイル	3,900	1,991.00	7,764,900	貸付株式数	1,500株
王子ホールディングス	289,700	528.00	152,961,600		
日本製紙	36,300	965.00	35,029,500		
三菱製紙	7,900	279.00	2,204,100	貸付株式数	3,000株
北越コーポレーション	43,900	777.00	34,110,300	貸付株式数	17,600株
中越パルプ	2,600	948.00	2,464,800	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,500	780.00	1,950,000	貸付株式数	800株
大王製紙	30,600	1,064.00	32,558,400		
阿波製紙	1,100	303.00	333,300	貸付株式数	500株
マークラインズ	3,800	2,783.00	10,575,400		
メディカル・データ・ビジ	10,600	1,002.00	10,621,200	貸付株式数	3,800株
gumi	11,400	737.00	8,401,800	貸付株式数	4,500株
ショーケース	1,600	363.00	580,800	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	903.00	1,354,500	貸付株式数	500株
テラスカイ	3,000	2,800.00	8,400,000	貸付株式数	1,000株 (100株)
デジタル・インフォメーション	3,600	1,985.00	7,146,000		

PCIホールディングス	2,900	999.00	2,897,100	貸付株式数	200株
アイビーシー	1,100	447.00	491,700	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,300	1,001.00	2,302,300	貸付株式数	800株
PR TIMES	1,700	2,478.00	4,212,600	貸付株式数	600株
ラクス	33,000	1,720.00	56,760,000		
ランドコンピュータ	1,600	875.00	1,400,000	貸付株式数	300株
ダブルスタンダード	2,800	2,213.00	6,196,400	貸付株式数	1,100株
オープンドア	4,900	1,967.00	9,638,300	貸付株式数	1,900株
マイネット	2,300	455.00	1,046,500	貸付株式数	700株
アカツキ	3,300	2,274.00	7,504,200		
ベネフィットジャパン	400	1,302.00	520,800	貸付株式数	200株
UBICOMホールディングス	2,200	2,295.00	5,049,000	貸付株式数	800株
カナミックネットワーク	10,700	645.00	6,901,500		
ノムラシステムコーポレーション	6,500	123.00	799,500	貸付株式数	2,900株
レンゴー	63,200	866.00	54,731,200		
トーモク	4,000	1,600.00	6,400,000		
ザ・パック	5,200	2,521.00	13,109,200	貸付株式数	1,900株
チェンジ	17,100	2,181.00	37,295,100		
シンクロ・フード	4,400	476.00	2,094,400	貸付株式数	1,700株
オークネット	3,600	1,951.00	7,023,600	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,300	595.00	773,500	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,900	909.00	1,727,100	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	1,517.00	1,517,000	貸付株式数	500株
マクロミル	15,800	1,103.00	17,427,400	貸付株式数	6,000株
ビーグリー	1,200	1,300.00	1,560,000	貸付株式数	600株
オロ	2,100	1,867.00	3,920,700	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,500	1,590.00	3,975,000		
テモナ	1,300	340.00	442,000	貸付株式数	500株
ニーズウェル	2,100	730.00	1,533,000	貸付株式数	500株
マネーフォワード	16,800	4,885.00	82,068,000	貸付株式数	6,200株 (100株)
サインポスト	2,700	733.00	1,979,100	貸付株式数	700株
昭和電工	67,300	2,188.00	147,252,400	貸付株式数	300株
住友化学	517,600	498.00	257,764,800		
住友精化	3,100	4,240.00	13,144,000	貸付株式数	400株
日産化学	33,100	6,740.00	223,094,000		
ラサ工業	2,800	2,117.00	5,927,600		

クレハ	6,000	9,730.00	58,380,000	貸付株式数	2,100株
多木化学	2,800	5,250.00	14,700,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	5,100	1,275.00	6,502,500		
石原産業	12,900	1,121.00	14,460,900	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,800	1,613.00	2,903,400		
日本曹達	7,600	4,280.00	32,528,000	貸付株式数	900株
東ソー	93,300	1,623.00	151,425,900		
トクヤマ	22,800	1,913.00	43,616,400		
セントラル硝子	11,200	3,495.00	39,144,000	貸付株式数	100株
東亜合成	36,800	1,177.00	43,313,600		
大阪ソーダ	4,300	4,130.00	17,759,000		
関東電化	13,900	1,026.00	14,261,400	貸付株式数	100株
デンカ	25,400	3,310.00	84,074,000		
イビデン	40,200	5,510.00	221,502,000		
信越化学	119,300	17,570.00	2,096,101,000		
日本カ - バイド	2,900	1,307.00	3,790,300	貸付株式数	900株
電算システムHD	3,300	2,272.00	7,497,600	貸付株式数	1,200株
堺 化 学	5,600	1,879.00	10,522,400	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,500	1,203.00	7,819,500	貸付株式数	2,500株
エア・ウォーター	66,100	1,615.00	106,751,500		
日本酸素HLDGS	67,800	2,273.00	154,109,400		
日本化学工業	2,500	1,858.00	4,645,000		
東邦アセチレン	1,500	1,120.00	1,680,000		
日本パ - カライジング	35,000	991.00	34,685,000		
高压ガス	11,200	648.00	7,257,600		
チタン工業	1,100	1,571.00	1,728,100	貸付株式数	200株
四国化成	8,600	1,351.00	11,618,600		
戸田工業	1,600	2,948.00	4,716,800	貸付株式数	600株
ステラ ケミファ	4,300	2,617.00	11,253,100	貸付株式数	1,300株
保土谷化学	2,000	3,105.00	6,210,000		
日本触媒	10,700	5,510.00	58,957,000		
大日精化	5,200	1,717.00	8,928,400		
カネカ	16,100	3,500.00	56,350,000		
協和キリン	84,300	3,175.00	267,652,500		
三菱瓦斯化学	52,300	1,961.00	102,560,300		
三井化学	58,800	3,100.00	182,280,000		
J S R	65,200	2,873.00	187,319,600		
東京応化工業	12,100	6,840.00	82,764,000		
大阪有機化学	5,300	2,113.00	11,198,900		
三菱ケミカルグループ	471,200	729.20	343,599,040		

KHネオケム	11,700	2,767.00	32,373,900	
ダイセル	103,500	998.00	103,293,000	
住友ベークライト	10,400	4,320.00	44,928,000	
積水化学	144,900	1,927.00	279,222,300	
日本ゼオン	42,300	1,325.00	56,047,500	
アイカ工業	17,700	3,235.00	57,259,500	
UBE	35,900	1,999.00	71,764,100	
積水樹脂	10,200	1,809.00	18,451,800	
タキロンシーアイ	16,700	508.00	8,483,600	
旭有機材	4,900	2,654.00	13,004,600	
ニチバン	4,300	1,754.00	7,542,200	貸付株式数 1,500株
リケンテクノス	16,100	499.00	8,033,900	
大倉工業	3,200	2,014.00	6,444,800	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	14,500	393.00	5,698,500	
群栄化学	1,800	2,424.00	4,363,200	貸付株式数 100株
タイガース ポリマー	6,200	404.00	2,504,800	
ミライアル	2,100	1,716.00	3,603,600	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,600	741.00	1,926,600	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	16,600	590.00	9,794,000	
竹本容器	2,200	756.00	1,663,200	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,800	1,757.00	6,676,600	
恵和	2,300	3,725.00	8,567,500	
日本化薬	53,300	1,248.00	66,518,400	貸付株式数 200株
カーリットホールディングス	6,400	719.00	4,601,600	貸付株式数 2,500株
ソルクシーズ	5,600	369.00	2,066,400	貸付株式数 2,300株
CLホールディングス	2,000	833.00	1,666,000	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	30,000	712.00	21,360,000	
フェイス	2,000	544.00	1,088,000	貸付株式数 700株
プロトコーポレーション	8,700	1,260.00	10,962,000	貸付株式数 1,400株
ハイマックス	2,200	1,435.00	3,157,000	
アミューズ	3,900	1,792.00	6,988,800	
野村総合研究所	143,100	2,996.00	428,727,600	
ドリームインキュベータ	2,200	2,826.00	6,217,200	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	5,800	967.00	5,608,600	
クイック	5,500	2,083.00	11,456,500	
TAC	3,800	207.00	786,600	貸付株式数 800株 (400株)
CEホールディングス	3,500	513.00	1,795,500	
日本システム技術	2,900	1,734.00	5,028,600	貸付株式数 200株

電通グループ	75,000	4,400.00	330,000,000	
インテージホールディングス	9,500	1,532.00	14,554,000	
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,437.00	3,592,500	
東邦システムサイエンス	1,900	1,019.00	1,936,100	貸付株式数 700株
びあ	2,400	3,280.00	7,872,000	貸付株式数 900株
イオンファンタジー	3,100	2,923.00	9,061,300	貸付株式数 1,200株
ソースネクスト	35,500	279.00	9,904,500	貸付株式数 12,000株
シーティーエス	7,800	835.00	6,513,000	
ネクシィーズグループ	2,200	716.00	1,575,200	貸付株式数 800株
インフォコム	9,000	2,046.00	18,414,000	
メディカルシステムネットワーク	6,400	404.00	2,585,600	
日本精化	4,100	2,238.00	9,175,800	貸付株式数 2,100株
扶桑化学工業	6,500	3,525.00	22,912,500	
トリケミカル	9,400	2,411.00	22,663,400	
シンプレクスHD	11,700	2,321.00	27,155,700	
HEROZ	2,300	1,247.00	2,868,100	貸付株式数 900株 (700株)
ラクスル	9,800	3,065.00	30,037,000	
メルカリ	31,400	2,811.00	88,265,400	貸付株式数 11,800株
I P S	2,300	3,075.00	7,072,500	貸付株式数 900株
F I G	8,200	409.00	3,353,800	貸付株式数 3,200株 (1,300株)
システムサポート	2,900	1,492.00	4,326,800	貸付株式数 600株
A D E K A	24,500	2,252.00	55,174,000	
日油	21,600	5,780.00	124,848,000	
ミヨシ油脂	2,700	986.00	2,662,200	貸付株式数 900株
新日本理化学	10,200	255.00	2,601,000	貸付株式数 2,200株
ハリマ化成グループ	5,500	841.00	4,625,500	
イーソル	4,500	911.00	4,099,500	貸付株式数 1,300株
アルテリア・ネットワークス	6,400	1,250.00	8,000,000	貸付株式数 700株
東海ソフト	1,100	926.00	1,018,600	貸付株式数 200株
ウイングアーク1ST	7,200	2,219.00	15,976,800	
ヒト・コミュニケーションズHD	1,900	1,647.00	3,129,300	貸付株式数 700株
サーバーワークス	1,400	2,807.00	3,929,800	貸付株式数 500株
東名	500	1,488.00	744,000	貸付株式数 100株
ヴィッツ	700	1,027.00	718,900	貸付株式数 200株



トビラシステムズ	1,800	1,133.00	2,039,400	貸付株式数	600株
Sansan	26,000	1,670.00	43,420,000	貸付株式数	10,400株
Link-U	1,300	962.00	1,250,600	貸付株式数	500株
ギフトィ	7,500	2,261.00	16,957,500	貸付株式数	3,000株
花王	169,700	5,461.00	926,731,700		
第一工業製薬	2,700	2,009.00	5,424,300		
石原ケミカル	3,500	1,234.00	4,319,000		
日華化学	3,000	891.00	2,673,000	貸付株式数	1,100株
ニイタカ	1,400	2,095.00	2,933,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,400	4,405.00	19,382,000		
ベース	2,400	3,865.00	9,276,000	貸付株式数	900株
JMDC	11,400	5,120.00	58,368,000		
武田薬品	617,500	4,050.00	2,500,875,000		
アステラス製薬	668,700	2,128.00	1,422,993,600		
住友ファーマ	51,800	1,067.00	55,270,600		
塩野義製薬	89,200	6,950.00	619,940,000		
わかもと製薬	6,600	236.00	1,557,600	貸付株式数	2,900株
日本新薬	16,500	8,090.00	133,485,000		
中外製薬	218,400	3,624.00	791,481,600		
科研製薬	12,000	3,940.00	47,280,000	貸付株式数	500株
エーザイ	84,900	9,332.00	792,286,800		
理研ビタミン	5,900	1,776.00	10,478,400		
ロート製薬	33,800	4,490.00	151,762,000		
小野薬品	134,600	3,516.00	473,253,600		
久光製薬	15,500	3,870.00	59,985,000		
有機合成薬品	5,800	299.00	1,734,200	貸付株式数	1,300株
持田製薬	8,400	3,380.00	28,392,000	貸付株式数	100株
参天製薬	135,500	1,114.00	150,947,000		
扶桑薬品	2,300	2,047.00	4,708,100		
日本ケミファ	700	1,699.00	1,189,300		
ツムラ	22,000	2,999.00	65,978,000		
日医工	10,400	205.00	2,132,000	貸付株式数	8,800株
テルモ	217,500	4,043.00	879,352,500		
HUグループHD	20,900	2,775.00	57,997,500		
キッセイ薬品工業	10,800	2,534.00	27,367,200		
生化学工業	13,300	943.00	12,541,900	貸付株式数	4,500株
栄研化学	11,400	1,903.00	21,694,200		
鳥居薬品	3,800	2,902.00	11,027,600	貸付株式数	700株
JCRファーマ	23,600	1,912.00	45,123,200		
東和薬品	10,700	2,112.00	22,598,400		

富士製薬工業	4,500	1,019.00	4,585,500	
ゼリア新薬工業	9,700	2,226.00	21,592,200	貸付株式数 1,900株
第一三共	607,900	4,518.00	2,746,492,200	
キョーリン製薬HD	15,200	1,770.00	26,904,000	貸付株式数 5,700株
大幸薬品	12,800	523.00	6,694,400	貸付株式数 4,600株
ダイト	5,300	2,594.00	13,748,200	
大塚ホールディングス	159,600	4,690.00	748,524,000	
大正製薬HD	15,500	5,600.00	86,800,000	
ペプチドリーム	33,800	1,712.00	57,865,600	
大日本塗料	9,400	767.00	7,209,800	貸付株式数 3,100株
日本ペイントHOLD	308,600	1,120.00	345,632,000	
関西ペイント	64,000	1,877.00	120,128,000	
神東塗料	9,900	132.00	1,306,800	貸付株式数 1,800株
中国塗料	13,500	1,033.00	13,945,500	
日本特殊塗料	4,400	872.00	3,836,800	
藤倉化成	10,800	409.00	4,417,200	貸付株式数 3,700株
太陽ホールディングス	10,800	2,539.00	27,421,200	
D I C	27,600	2,506.00	69,165,600	貸付株式数 11,000株
サカタインクス	16,000	1,105.00	17,680,000	貸付株式数 1,400株
東洋インキSCホールディングン	14,100	1,880.00	26,508,000	貸付株式数 5,600株
T & K TOKA	6,600	1,002.00	6,613,200	
アルプス技研	6,200	2,091.00	12,964,200	
サニックス	11,400	236.00	2,690,400	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
ダイオーズ	300	1,498.00	449,400	
日本空調サービス	7,700	708.00	5,451,600	貸付株式数 500株
オリエンタルランド	75,700	19,720.00	1,492,804,000	
フォーカスシステムズ	5,000	1,002.00	5,010,000	
ダスキン	15,900	2,953.00	46,952,700	
パーク24	53,400	2,005.00	107,067,000	貸付株式数 5,500株
明光ネットワークジャパン	9,300	617.00	5,738,100	貸付株式数 3,100株
ファルコホールディングス	3,200	1,807.00	5,782,400	貸付株式数 400株
クレスコ	5,400	1,735.00	9,369,000	貸付株式数 2,100株
フジ・メディア・HD	67,200	1,077.00	72,374,400	
秀英予備校	1,500	443.00	664,500	貸付株式数 800株
田谷	1,100	536.00	589,600	貸付株式数 600株
ラウンドワン	59,800	610.00	36,478,000	
リゾートトラスト	28,200	2,435.00	68,667,000	
オービック	23,300	21,700.00	505,610,000	

ジャストシステム	10,000	3,300.00	33,000,000	
TDCソフト	5,800	1,469.00	8,520,200	
Zホールディングス	992,900	373.50	370,848,150	
ビー・エム・エル	8,800	3,460.00	30,448,000	
トレンドマイクロ	40,300	6,810.00	274,443,000	
りらいあコミュニケーション	11,800	1,027.00	12,118,600	
IDホールディングス	4,600	918.00	4,222,800	
リソー教育	32,600	323.00	10,529,800	貸付株式数 200株
日本オラクル	13,300	8,030.00	106,799,000	
早稲田アカデミー	3,900	1,153.00	4,496,700	貸付株式数 1,600株
アルファシステムズ	2,200	4,240.00	9,328,000	貸付株式数 500株
フューチャー	17,400	1,671.00	29,075,400	
CAC HOLDINGS	4,300	1,532.00	6,587,600	
SBテクノロジー	3,000	2,060.00	6,180,000	
トーセ	1,800	774.00	1,393,200	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	73,500	2,296.00	168,756,000	
オービックビジネスC	13,700	4,675.00	64,047,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	37,400	3,350.00	125,290,000	
アイティフォー	9,000	801.00	7,209,000	
東京個別指導学院	8,400	529.00	4,443,600	貸付株式数 2,600株
東計電算	1,000	5,910.00	5,910,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	171,100	1,229.00	210,281,900	
楽天グループ	330,800	653.00	216,012,400	
エクスネット	800	998.00	798,400	
クリーク・アンド・リバー社	4,200	2,058.00	8,643,600	
モーニングスター	11,600	470.00	5,452,000	貸付株式数 4,800株
テー・オー・ダブリュー	14,900	297.00	4,425,300	貸付株式数 4,200株
大塚商会	39,500	4,570.00	180,515,000	貸付株式数 13,500株
サイボウズ	9,600	2,219.00	21,302,400	貸付株式数 200株
山田コンサルティンググループ	3,700	1,144.00	4,232,800	貸付株式数 600株
セントラルスポーツ	2,600	2,416.00	6,281,600	貸付株式数 900株
パラカ	2,400	1,908.00	4,579,200	貸付株式数 600株
電通国際情報サービス	8,500	4,575.00	38,887,500	貸付株式数 3,800株
ACCESS	8,100	748.00	6,058,800	貸付株式数 900株
デジタルガレージ	12,400	4,005.00	49,662,000	
イーエムシステムズ	11,600	988.00	11,460,800	
ウェザーニューズ	2,500	7,610.00	19,025,000	貸付株式数 900株
CIJ	6,300	934.00	5,884,200	貸付株式数 2,400株
ビジネスエンジニアリング	1,500	2,219.00	3,328,500	貸付株式数 600株

日本エンタープライズ	7,100	142.00	1,008,200	貸付株式数	2,900株
WOWOW	3,900	1,252.00	4,882,800	貸付株式数	700株
スカラ	6,800	747.00	5,079,600		
インテリジェント ウェイブ	3,700	806.00	2,982,200	貸付株式数	1,500株
フルキャストホールディングス	6,800	3,075.00	20,910,000	貸付株式数	2,600株
エン・ジャパン	12,900	2,448.00	31,579,200		
あすか製薬HD	7,200	1,279.00	9,208,800		
サワイグループHD	16,000	4,240.00	67,840,000		
富士フイルムHLDS	133,800	7,315.00	978,747,000		
コニカミノルタ	156,800	569.00	89,219,200		
資生堂	145,700	5,799.00	844,914,300		
ライオン	83,800	1,465.00	122,767,000		
高砂香料	4,900	2,844.00	13,935,600	貸付株式数	1,700株
マンダム	15,000	1,438.00	21,570,000		
ミルボン	10,300	5,700.00	58,710,000	貸付株式数	2,200株
ファンケル	30,500	2,566.00	78,263,000		
コーセー	14,200	14,490.00	205,758,000		
コタ	5,800	1,683.00	9,761,400		
シーボン	800	1,631.00	1,304,800	貸付株式数	400株
ポーラ・オルビスHD	35,700	1,786.00	63,760,200	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	6,200	5,830.00	36,146,000		
アジュバンホールディング	1,600	956.00	1,529,600	貸付株式数	600株
新日本製薬	4,000	1,373.00	5,492,000	貸付株式数	1,400株
エステー	5,300	1,538.00	8,151,400	貸付株式数	2,000株
アグロカネショウ	3,000	1,551.00	4,653,000	貸付株式数	1,000株
コニシ	12,200	1,723.00	21,020,600		
長谷川香料	14,600	3,075.00	44,895,000		
星光PMC	4,400	556.00	2,446,400	貸付株式数	100株
小林製薬	21,300	8,500.00	181,050,000		
荒川化学工業	6,800	995.00	6,766,000	貸付株式数	1,200株
メック	5,800	2,571.00	14,911,800	貸付株式数	1,700株
日本高純度化学	2,000	2,504.00	5,008,000		
タカラバイオ	18,800	1,801.00	33,858,800		
JCU	8,000	3,370.00	26,960,000		
新田ゼラチン	4,400	1,076.00	4,734,400	貸付株式数	1,700株
OATアグリオ	2,900	1,776.00	5,150,400	貸付株式数	1,100株
デクセリアルズ	20,200	3,230.00	65,246,000	貸付株式数	8,000株
アース製薬	6,300	5,320.00	33,516,000		

北興化学	7,200	909.00	6,544,800	
大成ラミック	2,100	3,075.00	6,457,500	
クミアイ化学	28,000	923.00	25,844,000	
日本農薬	13,100	749.00	9,811,900	貸付株式数 5,100株
富士興産	1,600	1,126.00	1,801,600	
ニチレキ	8,600	1,295.00	11,137,000	
ユシロ化学	3,500	828.00	2,898,000	
ピーピー・カストロール	2,600	965.00	2,509,000	
富士石油	14,400	275.00	3,960,000	貸付株式数 5,600株
MORESCO	2,800	1,112.00	3,113,600	貸付株式数 1,000株
出光興産	77,500	3,240.00	251,100,000	
ENEOSホールディングス	1,260,200	466.00	587,253,200	
コスモエネルギーHLDGS	26,500	3,880.00	102,820,000	
テスホールディングス	7,300	1,112.00	8,117,600	貸付株式数 2,900株
インフロニアHD	71,500	1,030.00	73,645,000	
横浜ゴム	39,700	2,255.00	89,523,500	
TOYO TIRE	40,000	1,567.00	62,680,000	
ブリヂストン	222,800	5,167.00	1,151,207,600	
住友ゴム	68,300	1,188.00	81,140,400	
藤倉コンポジット	5,200	847.00	4,404,400	貸付株式数 2,400株
オカモト	4,200	3,850.00	16,170,000	
WOW WORLD GROUP	1,200	1,059.00	1,270,800	貸付株式数 400株
アキレス	4,800	1,351.00	6,484,800	貸付株式数 700株
フコク	3,500	1,096.00	3,836,000	
ニッタ	7,800	2,930.00	22,854,000	
クリエートメディック	3,200	907.00	2,902,400	貸付株式数 700株
住友理工	15,100	616.00	9,301,600	
三ツ星ベルト	10,500	3,430.00	36,015,000	
バンドー化学	12,400	999.00	12,387,600	貸付株式数 100株
AGC	70,900	4,600.00	326,140,000	
日本板硝子	35,300	604.00	21,321,200	
石塚硝子	1,300	1,486.00	1,931,800	貸付株式数 400株
有沢製作所	11,200	1,284.00	14,380,800	
日本山村硝子	2,200	610.00	1,342,000	貸付株式数 700株
日本電気硝子	28,200	2,532.00	71,402,400	
オハラ	3,200	1,265.00	4,048,000	貸付株式数 1,200株
住友大阪セメント	9,700	3,235.00	31,379,500	

太平洋セメント	44,100	2,167.00	95,564,700	
リソルホールディングス	600	4,565.00	2,739,000	貸付株式数 300株
日本ヒューム	6,800	648.00	4,406,400	
日本コンクリート	14,900	234.00	3,486,600	貸付株式数 100株
三谷セキサン	2,900	4,210.00	12,209,000	
アジアパイルHD	12,100	536.00	6,485,600	
東海カーボン	58,100	1,047.00	60,830,700	
日本カーボン	3,800	4,335.00	16,473,000	貸付株式数 300株
東洋炭素	4,600	3,930.00	18,078,000	貸付株式数 1,600株
ノリタケ	3,400	4,040.00	13,736,000	
TOTO	46,000	4,745.00	218,270,000	
日本碍子	82,100	1,811.00	148,683,100	
日本特殊陶業	53,100	2,680.00	142,308,000	
ダントーホールディングス	5,000	276.00	1,380,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	2,600	18,820.00	48,932,000	
品川リフラクトリーズ	1,900	3,945.00	7,495,500	
黒崎播磨	1,400	5,030.00	7,042,000	
ヨータイ	4,500	1,376.00	6,192,000	
東京窯業	4,700	270.00	1,269,000	貸付株式数 2,800株
ニッカトー	2,500	511.00	1,277,500	
フジインコーポレーテッド	5,500	7,020.00	38,610,000	
クニミネ工業	1,800	861.00	1,549,800	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	800	867.00	693,600	
ニチアス	17,600	2,418.00	42,556,800	貸付株式数 800株
日本製鉄	321,300	2,192.50	704,450,250	
神戸製鋼所	144,200	620.00	89,404,000	
中山製鋼所	14,700	755.00	11,098,500	
合同製鐵	3,500	1,903.00	6,660,500	
JFEホールディングス	191,800	1,526.00	292,686,800	
東京製鐵	20,100	1,403.00	28,200,300	貸付株式数 8,000株
共英製鋼	8,100	1,293.00	10,473,300	貸付株式数 3,100株
大和工業	11,800	4,710.00	55,578,000	貸付株式数 100株
東京鐵鋼	3,300	1,412.00	4,659,600	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,200	1,135.00	3,632,000	
淀川製鋼所	8,100	2,543.00	20,598,300	貸付株式数 400株
丸一鋼管	21,800	2,843.00	61,977,400	
モリ工業	1,600	2,813.00	4,500,800	
大同特殊鋼	9,000	4,415.00	39,735,000	
日本高周波	1,900	315.00	598,500	貸付株式数 900株

日本冶金工	5,200	4,305.00	22,386,000	
山陽特殊製鋼	7,000	2,213.00	15,491,000	
愛知製鋼	4,100	2,273.00	9,319,300	
日本金属	1,500	1,021.00	1,531,500	貸付株式数 700株
大平洋金属	5,100	2,050.00	10,455,000	
新日本電工	46,000	422.00	19,412,000	
栗本鉄工所	3,300	1,796.00	5,926,800	
虹 技	800	906.00	724,800	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	800	954.00	763,200	貸付株式数 300株
日本製鋼所	19,300	2,920.00	56,356,000	
三菱製鋼	4,600	995.00	4,577,000	
日亜鋼業	6,600	237.00	1,564,200	貸付株式数 200株
日本精線	1,000	4,365.00	4,365,000	貸付株式数 400株
エンビプロHD	4,900	720.00	3,528,000	貸付株式数 1,900株
大紀アルミニウム	10,200	1,295.00	13,209,000	
日本軽金属HD	19,200	1,532.00	29,414,400	
三井金属	20,800	3,135.00	65,208,000	
東邦亜鉛	4,200	2,159.00	9,067,800	
三菱マテリアル	47,700	2,187.00	104,319,900	
住友鉱山	83,200	4,645.00	386,464,000	
DOWAホールディングス	16,100	4,520.00	72,772,000	
古河機金	10,200	1,291.00	13,168,200	
エス・サイエンス	42,800	28.00	1,198,400	貸付株式数 14,800株
大阪チタニウム	10,500	4,195.00	44,047,500	
東邦チタニウム	13,000	2,748.00	35,724,000	
UACJ	10,000	2,305.00	23,050,000	
CKサンエツ	1,700	4,225.00	7,182,500	貸付株式数 600株
古河電工	24,500	2,597.00	63,626,500	
住友電工	247,800	1,600.50	396,603,900	
フジクラ	77,000	1,117.00	86,009,000	
昭和電線HLDGS	8,000	1,795.00	14,360,000	貸付株式数 100株
東京特殊電線	1,000	5,650.00	5,650,000	
タツタ電線	15,000	431.00	6,465,000	貸付株式数 900株
カナレ電気	800	1,498.00	1,198,400	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	3,900	1,098.00	4,282,200	貸付株式数 1,400株
いよぎんホールディング	80,700	729.00	58,830,300	
しずおかフィナンシャル	154,200	1,005.00	154,971,000	
ちゅうぎんフィナンシャ	56,900	968.00	55,079,200	
リョービ	7,600	1,243.00	9,446,800	
アーステイ	7,800	390.00	3,042,000	

アサヒHD	29,000	2,044.00	59,276,000	
東洋製罐グループHD	47,900	1,594.00	76,352,600	
ホッカンホールディングス	5,000	1,323.00	6,615,000	貸付株式数 1,400株
コロナ	3,900	867.00	3,381,300	
横河ブリッジHLDGS	9,700	1,933.00	18,750,100	
駒井ハルテック	1,300	1,539.00	2,000,700	
高田機工	800	2,455.00	1,964,000	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	66,100	1,290.00	85,269,000	
文化シャッタ-	20,700	1,124.00	23,266,800	貸付株式数 8,900株
三協立山	10,400	565.00	5,876,000	
アルインコ	5,400	1,000.00	5,400,000	貸付株式数 1,800株
東洋シャッタ-	1,700	524.00	890,800	貸付株式数 200株
LIXIL	104,600	2,109.00	220,601,400	
日本ファイルコン	7,100	466.00	3,308,600	貸付株式数 2,200株
ノーリツ	10,500	1,484.00	15,582,000	
長府製作所	7,200	1,972.00	14,198,400	
リンナイ	13,000	10,180.00	132,340,000	
ユニプレス	12,400	882.00	10,936,800	
ダイニチ工業	3,500	686.00	2,401,000	
日東精工	11,200	523.00	5,857,600	
三洋工業	800	1,770.00	1,416,000	貸付株式数 300株
岡部	11,400	719.00	8,196,600	
ジーテクト	7,800	1,534.00	11,965,200	
東プレ	12,500	1,259.00	15,737,500	
高周波熱錬	12,600	680.00	8,568,000	貸付株式数 4,600株
東京製綱	4,400	891.00	3,920,400	
サンコール	6,400	636.00	4,070,400	貸付株式数 2,500株
モリテックスチル	5,500	245.00	1,347,500	貸付株式数 2,300株
パイオラックス	9,900	1,740.00	17,226,000	
エイチワン	7,200	648.00	4,665,600	
日本発条	63,400	915.00	58,011,000	
中央発條	4,900	706.00	3,459,400	
アドバネクス	1,200	1,211.00	1,453,200	貸付株式数 400株
三浦工業	29,200	3,260.00	95,192,000	
タクマ	21,400	1,276.00	27,306,400	
テクノプロ・ホールディング	48,000	3,790.00	181,920,000	
アトラグループ	1,600	201.00	321,600	貸付株式数 600株
インターワークス	1,700	368.00	625,600	貸付株式数 800株
アイ・アールジャパンHD	3,700	1,808.00	6,689,600	貸付株式数 1,400株



Keepers 技研	5,200	4,255.00	22,126,000		
ファーストロジック	1,100	827.00	909,700	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	955.00	1,241,500	貸付株式数	400株
Gunosy	4,400	669.00	2,943,600	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	2,200	197.00	433,400	貸付株式数	900株 (100株)
イー・ガーディアン	2,700	2,866.00	7,738,200		
リブセンス	3,300	315.00	1,039,500	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	21,900	2,433.00	53,282,700		
ベクトル	11,200	1,281.00	14,347,200	貸付株式数	300株
ウチヤマホールディングス	3,300	278.00	917,400	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレーション	6,000	1,158.00	6,948,000	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,600	3,015.00	7,839,000	貸付株式数	1,000株
I B J	4,400	980.00	4,312,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,500	1,601.00	5,603,500	貸付株式数	1,000株
バリューHR	6,300	1,675.00	10,552,500	貸付株式数	2,100株
M & A キャピタルパートナー	6,600	4,855.00	32,043,000	貸付株式数	2,600株
ライドオンエクスプレスHD	2,600	1,123.00	2,919,800	貸付株式数	1,100株
ERIホールディングス	2,000	1,080.00	2,160,000	貸付株式数	800株
アビスト	1,100	2,939.00	3,232,900	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディング	10,800	1,334.00	14,407,200		
ウィルグループ	6,000	1,360.00	8,160,000		
エスクローAJ	7,600	156.00	1,185,600	貸付株式数	300株
メドピア	5,600	1,649.00	9,234,400	貸付株式数	2,200株
レアジョブ	1,400	969.00	1,356,600	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	529,500	4,329.00	2,292,205,500		
エラン	9,500	1,025.00	9,737,500		
ツガミ	15,300	1,184.00	18,115,200		
オークマ	6,800	5,210.00	35,428,000		
芝浦機械	7,700	2,742.00	21,113,400		
アマダ	111,200	1,098.00	122,097,600		
アイダエンジニア	13,900	835.00	11,606,500	貸付株式数	5,700株
TAKISAWA	1,400	1,106.00	1,548,400	貸付株式数	400株
FUJI	30,200	2,074.00	62,634,800		
牧野フライス	7,700	4,615.00	35,535,500	貸付株式数	3,000株

オーエスジー	33,300	1,936.00	64,468,800	
ダイジェット	400	856.00	342,400	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	20,000	720.00	14,400,000	
D M G 森精機	42,300	1,831.00	77,451,300	
ソディック	18,500	763.00	14,115,500	
ディスコ	11,300	40,600.00	458,780,000	
日東工器	3,700	1,526.00	5,646,200	
日進工具	5,600	1,127.00	6,311,200	貸付株式数 200株
パンチ工業	5,300	421.00	2,231,300	
富士ダイス	2,300	610.00	1,403,000	貸付株式数 800株
土木管理総合試験	2,800	312.00	873,600	貸付株式数 100株
ネットマーケティング	1,700	897.00	1,524,900	
日本郵政	938,100	1,078.00	1,011,271,800	
ベルシステム24HLDGS	9,600	1,348.00	12,940,800	貸付株式数 4,200株
鎌倉新書	8,100	840.00	6,804,000	貸付株式数 1,200株 (100株)
S M N	1,700	476.00	809,200	貸付株式数 600株
一蔵	900	456.00	410,400	貸付株式数 400株
グローバルキッズCOMP	1,100	587.00	645,700	
エアトリ	4,600	2,673.00	12,295,800	貸付株式数 1,800株
アトラエ	5,600	1,477.00	8,271,200	
ストライク	3,500	4,465.00	15,627,500	
ソラスト	19,700	821.00	16,173,700	
セラク	2,500	1,239.00	3,097,500	貸付株式数 900株
インソース	8,900	3,375.00	30,037,500	
豊田自動織機	50,800	7,810.00	396,748,000	
豊和工業	3,800	881.00	3,347,800	貸付株式数 1,200株
ニデックオーケーケー	2,800	968.00	2,710,400	貸付株式数 1,100株
石川製作所	1,700	1,451.00	2,466,700	貸付株式数 800株
東洋機械金属	4,400	543.00	2,389,200	貸付株式数 700株
津田駒工業	1,000	593.00	593,000	貸付株式数 500株
エンシュウ	1,300	717.00	932,100	貸付株式数 600株
島精機製作所	11,000	2,092.00	23,012,000	
オプトラン	10,400	2,547.00	26,488,800	
N C ホールディングス	1,500	2,096.00	3,144,000	
イワキポンプ	4,500	1,307.00	5,881,500	
フリーー	7,300	1,155.00	8,431,500	貸付株式数 900株
ヤマシンフィルタ	17,800	482.00	8,579,600	貸付株式数 4,900株 (4,700株)

日阪製作所	6,300	818.00	5,153,400	
やまびこ	11,400	1,134.00	12,927,600	
野村マイクロ・サイエンス	2,400	4,705.00	11,292,000	
平田機工	3,300	5,470.00	18,051,000	
ペガサスマシン製造	7,700	967.00	7,445,900	
マルマエ	3,400	1,901.00	6,463,400	貸付株式数 1,300株 (900株)
タツモ	3,800	1,766.00	6,710,800	貸付株式数 1,200株
ナプテスコ	44,000	3,410.00	150,040,000	貸付株式数 15,100株
三井海洋開発	8,700	1,529.00	13,302,300	
レオン自動機	7,300	1,170.00	8,541,000	貸付株式数 400株
S M C	22,800	61,760.00	1,408,128,000	
ホソカワミクロン	5,200	2,944.00	15,308,800	
ユニオンツール	2,900	3,510.00	10,179,000	
オイレス工業	11,200	1,494.00	16,732,800	貸付株式数 3,900株
日精エーエスピー	3,100	4,210.00	13,051,000	貸付株式数 1,200株
サト - ホールディングス	9,900	1,954.00	19,344,600	
技研製作所	7,300	3,285.00	23,980,500	
日本エアーテック	3,300	1,172.00	3,867,600	貸付株式数 1,200株
カ ワ タ	1,900	850.00	1,615,000	
日精樹脂工業	4,800	957.00	4,593,600	
オカダアイヨン	2,100	1,547.00	3,248,700	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	3,000	1,466.00	4,398,000	貸付株式数 1,100株
小松製作所	329,100	3,179.00	1,046,208,900	
住友重機械	41,400	2,912.00	120,556,800	
日立建機	27,900	3,210.00	89,559,000	
日 工	10,100	620.00	6,262,000	
巴工業	3,400	2,418.00	8,221,200	貸付株式数 1,200株
井関農機	6,500	1,277.00	8,300,500	
T O W A	7,200	1,969.00	14,176,800	貸付株式数 2,500株
丸山製作所	1,000	1,610.00	1,610,000	貸付株式数 400株
北川鉄工所	2,800	1,187.00	3,323,600	
シンニッタン	12,700	223.00	2,832,100	
ローツェ	3,700	8,390.00	31,043,000	貸付株式数 1,400株
タカキタ	1,900	469.00	891,100	貸付株式数 1,000株 (100株)
クボタ	371,700	2,030.00	754,551,000	
荏原実業	3,400	2,267.00	7,707,800	
東洋エンジニア	8,900	582.00	5,179,800	

三菱化工機	2,100	2,116.00	4,443,600	
月島機械	9,300	981.00	9,123,300	貸付株式数 4,000株
帝国電機製作所	5,100	2,367.00	12,071,700	
東京機械	1,600	615.00	984,000	
新東工業	13,200	670.00	8,844,000	貸付株式数 500株
渋谷工業	6,500	2,478.00	16,107,000	
アイチ コーポレーション	9,700	800.00	7,760,000	貸付株式数 100株
小森コーポレーション	15,800	814.00	12,861,200	貸付株式数 3,200株
鶴見製作所	5,200	1,996.00	10,379,200	
住友精密	1,000	3,640.00	3,640,000	
日本ギア工業	4,000	326.00	1,304,000	貸付株式数 900株
酒井重工業	1,100	3,525.00	3,877,500	
荏原製作所	28,700	5,260.00	150,962,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	700	2,573.00	1,801,100	貸付株式数 300株
西島製作所	5,900	1,550.00	9,145,000	
北越工業	7,000	1,153.00	8,071,000	
ダイキン工業	83,900	22,405.00	1,879,779,500	
オルガノ	9,600	2,818.00	27,052,800	
ト - ヨ - カネツ	2,700	2,487.00	6,714,900	
栗田工業	39,300	6,100.00	239,730,000	
椿本チエイン	10,300	3,145.00	32,393,500	
大同工業	2,500	770.00	1,925,000	
日 機 装	17,400	1,001.00	17,417,400	
木村化工機	5,300	700.00	3,710,000	貸付株式数 2,300株
レイズネクスト	9,600	1,255.00	12,048,000	
アネスト岩田	11,500	944.00	10,856,000	貸付株式数 100株
ダイフク	36,200	7,040.00	254,848,000	
サムコ	2,300	3,865.00	8,889,500	貸付株式数 800株
加藤製作所	3,300	804.00	2,653,200	
油研工業	700	1,824.00	1,276,800	
タダノ	36,900	980.00	36,162,000	
フジテック	25,700	3,010.00	77,357,000	
C K D	19,900	2,043.00	40,655,700	
平和	23,400	2,445.00	57,213,000	
理想科学工業	6,200	2,378.00	14,743,600	貸付株式数 2,400株
S A N K Y O	13,800	5,360.00	73,968,000	
日本金銭機械	7,700	1,014.00	7,807,800	貸付株式数 3,000株
マースグループH L D G S	4,100	2,050.00	8,405,000	
フクシマガリレイ	5,100	4,350.00	22,185,000	
オーイズミ	2,700	416.00	1,123,200	貸付株式数 100株

ダイコク電機	3,800	1,606.00	6,102,800	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	12,700	3,175.00	40,322,500		
ア マ ノ	19,900	2,475.00	49,252,500		
J U K I	10,700	671.00	7,179,700	貸付株式数	200株
サンデン	10,200	227.00	2,315,400	貸付株式数	4,200株
ジャノメ	7,000	620.00	4,340,000	貸付株式数	2,700株
ブラザー工業	93,700	2,214.00	207,451,800		
マックス	8,500	2,059.00	17,501,500		
モリタホールディングス	12,000	1,266.00	15,192,000		
グローリー	18,100	2,304.00	41,702,400		
新晃工業	7,000	1,548.00	10,836,000		
大和冷機工業	10,600	1,225.00	12,985,000		
セガサミーホールディングス	56,500	1,823.00	102,999,500		
日本ピストンリング	2,200	1,208.00	2,657,600		
リ ケ ン	2,700	2,277.00	6,147,900		
T P R	8,000	1,232.00	9,856,000		
ツバキ・ナカシマ	17,300	1,035.00	17,905,500		
ホシザキ	45,200	4,635.00	209,502,000		
大豊工業	5,900	699.00	4,124,100	貸付株式数	2,300株
日本精工	129,400	760.00	98,344,000		
N T N	142,200	290.00	41,238,000		
ジェイテクト	63,300	1,010.00	63,933,000		
不 二 越	5,300	3,870.00	20,511,000		
ミネベアミツミ	122,100	2,243.00	273,870,300		
日本トムソン	18,400	609.00	11,205,600		
T H K	40,900	2,669.00	109,162,100		
ユーシン精機	4,600	688.00	3,164,800		
前澤給装工業	5,000	933.00	4,665,000	貸付株式数	200株
イーグル工業	7,800	1,109.00	8,650,200		
前澤工業	4,700	612.00	2,876,400		
日本ピラ - 工業	6,700	2,765.00	18,525,500		
キッツ	27,300	844.00	23,041,200		
日 立	352,800	7,299.00	2,575,087,200		
東 芝	135,200	4,690.00	634,088,000		
三菱電機	725,900	1,377.50	999,927,250		
富士電機	42,700	5,620.00	239,974,000		
東洋電機製造	2,300	873.00	2,007,900		
安川電機	83,100	4,445.00	369,379,500		

シンフォニア テクノロ ジー	7,600	1,507.00	11,453,200	貸付株式数	100株
明 電 舎	10,600	1,987.00	21,062,200		
オリジン	1,600	1,316.00	2,105,600	貸付株式数	700株
山洋電気	3,000	6,200.00	18,600,000		
デンヨー	5,200	1,500.00	7,800,000		
P H Cホールディングス	9,800	1,595.00	15,631,000		
ベイカレントコンサルティ ング	54,300	4,465.00	242,449,500	貸付株式数	2,100株
O R C H E S T R A H L D G S	1,500	2,305.00	3,457,500	貸付株式数	400株
アイモバイル	3,700	1,266.00	4,684,200	貸付株式数	1,400株
キャリアインデックス	2,400	350.00	840,000	貸付株式数	800株
M S - J a p a n	2,300	1,074.00	2,470,200	貸付株式数	1,000株
船場	1,600	767.00	1,227,200	貸付株式数	100株
ジャパンエレベーターSH D	25,400	1,742.00	44,246,800		
フルテック	1,000	1,209.00	1,209,000	貸付株式数	400株
グリーンズ	2,700	1,121.00	3,026,700	貸付株式数	1,000株
ツナググループHLDGS	2,100	531.00	1,115,100	貸付株式数	800株
G A M E W I T H	2,000	408.00	816,000	貸付株式数	800株
M S & C O N S U L T I N G	800	625.00	500,000	貸付株式数	300株
ウェルビー	5,300	861.00	4,563,300	貸付株式数	1,900株
エル・ティー・エス	900	3,495.00	3,145,500	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	4,300	3,370.00	14,491,000	貸付株式数	1,700株
日総工産	5,400	598.00	3,229,200	貸付株式数	2,200株
キュービーネットHLDG S	3,700	1,493.00	5,524,100		
R P Aホールディングス	9,700	287.00	2,783,900	貸付株式数	4,000株
三桜工業	10,500	669.00	7,024,500		
マキタ	87,300	3,130.00	273,249,000		
東芝テック	10,500	3,695.00	38,797,500		
芝浦メカトロニクス	1,300	10,980.00	14,274,000		
マブチモーター	17,400	4,130.00	71,862,000		
日本電産	170,600	8,534.00	1,455,900,400		
ユーエムシーエレクトロニ クス	5,000	505.00	2,525,000		
トレックス・セミコンダク ター	3,300	2,926.00	9,655,800	貸付株式数	1,300株

東光高岳	4,200	1,847.00	7,757,400	貸付株式数	200株
ダブル・スコープ	22,900	1,868.00	42,777,200	貸付株式数	9,100株 (100株)
宮越ホールディングス	3,100	884.00	2,740,400	貸付株式数	1,200株
ダイヘン	6,300	4,080.00	25,704,000		
ヤーマン	13,700	1,306.00	17,892,200	貸付株式数	5,400株
JVCケンウッド	64,100	370.00	23,717,000		
ミマキエンジニアリング	6,600	654.00	4,316,400		
I - P E X	3,800	1,309.00	4,974,200	貸付株式数	1,000株
日新電機	16,600	1,341.00	22,260,600		
大崎電気	16,300	533.00	8,687,900	貸付株式数	100株
オムロン	64,500	7,044.00	454,338,000		
日東工業	9,500	2,331.00	22,144,500	貸付株式数	100株
I D E C	10,500	3,265.00	34,282,500	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,600	1,022.00	2,657,200	貸付株式数	1,000株
不二電機工業	1,100	1,133.00	1,246,300	貸付株式数	600株 (100株)
ジーエス・ユアサ コーポ	23,000	2,161.00	49,703,000		
サクサホールディングス	1,400	1,370.00	1,918,000	貸付株式数	700株
メルコホールディングス	1,800	3,110.00	5,598,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	2,100	1,732.00	3,637,200	貸付株式数	600株
ダイヤモンドエレクトリック H D	2,100	1,497.00	3,143,700	貸付株式数	800株
日本電気	99,300	4,855.00	482,101,500		
富士通	70,000	18,465.00	1,292,550,000		
沖電気	31,700	728.00	23,077,600		
岩崎通信機	3,100	783.00	2,427,300	貸付株式数	1,000株
電気興業	3,200	2,100.00	6,720,000	貸付株式数	200株
サンケン電気	6,500	6,630.00	43,095,000		
ナカヨ	1,000	1,100.00	1,100,000	貸付株式数	400株
アイホン	4,300	1,917.00	8,243,100	貸付株式数	1,400株
ルネサスエレクトロニクス	458,200	1,316.00	602,991,200		
セイコーエプソン	93,500	2,152.00	201,212,000		
ワコム	55,600	648.00	36,028,800	貸付株式数	22,200株
アルバック	16,600	5,930.00	98,438,000		
アクセル	2,600	1,507.00	3,918,200	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,100	3,595.00	18,334,500		
ジャパンディスプレイ	61,700	49.00	3,023,300		
日本信号	15,800	1,033.00	16,321,400	貸付株式数	200株
京三製作所	14,200	414.00	5,878,800		

能美防災	9,400	1,590.00	14,946,000	貸付株式数	100株
ホーチキ	5,100	1,445.00	7,369,500		
星和電機	2,900	451.00	1,307,900		
エレコム	16,700	1,452.00	24,248,400		
パナソニックホールディング	829,800	1,274.00	1,057,165,200		
シャープ	84,600	973.00	82,315,800	貸付株式数	33,300株
アンリツ	49,700	1,466.00	72,860,200		
富士通ゼネラル	19,900	3,235.00	64,376,500		
ソニーグループ	492,200	11,255.00	5,539,711,000		
T D K	111,200	4,880.00	542,656,000		
帝国通信工業	3,100	1,403.00	4,349,300	貸付株式数	300株
タムラ製作所	30,100	816.00	24,561,600	貸付株式数	11,300株
アルプスアルパイン	62,600	1,302.00	81,505,200		
池上通信機	2,100	549.00	1,152,900	貸付株式数	800株
日本電波工業	8,400	1,745.00	14,658,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,900	919.00	3,584,100		
メイコー	7,600	3,005.00	22,838,000	貸付株式数	3,300株
日本トリム	1,500	2,462.00	3,693,000		
ローランドディー・ジー	3,900	3,085.00	12,031,500		
フオスタ - 電機	6,400	961.00	6,150,400		
S M K	1,600	2,639.00	4,222,400	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,500	2,414.00	13,277,000	貸付株式数	2,100株
ティアック	10,800	119.00	1,285,200	貸付株式数	4,000株
ホシデン	16,800	1,626.00	27,316,800		
ヒロセ電機	11,600	18,200.00	211,120,000		
日本航空電子	14,300	2,347.00	33,562,100	貸付株式数	5,500株
T O A	7,900	766.00	6,051,400	貸付株式数	100株
マクセル	15,100	1,410.00	21,291,000		
古野電気	9,100	1,020.00	9,282,000		
スミダコーポレーション	6,300	1,462.00	9,210,600		
アイコム	2,600	2,785.00	7,241,000	貸付株式数	1,000株
リオン	2,900	2,050.00	5,945,000		
横河電機	77,100	2,566.00	197,838,600		
新電元工業	2,700	3,335.00	9,004,500		
アズビル	48,500	4,175.00	202,487,500		
東亜ディーケーケー	3,800	849.00	3,226,200	貸付株式数	1,500株
日本光電工業	32,300	3,195.00	103,198,500		
チノ	3,100	1,840.00	5,704,000	貸付株式数	700株



共和電業	8,400	359.00	3,015,600	
日本電子材料	4,600	1,542.00	7,093,200	貸付株式数 1,300株
堀場製作所	15,500	6,240.00	96,720,000	
アドバンテスト	54,800	9,130.00	500,324,000	
小野測器	3,800	410.00	1,558,000	貸付株式数 1,000株
エスベック	5,900	2,058.00	12,142,200	
キーエンス	69,600	57,140.00	3,976,944,000	
日置電機	3,700	6,820.00	25,234,000	貸付株式数 1,000株
シスメックス	60,000	8,318.00	499,080,000	
日本マイクロニクス	11,400	1,459.00	16,632,600	
メガチップス	5,700	2,645.00	15,076,500	
OBARA GROUP	3,100	3,485.00	10,803,500	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	5,800	755.00	4,379,000	
澤藤電機	800	1,278.00	1,022,400	貸付株式数 300株
デンソー	143,500	7,514.00	1,078,259,000	
原田工業	2,900	824.00	2,389,600	貸付株式数 1,200株 (1,000株)
コーセル	8,900	851.00	7,573,900	
イリソ電子工業	6,400	4,760.00	30,464,000	貸付株式数 1,200株
オプテックスグループ	12,700	2,146.00	27,254,200	
千代田インテグレ	2,700	2,407.00	6,498,900	
レーザーテック	34,300	25,135.00	862,130,500	
スタンレー電気	49,400	2,793.00	137,974,200	
岩崎電気	2,200	2,546.00	5,601,200	
ウシオ電機	36,100	1,782.00	64,330,200	
岡谷電機	4,800	280.00	1,344,000	貸付株式数 2,100株
ヘリオステクノH	6,300	446.00	2,809,800	貸付株式数 2,500株
エノモト	1,700	1,942.00	3,301,400	貸付株式数 600株
日本セラミック	7,000	2,647.00	18,529,000	
遠藤照明	2,900	747.00	2,166,300	
古河電池	5,000	1,123.00	5,615,000	貸付株式数 2,200株
双信電機	2,600	425.00	1,105,000	貸付株式数 1,400株
山一電機	5,900	1,845.00	10,885,500	
図研	6,000	3,290.00	19,740,000	貸付株式数 1,700株
日本電子	17,500	4,560.00	79,800,000	
カシオ	51,800	1,340.00	69,412,000	
ファナック	68,300	20,365.00	1,390,929,500	
日本シイエムケイ	14,600	578.00	8,438,800	貸付株式数 1,200株
エンプラス	2,000	4,470.00	8,940,000	

大真空	8,400	839.00	7,047,600	貸付株式数 3,300株 (100株)
ローム	32,100	10,850.00	348,285,000	
浜松ホトニクス	55,800	7,160.00	399,528,000	
三井ハイテック	7,200	7,960.00	57,312,000	貸付株式数 2,800株
新光電気工業	24,600	3,805.00	93,603,000	貸付株式数 9,200株
京セラ	108,000	6,981.00	753,948,000	
協栄産業	700	1,788.00	1,251,600	
太陽誘電	33,800	4,365.00	147,537,000	
村田製作所	210,900	7,464.00	1,574,157,600	
双葉電子工業	12,600	592.00	7,459,200	貸付株式数 300株
日東電工	50,700	8,610.00	436,527,000	
北陸電気工業	2,400	1,290.00	3,096,000	
東海理化電機	19,400	1,552.00	30,108,800	
ニチコン	14,100	1,414.00	19,937,400	貸付株式数 5,600株
日本ケミコン	6,800	1,841.00	12,518,800	
K O A	10,500	2,199.00	23,089,500	貸付株式数 3,800株
三井E & S H D	21,700	413.00	8,962,100	
日立造船	57,300	896.00	51,340,800	
三菱重工業	122,900	5,457.00	670,665,300	
川崎重工業	52,400	2,926.00	153,322,400	
I H I	44,200	3,760.00	166,192,000	
名村造船所	17,800	487.00	8,668,600	貸付株式数 7,100株
サノヤスホールディングス	8,400	127.00	1,066,800	貸付株式数 3,800株
スプリックス	2,400	993.00	2,383,200	貸付株式数 100株
マネジメントソリューションズ	3,900	3,825.00	14,917,500	貸付株式数 1,500株
プロレド・パートナーズ	1,800	578.00	1,040,400	貸付株式数 600株
A N D F A C T O R Y	2,100	376.00	789,600	貸付株式数 700株
テノ・ホールディングス	900	552.00	496,800	貸付株式数 300株
フロンティア・マネジメント	2,400	1,405.00	3,372,000	
ピアラ	1,200	694.00	832,800	貸付株式数 400株
コプロ・ホールディングス	1,200	979.00	1,174,800	貸付株式数 400株
ギークス	1,000	878.00	878,000	貸付株式数 500株
カーブスホールディングス	22,000	982.00	21,604,000	貸付株式数 7,900株
フォーラムエンジニアリング	4,100	870.00	3,567,000	
FAST FITNESS J A P	2,400	1,335.00	3,204,000	貸付株式数 500株

日本車輛	2,600	1,965.00	5,109,000		
三菱ロジスネクスト	11,100	894.00	9,923,400	貸付株式数	4,200株
近畿車輛	800	1,064.00	851,200		
一家ホールディングス	1,700	625.00	1,062,500	貸付株式数	600株
フルサト・マルカHD	7,300	3,970.00	28,981,000	貸付株式数	2,900株
ヤマエグループHD	4,200	1,433.00	6,018,600		
ジャパクラフトホール ディ	2,400	652.00	1,564,800	貸付株式数	900株
F P G	27,900	1,165.00	32,503,500	貸付株式数	2,900株
島根銀行	1,700	462.00	785,400	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	4,000	414.00	1,656,000		
全国保証	17,900	5,100.00	91,290,000	貸付株式数	7,200株
めぶきフィナンシャルG	337,500	312.00	105,300,000		
ジャパンインベストメント A	5,600	1,227.00	6,871,200	貸付株式数	2,300株
東京きらぼしF G	8,700	2,387.00	20,766,900		
九州フィナンシャルG	119,500	397.00	47,441,500		
かんぼ生命保険	83,500	2,287.00	190,964,500		
ゆうちょ銀行	194,500	1,051.00	204,419,500	貸付株式数	77,800株
あんしん保証	3,400	257.00	873,800	貸付株式数	1,300株
富山第一銀行	16,400	568.00	9,315,200	貸付株式数	6,500株
コンコルディア・フィナン シャル	375,900	477.00	179,304,300		
ジェイリース	2,300	3,105.00	7,141,500		
西日本フィナンシャルHD	42,700	874.00	37,319,800		
イントラスト	2,700	766.00	2,068,200		
日本モーゲージサービス	3,900	860.00	3,354,000	貸付株式数	1,600株
C a s a	2,700	861.00	2,324,700	貸付株式数	900株
アルヒ	5,300	1,007.00	5,337,100		
プレミアグループ	11,500	1,925.00	22,137,500		
日産自動車	987,900	491.20	485,256,480		
いすゞ自動車	202,100	1,794.00	362,567,400		
トヨタ自動車	3,820,100	2,010.50	7,680,311,050		
日野自動車	89,500	620.00	55,490,000		
三菱自動車工業	271,300	636.00	172,546,800		
エフテック	4,600	533.00	2,451,800		
レシップホールディングス	2,400	490.00	1,176,000	貸付株式数	1,100株
G M B	1,300	762.00	990,600	貸付株式数	500株
ファルテック	1,100	610.00	671,000	貸付株式数	200株
武蔵精密工業	16,900	1,768.00	29,879,200		

日産車体	12,200	832.00	10,150,400	貸付株式数	4,800株
新明和工業	21,600	1,013.00	21,880,800		
極東開発工業	12,100	1,363.00	16,492,300		
トピー工業	5,600	1,730.00	9,688,000		
ティラド	1,800	2,648.00	4,766,400		
タチエス	10,900	1,096.00	11,946,400		
N O K	26,800	1,264.00	33,875,200		
フタバ産業	18,300	375.00	6,862,500		
K Y B	6,600	3,625.00	23,925,000		
市光工業	9,600	426.00	4,089,600		
大同メタル工業	13,500	495.00	6,682,500		
プレス工業	31,000	451.00	13,981,000		
ミクニ	8,000	340.00	2,720,000	貸付株式数	3,100株
太平洋工業	15,800	1,079.00	17,048,200		
河西工業	9,200	166.00	1,527,200	貸付株式数	1,200株
アイシン	53,600	3,765.00	201,804,000		
マ ッ ダ	230,000	1,091.00	250,930,000		
今仙電機製作所	4,300	649.00	2,790,700	貸付株式数	1,700株
本田技研	565,400	3,356.00	1,897,482,400		
スズキ	127,700	4,913.00	627,390,100		
S U B A R U	220,000	2,351.50	517,330,000		
安永	2,800	722.00	2,021,600	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	109,300	3,415.00	373,259,500		
小糸製作所	83,500	2,165.00	180,777,500		
T B K	5,900	261.00	1,539,900		
エクセディ	11,200	1,668.00	18,681,600		
ミツバ	12,900	533.00	6,875,700		
豊田合成	20,200	2,282.00	46,096,400		
愛三工業	11,300	702.00	7,932,600		
盟和産業	900	929.00	836,100		
日本プラスト	5,100	427.00	2,177,700	貸付株式数	500株
ヨ ロ ズ	6,200	805.00	4,991,000	貸付株式数	200株
エフ・シー・シー	12,100	1,425.00	17,242,500	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,600	2,312.00	3,699,200		
シマノ	28,500	23,380.00	666,330,000		
テイ・エス テック	31,700	1,607.00	50,941,900		
3 3 F G	5,700	1,500.00	8,550,000		
第四北越フィナンシャルG	10,800	2,618.00	28,274,400		
ひろぎんH L D G S	88,100	632.00	55,679,200		

マーキュリアホールディングス	4,100	613.00	2,513,300	貸付株式数	800株
おきなわFG	6,400	2,144.00	13,721,600		
ダイレクトマーケティングミクス	8,100	1,495.00	12,109,500	貸付株式数	3,000株
ポピンズ	1,000	1,700.00	1,700,000	貸付株式数	600株
LITALICO	5,600	2,338.00	13,092,800		
十六FG	8,700	2,640.00	22,968,000		
北国FHD	5,800	4,455.00	25,839,000	貸付株式数	1,000株
ネットプロHD	22,700	476.00	10,805,200	貸付株式数	9,100株
プロクレアホールディングス	8,300	2,159.00	17,919,700		
あいちフィナンシャルグル	9,200	2,215.00	20,378,000		
ジャムコ	3,800	1,611.00	6,121,800	貸付株式数	1,800株
小野建	6,700	1,444.00	9,674,800		
はるやまHLDGS	3,300	436.00	1,438,800	貸付株式数	1,200株
南陽	1,100	1,843.00	2,027,300	貸付株式数	500株
ノジマ	24,000	1,395.00	33,480,000		
佐島電機	4,600	1,348.00	6,200,800		
カッパ・クリエイト	11,700	1,378.00	16,122,600	貸付株式数	4,500株
エコートレーディング	1,500	642.00	963,000	貸付株式数	500株
伯東	4,200	3,735.00	15,687,000		
コンドーテック	5,600	1,004.00	5,622,400	貸付株式数	2,000株
中山福	3,700	330.00	1,221,000	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,600	636.00	3,561,600	貸付株式数	2,200株
ナガイレーベン	9,100	2,007.00	18,263,700		
三菱食品	6,800	3,250.00	22,100,000		
良品計画	95,000	1,449.00	137,655,000		
パリミキホールディングス	9,600	264.00	2,534,400	貸付株式数	3,600株
松田産業	5,600	2,303.00	12,896,800		
第一興商	14,200	4,090.00	58,078,000		
メディパルHD	76,400	1,830.00	139,812,000		
アドヴァングループ	7,000	890.00	6,230,000	貸付株式数	2,200株
SPK	3,100	1,391.00	4,312,100		
萩原電気HLDGS	2,800	2,517.00	7,047,600		
アルビス	2,500	2,384.00	5,960,000	貸付株式数	800株
アズワン	10,800	6,110.00	65,988,000		
スズデン	2,500	2,293.00	5,732,500		
尾家産業	1,800	926.00	1,666,800	貸付株式数	600株
シモジマ	5,000	961.00	4,805,000	貸付株式数	1,600株

ドウシシャ	7,700	1,524.00	11,734,800	
小津産業	1,500	1,469.00	2,203,500	貸付株式数 600株 (100株)
コナカ	8,400	335.00	2,814,000	
高速	3,700	1,768.00	6,541,600	
ハウス ローゼ	900	1,617.00	1,455,300	貸付株式数 300株
G - 7ホールディングス	9,200	1,523.00	14,011,600	
たけびし	2,700	1,508.00	4,071,600	貸付株式数 1,000株
イオン北海道	10,600	1,178.00	12,486,800	貸付株式数 4,600株
コジマ	14,400	614.00	8,841,600	貸付株式数 5,600株
ヒマラヤ	2,300	917.00	2,109,100	貸付株式数 900株
コーナン商事	9,900	3,310.00	32,769,000	貸付株式数 4,300株
ネットワンシステムズ	26,000	3,400.00	88,400,000	
エコス	2,600	1,833.00	4,765,800	貸付株式数 1,000株
ワタミ	8,900	1,059.00	9,425,100	貸付株式数 2,500株
マルシェ	2,500	404.00	1,010,000	貸付株式数 900株
リックス	1,900	2,206.00	4,191,400	貸付株式数 600株
システムソフト	24,300	99.00	2,405,700	貸付株式数 9,600株
パンパシフィックHD	165,000	2,384.00	393,360,000	
丸文	6,700	910.00	6,097,000	
西松屋チェーン	16,300	1,395.00	22,738,500	貸付株式数 6,500株
ゼンショーホールディングス	40,300	3,465.00	139,639,500	貸付株式数 13,500株
ハピネット	6,300	1,941.00	12,228,300	
幸楽苑ホールディングス	4,900	1,030.00	5,047,000	貸付株式数 1,900株
ハークスレイ	2,700	659.00	1,779,300	貸付株式数 1,000株
橋本総業HLDGS	3,000	992.00	2,976,000	貸付株式数 200株
日本ライフライン	22,000	947.00	20,834,000	貸付株式数 200株
サイゼリヤ	12,200	2,813.00	34,318,600	貸付株式数 3,700株
タカショー	6,300	704.00	4,435,200	貸付株式数 2,500株
VTホールディングス	27,700	508.00	14,071,600	
アルゴグラフィックス	6,400	3,800.00	24,320,000	
魚力	2,300	2,152.00	4,949,600	貸付株式数 800株
IDOM	22,200	748.00	16,605,600	貸付株式数 3,300株
日本エム・ディ・エム	4,300	1,036.00	4,454,800	
ポプラ	900	150.00	135,000	貸付株式数 700株
フジ・コーポレーション	4,100	1,288.00	5,280,800	貸付株式数 1,400株
ユナイテッドアローズ	7,900	1,885.00	14,891,500	貸付株式数 2,800株
進和	4,700	2,058.00	9,672,600	貸付株式数 1,700株
エスケイジャパン	1,800	535.00	963,000	

ダイトロン	2,800	2,446.00	6,848,800		
ハイデイ日高	10,900	1,958.00	21,342,200	貸付株式数	3,100株
シークス	10,400	1,399.00	14,549,600		
YU-WA CREATI ON H	4,600	210.00	966,000	貸付株式数	500株
コロワイド	34,000	1,789.00	60,826,000	貸付株式数	13,500株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,200	295.00	2,419,000	貸付株式数	3,100株
田中商事	2,100	564.00	1,184,400	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,500	1,399.00	4,896,500	貸付株式数	1,400株
壱番屋	5,800	4,555.00	26,419,000	貸付株式数	2,300株
白銅	2,600	2,493.00	6,481,800	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	2,800	205.00	574,000	貸付株式数	1,000株
P L A N T	1,200	632.00	758,400	貸付株式数	100株
スギホールディングス	14,700	6,190.00	90,993,000		
ダイコー通産	700	1,148.00	803,600	貸付株式数	200株
薬王堂ホールディングス	4,100	2,580.00	10,578,000	貸付株式数	1,500株
島津製作所	84,800	4,180.00	354,464,000		
J M S	7,200	511.00	3,679,200		
クボテック	2,400	230.00	552,000	貸付株式数	600株
長野計器	5,300	1,155.00	6,121,500		
ブイ・テクノロジー	3,600	2,693.00	9,694,800		
スター精密	13,200	1,755.00	23,166,000		
東京計器	5,600	1,177.00	6,591,200	貸付株式数	2,100株
愛知時計	2,700	1,369.00	3,696,300		
インターアクション	4,100	1,583.00	6,490,300	貸付株式数	1,500株 (100株)
オーバル	6,300	502.00	3,162,600	貸付株式数	2,900株
東京精密	15,300	4,340.00	66,402,000		
マニー	30,700	2,260.00	69,382,000	貸付株式数	10,500株
ニコン	108,200	1,334.00	144,338,800		
トプコン	36,800	1,647.00	60,609,600		
オリンパス	435,000	2,806.00	1,220,610,000		
理研計器	4,400	5,000.00	22,000,000	貸付株式数	2,100株
S C R E E Nホールディ ングス	11,900	9,030.00	107,457,000		
キヤノン電子	7,500	1,580.00	11,850,000		
タムロン	5,300	3,465.00	18,364,500		
HOYA	150,300	14,060.00	2,113,218,000		
シード	4,300	502.00	2,158,600	貸付株式数	600株

ノーリツ鋼機	6,700	2,634.00	17,647,800	
A & Dホロンホールディングス	10,400	1,043.00	10,847,200	
朝日インテック	92,000	2,414.00	222,088,000	
キヤノン	381,700	3,212.00	1,226,020,400	
リコー	182,400	1,086.00	198,086,400	
シチズン時計	76,200	600.00	45,720,000	
リズム	2,100	1,764.00	3,704,400	
大研医器	6,700	456.00	3,055,200	貸付株式数 2,100株
メニコン	23,800	2,905.00	69,139,000	
シンシア	700	553.00	387,100	貸付株式数 200株
KYORITSU	10,100	123.00	1,242,300	
中本パックス	2,100	1,567.00	3,290,700	貸付株式数 700株
スノーピーク	11,900	2,265.00	26,953,500	貸付株式数 4,700株 (100株)
パラマウントベッドHD	16,300	2,681.00	43,700,300	貸付株式数 6,000株
トランザクション	5,300	1,286.00	6,815,800	貸付株式数 2,000株
粧美堂	2,000	358.00	716,000	貸付株式数 700株
ニホンフラッシュ	6,500	965.00	6,272,500	貸付株式数 900株
前田工織	7,700	3,245.00	24,986,500	貸付株式数 2,800株
永大産業	7,600	226.00	1,717,600	
アートネイチャー	7,100	777.00	5,516,700	貸付株式数 300株
バンダイナムコHLDGS	63,500	9,045.00	574,357,500	
アイフィスジャパン	2,000	628.00	1,256,000	貸付株式数 700株
SHOEI	7,300	5,540.00	40,442,000	
フランスベッドHLDGS	8,300	932.00	7,735,600	貸付株式数 3,400株
マーベラス	11,300	679.00	7,672,700	
パイロットコーポレーション	10,900	4,950.00	53,955,000	
萩原工業	4,300	1,063.00	4,570,900	貸付株式数 1,700株
エイベックス	11,900	1,529.00	18,195,100	貸付株式数 4,500株
フジシールインターナショナル	14,000	1,869.00	26,166,000	貸付株式数 4,500株
タカラトミー	32,000	1,256.00	40,192,000	貸付株式数 3,000株
広済堂ホールディングス	4,700	1,945.00	9,141,500	
エステールホールディングス	1,600	630.00	1,008,000	貸付株式数 700株
レック	9,900	813.00	8,048,700	
タカノ	2,600	676.00	1,757,600	貸付株式数 1,000株
三光合成	10,100	459.00	4,635,900	貸付株式数 500株



プロネクサス	5,700	966.00	5,506,200	貸付株式数	2,300株
ホクシン	5,400	154.00	831,600	貸付株式数	2,100株
ウッドワン	2,300	932.00	2,143,600	貸付株式数	600株
大建工業	4,200	2,138.00	8,979,600		
きもと	10,200	238.00	2,427,600		
凸版印刷	90,900	2,132.00	193,798,800		
大日本印刷	82,500	2,841.00	234,382,500		
共同印刷	2,000	2,904.00	5,808,000	貸付株式数	700株
N I S S H A	13,200	1,759.00	23,218,800	貸付株式数	5,000株
光村印刷	600	1,172.00	703,200	貸付株式数	200株
藤森工業	5,600	3,195.00	17,892,000		
ヴィア・ホールディングス	9,700	116.00	1,125,200	貸付株式数	3,800株
TAKARA & COMPANY	4,800	2,089.00	10,027,200	貸付株式数	1,700株
前澤化成工業	4,400	1,385.00	6,094,000	貸付株式数	1,300株
未来工業	2,500	1,488.00	3,720,000		
アシックス	64,200	2,955.00	189,711,000		
ツツミ	1,600	1,957.00	3,131,200	貸付株式数	700株
ウェーブロックHLDGS	3,200	611.00	1,955,200	貸付株式数	1,200株
ジェイエスピー	4,800	1,487.00	7,137,600	貸付株式数	1,400株
ニチハ	8,700	2,823.00	24,560,100	貸付株式数	100株
ローランド	5,100	4,060.00	20,706,000		
エフピコ	13,200	3,785.00	49,962,000		
小松ウオール工業	2,500	1,840.00	4,600,000		
ヤマハ	43,800	5,410.00	236,958,000		
河合楽器	1,900	2,579.00	4,900,100	貸付株式数	400株
クリナップ	7,800	670.00	5,226,000		
ビジョン	44,300	2,044.00	90,549,200	貸付株式数	300株
天馬	6,300	2,083.00	13,122,900		
兼松サステック	500	1,594.00	797,000	貸付株式数	100株
キングジム	6,100	894.00	5,453,400	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	20,700	1,599.00	33,099,300	貸付株式数	1,700株
リンテック	14,900	2,248.00	33,495,200		
信越ポリマー	12,700	1,247.00	15,836,900		
東リ	15,800	211.00	3,333,800		
イトーキ	14,100	535.00	7,543,500		
任天堂	439,200	5,894.00	2,588,644,800	貸付株式数	175,600株
三菱鉛筆	9,800	1,394.00	13,661,200	貸付株式数	800株
松風	3,200	2,430.00	7,776,000	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	13,400	1,324.00	17,741,600	貸付株式数	100株

コクヨ	33,400	1,807.00	60,353,800	
ナカバヤシ	7,300	501.00	3,657,300	貸付株式数 1,000株
ニフコ	25,400	3,590.00	91,186,000	
立川ブラインド	3,200	1,142.00	3,654,400	貸付株式数 1,200株
グローブライド	5,600	2,678.00	14,996,800	
オカムラ	20,900	1,415.00	29,573,500	
バルカー	6,400	2,730.00	17,472,000	
MUTOHホールディングス	900	1,720.00	1,548,000	貸付株式数 300株
伊藤忠	453,500	4,287.00	1,944,154,500	
丸紅	581,500	1,548.00	900,162,000	
スクロール	10,900	711.00	7,749,900	
高島	1,300	2,970.00	3,861,000	
ヨンドシーホールディングス	6,200	1,732.00	10,738,400	貸付株式数 2,400株
三陽商会	2,600	1,322.00	3,437,200	貸付株式数 700株
長瀬産業	34,900	2,019.00	70,463,100	
ナイガイ	2,300	262.00	602,600	貸付株式数 900株
蝶理	4,200	1,987.00	8,345,400	
豊田通商	64,500	5,230.00	337,335,000	
オンワードホールディングス	44,900	330.00	14,817,000	
三共生興	10,200	483.00	4,926,600	
兼松	28,500	1,528.00	43,548,000	
美津濃	6,900	2,869.00	19,796,100	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,317.00	1,317,000	貸付株式数 400株
ルックホールディングス	2,000	2,497.00	4,994,000	貸付株式数 800株
三井物産	538,600	3,983.00	2,145,243,800	
日本紙パルプ	3,900	5,030.00	19,617,000	
東京エレクトロン	49,100	45,090.00	2,213,919,000	
カメイ	7,800	1,201.00	9,367,800	貸付株式数 100株
東都水産	400	5,070.00	2,028,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	1,100	2,410.00	2,651,000	貸付株式数 400株
スターゼン	5,600	2,077.00	11,631,200	貸付株式数 1,900株
セイコーグループ	10,700	3,165.00	33,865,500	
山善	19,800	1,000.00	19,800,000	貸付株式数 11,600株
椿本興業	1,300	3,995.00	5,193,500	貸付株式数 400株
住友商事	455,900	2,247.00	1,024,407,300	
BIPROGY	25,700	3,285.00	84,424,500	
内田洋行	3,300	4,640.00	15,312,000	

三菱商事	460,200	4,605.00	2,119,221,000	
第一実業	2,600	4,240.00	11,024,000	
キヤノンマーケティングJ PN	17,000	3,110.00	52,870,000	
西華産業	2,700	1,551.00	4,187,700	
佐藤商事	5,000	1,196.00	5,980,000	
菱洋エレクトロ	6,300	2,348.00	14,792,400	貸付株式数 1,800株
東京産業	6,400	790.00	5,056,000	貸付株式数 200株
ユアサ商事	6,600	3,590.00	23,694,000	
神鋼商事	1,800	4,520.00	8,136,000	
トルク	7,100	234.00	1,661,400	貸付株式数 1,100株
阪和興業	13,200	3,580.00	47,256,000	
正栄食品	4,900	4,275.00	20,947,500	貸付株式数 1,900株
カナデン	5,900	1,103.00	6,507,700	貸付株式数 2,200株
菱電商事	5,900	1,686.00	9,947,400	貸付株式数 2,300株
ニプロ	58,800	1,017.00	59,799,600	
岩谷産業	16,700	5,770.00	96,359,000	
ナイス	2,500	1,318.00	3,295,000	
ニチモウ	800	2,649.00	2,119,200	
極東貿易	4,400	1,325.00	5,830,000	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	13,200	417.00	5,504,400	
兼松エレクトロニクス	4,400	4,565.00	20,086,000	
三愛オブリ	20,300	1,292.00	26,227,600	貸付株式数 1,000株
稲畑産業	15,000	2,369.00	35,535,000	貸付株式数 2,000株
G S Iクレオス	4,300	1,458.00	6,269,400	貸付株式数 1,400株
明和産業	9,800	701.00	6,869,800	貸付株式数 3,900株
クワザワホールディングス	2,400	426.00	1,022,400	貸付株式数 1,000株
ゴ-ルドウイン	12,300	9,420.00	115,866,000	
ユニ・チャ-ム	145,300	5,083.00	738,559,900	
デサント	12,000	3,350.00	40,200,000	
キング	2,800	485.00	1,358,000	貸付株式数 1,400株
ワキタ	13,400	1,198.00	16,053,200	
ヤマトインタ-ナショナル	4,800	248.00	1,190,400	貸付株式数 2,300株
東邦ホールディングス	18,400	2,130.00	39,192,000	
サンゲツ	18,400	2,101.00	38,658,400	
ミツウロコグループ	9,400	1,058.00	9,945,200	
シナネンホールディングス	2,400	3,800.00	9,120,000	
伊藤忠エネクス	18,000	1,020.00	18,360,000	
サンリオ	20,800	4,525.00	94,120,000	貸付株式数 500株
サンワテクノス	3,800	1,526.00	5,798,800	

リョーサン	7,800	2,842.00	22,167,600	
新光商事	9,700	1,125.00	10,912,500	
トーホー	3,200	1,731.00	5,539,200	貸付株式数 1,200株
三信電気	2,900	2,246.00	6,513,400	
東陽テクニカ	8,700	1,399.00	12,171,300	
モスフード サービス	10,800	3,180.00	34,344,000	貸付株式数 3,600株
加賀電子	5,900	4,390.00	25,901,000	
三益半導体	6,400	2,558.00	16,371,200	
都築電気	3,600	1,334.00	4,802,400	
ソーダニツカ	5,900	599.00	3,534,100	
立花エレテック	5,100	1,776.00	9,057,600	貸付株式数 1,800株
木曽路	11,200	2,142.00	23,990,400	貸付株式数 1,200株
S R S ホールディングス	12,200	847.00	10,333,400	貸付株式数 4,300株 (1,100株)
千 趣 会	13,800	409.00	5,644,200	貸付株式数 5,300株
タカキキュー	6,100	79.00	481,900	貸付株式数 2,200株
リテールパートナーズ	10,800	1,237.00	13,359,600	貸付株式数 3,700株
ケーヨー	12,000	903.00	10,836,000	貸付株式数 5,500株
上新電機	6,600	1,905.00	12,573,000	貸付株式数 2,000株
日本瓦斯	39,400	2,103.00	82,858,200	
ロイヤルホールディングス	14,200	2,397.00	34,037,400	貸付株式数 5,600株
東 天 紅	600	816.00	489,600	貸付株式数 100株
いなげや	6,600	1,184.00	7,814,400	貸付株式数 2,900株
チヨダ	7,300	763.00	5,569,900	貸付株式数 2,500株
ライフコーポレーション	6,300	2,457.00	15,479,100	
リンガーハット	9,500	2,195.00	20,852,500	貸付株式数 3,800株
M r M a x H D	10,600	662.00	7,017,200	
テンアライド	7,800	260.00	2,028,000	貸付株式数 3,100株
A O K I ホールディングス	13,700	686.00	9,398,200	貸付株式数 2,400株
オークワ	11,100	942.00	10,456,200	貸付株式数 100株
コメリ	11,400	2,590.00	29,526,000	
青山商事	15,800	999.00	15,784,200	貸付株式数 100株
しまむら	8,600	12,490.00	107,414,000	
はせがわ	3,700	367.00	1,357,900	
高 島 屋	55,300	1,786.00	98,765,800	
松 屋	12,300	975.00	11,992,500	貸付株式数 1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	35,600	1,220.00	43,432,000	貸付株式数 12,100株
近鉄百貨店	2,200	2,465.00	5,423,000	貸付株式数 900株
丸井グループ	54,200	2,334.00	126,502,800	

クレディセゾン	43,500	1,757.00	76,429,500		
アクシアル リテイリング	4,900	3,395.00	16,635,500	貸付株式数	1,700株
井筒屋	3,300	402.00	1,326,600	貸付株式数	1,300株
イオン	249,300	2,823.00	703,773,900		
イズミ	11,000	3,015.00	33,165,000	貸付株式数	1,300株
フォーバル	2,800	1,034.00	2,895,200	貸付株式数	1,000株
平和堂	11,900	2,031.00	24,168,900	貸付株式数	5,200株
フジ	11,200	1,868.00	20,921,600	貸付株式数	6,500株
ヤオコー	8,200	6,700.00	54,940,000	貸付株式数	3,300株
ゼビオホールディングス	10,100	942.00	9,514,200		
ケースホールディングス	58,600	1,140.00	66,804,000		
PALTA C	11,600	4,315.00	50,054,000	貸付株式数	100株
三谷産業	12,700	313.00	3,975,100	貸付株式数	4,500株
OLYMPICグループ	2,300	524.00	1,205,200	貸付株式数	700株
日産東京販売HD	8,900	298.00	2,652,200		
新生銀行	20,300	2,339.00	47,481,700		
あおぞら銀行	42,700	2,595.00	110,806,500		
三菱UFJフィナンシャルG	4,495,600	755.10	3,394,627,560	貸付株式数	1,740,200株
りそなホールディングス	877,500	660.90	579,939,750		
三井住友トラストHD	127,400	4,407.00	561,451,800		
三井住友フィナンシャルG	501,300	4,673.00	2,342,574,900		
千葉銀行	190,200	834.00	158,626,800		
群馬銀行	131,500	451.00	59,306,500		
武蔵野銀行	8,300	1,883.00	15,628,900		
千葉興業銀行	14,700	376.00	5,527,200	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	27,600	212.00	5,851,200	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	21,600	1,948.00	42,076,800		
秋田銀行	4,200	1,684.00	7,072,800		
山形銀行	7,300	1,217.00	8,884,100	貸付株式数	300株
岩手銀行	4,500	1,935.00	8,707,500	貸付株式数	300株
東邦銀行	53,500	210.00	11,235,000	貸付株式数	800株
東北銀行	2,800	986.00	2,760,800		
ふくおかフィナンシャルG	54,400	2,691.00	146,390,400		
スルガ銀行	63,000	429.00	27,027,000		
八十二銀行	139,500	519.00	72,400,500		
山梨中央銀行	6,700	1,043.00	6,988,100	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	12,800	1,844.00	23,603,200		
福井銀行	5,700	1,464.00	8,344,800		

清水銀行	2,300	1,529.00	3,516,700		
富山銀行	900	1,746.00	1,571,400	貸付株式数	400株
滋賀銀行	11,300	2,616.00	29,560,800	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,100	2,335.00	23,583,500	貸付株式数	100株
百五銀行	62,100	350.00	21,735,000		
京都銀行	21,600	5,700.00	123,120,000		
紀陽銀行	24,200	1,521.00	36,808,200	貸付株式数	9,200株
ほくほくフィナンシャルG	43,600	929.00	40,504,400		
山陰合同銀行	42,200	755.00	31,861,000	貸付株式数	3,600株
鳥取銀行	1,700	1,101.00	1,871,700		
百十四銀行	5,900	1,794.00	10,584,600	貸付株式数	1,100株
四国銀行	9,900	919.00	9,098,100	貸付株式数	3,800株
阿波銀行	9,700	2,042.00	19,807,400		
大分銀行	3,900	1,980.00	7,722,000		
宮崎銀行	4,200	2,318.00	9,735,600		
佐賀銀行	3,500	1,610.00	5,635,000	貸付株式数	200株
琉球銀行	14,900	835.00	12,441,500	貸付株式数	1,900株
セブン銀行	242,100	261.00	63,188,100		
みずほフィナンシャルG	992,400	1,717.00	1,703,950,800		
高知銀行	1,800	670.00	1,206,000	貸付株式数	100株
山口フィナンシャルG	74,600	816.00	60,873,600		
芙蓉総合リース	6,300	8,790.00	55,377,000		
みずほリース	10,200	3,305.00	33,711,000	貸付株式数	4,000株
東京センチュリー	12,800	4,720.00	60,416,000	貸付株式数	4,800株
SBIホールディングス	99,200	2,618.00	259,705,600		
日本証券金融	27,700	1,026.00	28,420,200		
アイフル	113,700	408.00	46,389,600		
日本アジア投資	5,700	291.00	1,658,700	貸付株式数	100株
長野銀行	2,000	1,248.00	2,496,000	貸付株式数	800株
名古屋銀行	4,400	3,215.00	14,146,000		
北洋銀行	102,500	245.00	25,112,500		
大光銀行	1,800	1,184.00	2,131,200	貸付株式数	300株
愛媛銀行	8,700	881.00	7,664,700		
トマト銀行	1,800	998.00	1,796,400		
京葉銀行	30,800	545.00	16,786,000		
栃木銀行	30,600	321.00	9,822,600		
北日本銀行	2,100	1,937.00	4,067,700	貸付株式数	300株
東和銀行	11,200	547.00	6,126,400		
福島銀行	5,700	225.00	1,282,500		
大東銀行	1,800	647.00	1,164,600	貸付株式数	200株

リコーリース	6,600	3,650.00	24,090,000	
イオンフィナンシャルサービス	39,800	1,469.00	58,466,200	貸付株式数 15,400株
アコム	122,800	321.00	39,418,800	
ジャックス	7,400	3,905.00	28,897,000	
オリコ	18,000	1,197.00	21,546,000	
オリックス	458,300	2,210.50	1,013,072,150	
三菱HCキャピタル	267,600	654.00	175,010,400	
ジャフコグループ	22,900	2,407.00	55,120,300	
九州リースサービス	3,500	676.00	2,366,000	貸付株式数 1,300株
トモニホールディングス	53,300	349.00	18,601,700	
大和証券G本社	490,800	608.00	298,406,400	
野村ホールディングス	1,263,100	500.70	632,434,170	
岡三証券グループ	61,400	387.00	23,761,800	貸付株式数 21,300株
丸三証券	23,200	422.00	9,790,400	貸付株式数 1,600株
東洋証券	23,100	283.00	6,537,300	貸付株式数 8,700株 (100株)
東海東京HD	75,900	357.00	27,096,300	
光世証券	2,100	402.00	844,200	貸付株式数 500株
水戸証券	19,200	226.00	4,339,200	
いちよし証券	12,800	612.00	7,833,600	貸付株式数 100株
松井証券	40,800	786.00	32,068,800	
SOMPOホールディングス	117,700	6,059.00	713,144,300	
日本取引所グループ	192,500	1,975.50	380,283,750	
マネックスG	76,700	430.00	32,981,000	貸付株式数 30,500株
極東証券	8,900	616.00	5,482,400	貸付株式数 3,000株
岩井コスモホールディング	8,000	1,274.00	10,192,000	
アイザワ証券グループ	10,000	687.00	6,870,000	貸付株式数 100株
フィデアホール	6,500	1,361.00	8,846,500	貸付株式数 200株
池田泉州HD	85,200	232.00	19,766,400	
アニコムホールディングス	23,500	725.00	17,037,500	貸付株式数 400株
MS&AD	154,700	4,100.00	634,270,000	
マネーパートナーズGP	7,400	278.00	2,057,200	
スパークス・グループ	7,700	1,707.00	13,143,900	
小林洋行	3,700	221.00	817,700	貸付株式数 700株
第一生命HLDGS	349,100	2,543.50	887,935,850	
東京海上HD	690,300	2,827.00	1,951,478,100	
アドバンテッジリスクマネ	3,400	411.00	1,397,400	

イー・ギャランティ	11,100	2,459.00	27,294,900	貸付株式数	4,400株
アサックス	3,400	608.00	2,067,200	貸付株式数	1,500株
NECキャピタルソリューション	3,500	2,080.00	7,280,000		
T&Dホールディングス	184,200	1,668.00	307,245,600		
アドバンスクリエイト	4,100	1,072.00	4,395,200	貸付株式数	1,100株
三井不動産	297,700	2,776.50	826,564,050		
三菱地所	434,300	1,940.00	842,542,000		
平和不動産	11,100	4,090.00	45,399,000		
東京建物	65,200	1,921.00	125,249,200		
京阪神ビルディング	8,800	1,282.00	11,281,600	貸付株式数	2,300株
住友不動産	123,800	3,716.00	460,040,800		
太平洋興発	2,600	748.00	1,944,800		
テーオーシー	12,300	727.00	8,942,100	貸付株式数	4,800株
東京楽天地	1,100	4,355.00	4,790,500	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	9,800	2,748.00	26,930,400		
フジ住宅	9,500	656.00	6,232,000		
空港施設	7,900	539.00	4,258,100		
明和地所	3,400	631.00	2,145,400		
ゴールドクレスト	6,500	1,764.00	11,466,000		
リログループ	39,800	2,263.00	90,067,400	貸付株式数	200株
エスリード	3,200	1,888.00	6,041,600		
日神グループHLDGS	11,000	430.00	4,730,000	貸付株式数	4,400株
日本エスコン	15,400	838.00	12,905,200	貸付株式数	4,900株
MIRARTHホールディング	34,700	390.00	13,533,000		
AVANTIA	3,400	802.00	2,726,800	貸付株式数	600株
イオンモール	35,400	1,655.00	58,587,000		
毎日コムネット	2,500	713.00	1,782,500	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,700	1,012.00	2,732,400	貸付株式数	1,100株
ランド	410,600	10.00	4,106,000	貸付株式数	133,800株
カチタス	18,400	3,165.00	58,236,000		
東祥	5,000	1,226.00	6,130,000	貸付株式数	1,500株
トーセイ	11,400	1,402.00	15,982,800	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,600	1,993.00	3,188,800	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	11,300	1,172.00	13,243,600		
インテリックス	1,700	542.00	921,400	貸付株式数	600株
ランドビジネス	2,400	228.00	547,200	貸付株式数	1,000株
サンネクスタグループ	2,100	989.00	2,076,900	貸付株式数	900株
グランディハウス	5,700	548.00	3,123,600		



東武鉄道	76,500	3,310.00	253,215,000	
相鉄ホールディングス	23,100	2,190.00	50,589,000	
東急	195,100	1,749.00	341,229,900	
京浜急行	79,000	1,440.00	113,760,000	貸付株式数 9,700株
小田急電鉄	105,500	1,802.00	190,111,000	
京王電鉄	36,800	5,120.00	188,416,000	
京成電鉄	44,900	3,915.00	175,783,500	
富士急行	8,600	4,920.00	42,312,000	貸付株式数 3,200株
東日本旅客鉄道	118,000	7,811.00	921,698,000	
西日本旅客鉄道	88,900	5,836.00	518,820,400	
東海旅客鉄道	53,600	16,630.00	891,368,000	
西武ホールディングス	84,200	1,380.00	116,196,000	
鴻池運輸	11,900	1,581.00	18,813,900	
西日本鉄道	18,600	2,806.00	52,191,600	
ハマキョウレックス	5,500	3,425.00	18,837,500	
サカイ引越センター	3,300	4,595.00	15,163,500	貸付株式数 1,400株
近鉄グループHLDGS	69,400	4,900.00	340,060,000	
阪急阪神HLDGS	92,700	4,290.00	397,683,000	
南海電鉄	33,300	3,010.00	100,233,000	貸付株式数 11,500株
京阪ホールディングス	28,700	3,460.00	99,302,000	
神戸電鉄	2,000	3,235.00	6,470,000	貸付株式数 700株
名古屋鉄道	76,900	2,259.00	173,717,100	
山陽電鉄	5,300	2,235.00	11,845,500	貸付株式数 600株
アルプス物流	5,600	1,160.00	6,496,000	
トランコム	2,000	7,920.00	15,840,000	貸付株式数 500株
ヤマトホールディングス	88,900	2,293.00	203,847,700	
山 九	17,600	4,945.00	87,032,000	
日 新	5,300	2,034.00	10,780,200	
丸 運	3,600	222.00	799,200	貸付株式数 1,400株
丸全昭和運輸	4,300	3,220.00	13,846,000	貸付株式数 1,500株
センコーグループHLDGS	36,800	1,016.00	37,388,800	貸付株式数 3,500株
トナミホールディングス	1,500	3,650.00	5,475,000	
ニッコンホールディングス	22,200	2,419.00	53,701,800	
日石輸送	700	2,274.00	1,591,800	貸付株式数 200株
福山通運	5,800	3,500.00	20,300,000	
セイノーホールディングス	43,200	1,204.00	52,012,800	貸付株式数 16,300株
エスライン	2,000	823.00	1,646,000	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,000	3,365.00	6,730,000	貸付株式数 100株
日立物流	13,300	8,890.00	118,237,000	

A Z - C O M丸和ホール ディ	16,800	1,460.00	24,528,000	貸付株式数 5,000株 (2,400株)
C & F ロジホールディング ス	6,700	1,226.00	8,214,200	貸付株式数 800株
日本郵船	185,800	3,037.00	564,274,600	貸付株式数 74,300株
商船三井	122,400	3,365.00	411,876,000	貸付株式数 47,300株
川崎汽船	59,200	2,598.00	153,801,600	貸付株式数 20,000株
N S ユナイテッド海運	3,700	3,780.00	13,986,000	
明治海運	6,700	721.00	4,830,700	貸付株式数 3,000株
飯野海運	25,500	933.00	23,791,500	
共栄タンカー	1,300	950.00	1,235,000	貸付株式数 500株
九州旅客鉄道	49,200	3,025.00	148,830,000	
S G ホールディングス	133,300	2,130.00	283,929,000	
N I P P O N E X P R E S S	25,900	8,090.00	209,531,000	
日本航空	170,700	2,733.00	466,523,100	
A N A ホールディングス	189,100	2,944.50	556,804,950	
ビーウィズ	2,100	1,187.00	2,492,700	貸付株式数 800株 (300株)
パスコ	1,400	1,331.00	1,863,400	貸付株式数 400株
T R E ホールディングス	15,100	1,571.00	23,722,100	貸付株式数 4,600株
人・夢・技術グループ	3,200	2,106.00	6,739,200	貸付株式数 100株
西本W I S M E T T A C H D	1,900	3,700.00	7,030,000	貸付株式数 700株
シルバーライフ	1,700	1,557.00	2,646,900	貸付株式数 600株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	800	1,618.00	1,294,400	貸付株式数 200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	3,600	3,460.00	12,456,000	貸付株式数 1,400株
コア商事H L D G S	5,100	621.00	3,167,100	
K P P グループホールディ ン	17,200	972.00	16,718,400	貸付株式数 6,800株
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	1,100	860.00	946,000	貸付株式数 600株
ブックオフG H D	4,500	1,314.00	5,913,000	貸付株式数 1,800株
ギフトホールディングス	1,600	3,950.00	6,320,000	貸付株式数 400株
三菱倉庫	14,900	3,340.00	49,766,000	
三井倉庫H O L D	6,500	3,535.00	22,977,500	
住友倉庫	19,100	2,002.00	38,238,200	貸付株式数 7,600株
渋沢倉庫	2,800	2,078.00	5,818,400	貸付株式数 600株

ヤマタネ	3,300	1,696.00	5,596,800	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	9,200	257.00	2,364,400	貸付株式数	3,200株
乾汽船	8,800	1,827.00	16,077,600	貸付株式数	3,500株
日本トランスシティ	14,000	501.00	7,014,000		
ケイヒン	1,200	1,537.00	1,844,400		
中央倉庫	3,300	932.00	3,075,600	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,200	1,006.00	1,207,200	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,800	938.00	4,502,400		
ファイズホールディングス	1,300	999.00	1,298,700	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,283.00	2,566,000		
上組	34,500	2,799.00	96,565,500		
サンリツ	1,500	729.00	1,093,500		
キムラユニティー	3,300	778.00	2,567,400	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	4,200	1,033.00	4,338,600	貸付株式数	1,600株 (400株)
東海運	4,100	283.00	1,160,300	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,400	1,437.00	6,322,800	貸付株式数	1,600株
内外トランスライン	2,500	2,204.00	5,510,000	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,800	568.00	1,590,400	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,200	1,747.00	3,843,400	貸付株式数	700株
TBSホールディングス	35,800	1,568.00	56,134,400		
日本テレビHLD S	61,900	1,059.00	65,552,100		
朝日放送グループHD	6,700	622.00	4,167,400	貸付株式数	2,600株
テレビ朝日HD	17,100	1,371.00	23,444,100	貸付株式数	200株
スカパーJ S A T H D	61,800	508.00	31,394,400		
テレビ東京HD	5,000	1,841.00	9,205,000		
日本BS放送	2,500	917.00	2,292,500	貸付株式数	900株
ビジョン	9,200	1,377.00	12,668,400	貸付株式数	3,600株
スマートバリュー	1,700	470.00	799,000	貸付株式数	600株
USEN-NEXT H L D G S	6,300	2,351.00	14,811,300	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	3,200	280.00	896,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
コネクシオ	4,700	1,199.00	5,635,300		
日本通信	64,500	222.00	14,319,000	貸付株式数	24,600株
クロップス	1,100	1,113.00	1,224,300		
日本電信電話	894,000	3,820.00	3,415,080,000		
KDDI	539,100	4,111.00	2,216,240,100		
ソフトバンク	1,120,800	1,497.50	1,678,398,000		
光通信	8,200	19,170.00	157,194,000		

エムティーアイ	6,400	506.00	3,238,400	貸付株式数	1,400株
GMOインターネットグループ	25,900	2,535.00	65,656,500		
ファイバーゲート	3,700	940.00	3,478,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
アйдママーケティングコミュ	1,600	286.00	457,600	貸付株式数	600株
KADOKAWA	36,900	2,543.00	93,836,700		
学研ホールディングス	11,700	1,026.00	12,004,200	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	11,900	861.00	10,245,900	貸付株式数	100株
昭文社ホールディングス	3,000	294.00	882,000	貸付株式数	1,300株
インプレスホールディングス	6,200	214.00	1,326,800		
東京電力HD	627,300	499.00	313,022,700		
中部電力	256,400	1,288.00	330,243,200		
関西電力	268,600	1,166.00	313,187,600		
中国電力	111,000	715.00	79,365,000		
北陸電力	65,900	537.00	35,388,300		
東北電力	170,300	653.00	111,205,900		
四国電力	59,500	753.00	44,803,500		
九州電力	160,600	718.00	115,310,800		
北海道電力	67,300	454.00	30,554,200		
沖縄電力	16,300	1,054.00	17,180,200		
電源開発	52,400	2,118.00	110,983,200		
エフオン	5,100	548.00	2,794,800	貸付株式数	1,900株
イーレックス	12,400	2,522.00	31,272,800	貸付株式数	4,000株
レノバ	18,500	2,731.00	50,523,500	貸付株式数	7,400株
東京瓦斯	147,100	2,526.00	371,574,600		
大阪瓦斯	140,900	2,122.00	298,989,800		
東邦瓦斯	27,400	2,691.00	73,733,400		
北海道瓦斯	4,100	1,692.00	6,937,200	貸付株式数	1,400株
広島ガス	14,500	340.00	4,930,000		
西部ガスHLDGS	6,500	1,678.00	10,907,000	貸付株式数	600株
静岡ガス	15,800	1,100.00	17,380,000	貸付株式数	700株
メタウォーター	8,600	1,789.00	15,385,400		
アイネット	4,200	1,305.00	5,481,000		
松竹	4,000	11,900.00	47,600,000		
東宝	43,600	5,290.00	230,644,000		
エイチ・アイ・エス	18,700	2,015.00	37,680,500	貸付株式数	7,400株
東映	1,900	18,910.00	35,929,000		

ラックランド	2,200	2,959.00	6,509,800	貸付株式数	800株
N T Tデータ	218,800	2,102.00	459,917,600		
共立メンテナンス	12,200	6,100.00	74,420,000	貸付株式数	5,200株
イチネンホールディングス	7,500	1,252.00	9,390,000		
建設技術研究所	3,700	3,255.00	12,043,500		
スペース	5,100	890.00	4,539,000	貸付株式数	700株
アインホールディングス	10,100	6,730.00	67,973,000	貸付株式数	2,900株
燦ホールディングス	3,200	1,821.00	5,827,200		
ピー・シー・エー	4,200	1,282.00	5,384,400	貸付株式数	1,600株
スバル興業	500	9,070.00	4,535,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,600	1,141.00	2,966,600	貸付株式数	1,000株
タナベコンサルティング グル	2,700	662.00	1,787,400	貸付株式数	1,000株
ビジネスB太田昭和	3,000	1,951.00	5,853,000	貸付株式数	600株
ナガワ	1,900	7,660.00	14,554,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	6,000	4,030.00	24,180,000	貸付株式数	2,300株
常磐興産	2,500	1,199.00	2,997,500	貸付株式数	1,000株
カナモト	13,000	2,245.00	29,185,000		
D T S	15,300	3,295.00	50,413,500	貸付株式数	100株
スクウェア・エニックス・ H D	35,100	6,190.00	217,269,000		
シーイーシー	9,800	1,513.00	14,827,400		
カプコン	69,300	4,175.00	289,327,500		
西尾レントオール	6,600	3,090.00	20,394,000	貸付株式数	1,500株
アイ・エス・ビー	3,500	1,308.00	4,578,000	貸付株式数	1,200株
アゴーラ ホスピタリ ティーG	40,300	23.00	926,900	貸付株式数	15,600株
日本空港ビルデング	24,200	6,220.00	150,524,000	貸付株式数	10,300株
トランス・コスモス	8,900	3,235.00	28,791,500	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	31,200	1,032.00	32,198,400		
ジャステック	4,200	1,198.00	5,031,600	貸付株式数	1,600株
S C S K	56,900	2,202.00	125,293,800		
藤田観光	3,200	2,980.00	9,536,000	貸付株式数	1,000株
K N T - C Tホールディン グス	4,300	1,730.00	7,439,000	貸付株式数	1,600株
日本管財	7,500	2,542.00	19,065,000		
トーカイ	6,300	1,869.00	11,774,700	貸付株式数	100株
白洋舎	700	1,988.00	1,391,600	貸付株式数	300株
セコム	72,800	8,485.00	617,708,000		
N S W	2,700	2,170.00	5,859,000		

セントラル警備保障	3,900	2,439.00	9,512,100	貸付株式数	1,500株
アイネス	4,800	1,444.00	6,931,200	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,900	798.00	11,092,200		
メイテック	28,500	2,548.00	72,618,000		
T K C	12,500	3,735.00	46,687,500		
富士ソフト	7,900	8,140.00	64,306,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,000	2,096.00	14,672,000		
船井総研ホールディング	15,000	2,795.00	41,925,000	貸付株式数	4,800株
N S D	24,800	2,560.00	63,488,000		
進学会ホールディングス	2,600	305.00	793,000	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600	1,739.00	1,043,400	貸付株式数	200株
オ オ バ	4,500	681.00	3,064,500		
コナミグループ	29,900	6,450.00	192,855,000		
いであ	1,600	1,717.00	2,747,200	貸付株式数	600株
学 究 社	2,800	1,786.00	5,000,800		
ベネッセホールディングス	26,700	1,991.00	53,159,700		
イオンディライト	7,900	2,925.00	23,107,500		
ナック	3,000	932.00	2,796,000	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータH L D S	4,800	2,944.00	14,131,200	貸付株式数	1,400株
ダイセキ	14,600	4,700.00	68,620,000	貸付株式数	5,800株
ステップ	2,900	1,795.00	5,205,500	貸付株式数	200株
日鉄物産	5,000	5,100.00	25,500,000		
泉州電業	3,600	2,788.00	10,036,800	貸付株式数	1,400株
元気寿司	2,300	3,180.00	7,314,000	貸付株式数	900株
トラスコ中山	15,400	2,087.00	32,139,800		
ヤマダホールディングス	302,300	477.00	144,197,100		
オートバックスセブン	25,700	1,458.00	37,470,600	貸付株式数	9,300株
モリト	5,000	758.00	3,790,000		
アーケランズ	10,800	1,498.00	16,178,400		
ニトリホールディングス	29,800	15,565.00	463,837,000		
グルメ杵屋	6,100	997.00	6,081,700	貸付株式数	2,400株 (100株)
愛 眼	6,500	176.00	1,144,000	貸付株式数	2,700株
ケーユーホールディングス	4,300	1,300.00	5,590,000		
吉野家ホールディングス	28,800	2,321.00	66,844,800	貸付株式数	11,500株
加藤産業	9,000	3,495.00	31,455,000		
北恵	1,700	687.00	1,167,900	貸付株式数	500株
イノテック	4,600	1,302.00	5,989,200		
イエローハット	13,000	1,724.00	22,412,000	貸付株式数	4,600株
松屋フーズH L D G S	3,500	3,995.00	13,982,500	貸付株式数	1,200株

J B C Cホールディングス	5,000	1,959.00	9,795,000		
J Kホールディングス	5,800	1,042.00	6,043,600	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	11,900	1,221.00	14,529,900	貸付株式数	300株
日 伝	4,900	1,700.00	8,330,000	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	6,600	1,389.00	9,167,400	貸付株式数	2,500株
ミロク情報サービス	6,300	1,501.00	9,456,300	貸付株式数	700株
北沢産業	4,000	205.00	820,000	貸付株式数	700株
杉本商事	3,100	2,062.00	6,392,200	貸付株式数	1,200株
因幡電機産業	19,100	2,782.00	53,136,200		
王将フードサービス	4,900	6,060.00	29,694,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	1,000	2,637.00	2,637,000	貸付株式数	100株
ミニストップ	4,700	1,423.00	6,688,100	貸付株式数	2,000株
アークス	13,100	2,099.00	27,496,900	貸付株式数	5,100株
パローホールディングス	13,600	1,758.00	23,908,800		
東 テ ク	2,500	3,275.00	8,187,500		
ミスミグループ本社	111,000	3,350.00	371,850,000		
アルテック	3,800	314.00	1,193,200		
ベ ル ク	3,600	5,720.00	20,592,000	貸付株式数	700株
大 庄	4,100	1,061.00	4,350,100	貸付株式数	1,500株
タキヒヨー	1,700	900.00	1,530,000	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	11,000	80,810.00	888,910,000		
ソフトバンクグループ	403,400	5,952.00	2,401,036,800		
蔵王産業	900	1,773.00	1,595,700		
スズケン	26,900	3,695.00	99,395,500		
サンドラッグ	27,800	3,660.00	101,748,000		
サックスパーホールディング グ	7,100	800.00	5,680,000	貸付株式数	2,400株
ジェコス	4,700	803.00	3,774,100		
ヤマザワ	800	1,310.00	1,048,000	貸付株式数	600株
や ま や	1,700	2,476.00	4,209,200	貸付株式数	600株
グローセル	8,100	432.00	3,499,200	貸付株式数	3,000株
ベルーナ	17,800	689.00	12,264,200	貸付株式数	100株
合計			199,365,246,780		

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

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

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

貸付であります。

- (2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

- 第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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



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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,628,705	10,050,228
親投資信託受益証券	3,374,132,488	4,518,016,837
未収入金	120,000	5,970,000
流動資産合計	3,380,881,193	4,534,037,065
資産合計	3,380,881,193	4,534,037,065
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	724,525	7,933,243
未払受託者報酬	354,042	477,067
未払委託者報酬	5,045,793	6,798,965
その他未払費用	88,429	119,185
流動負債合計	6,212,789	15,328,460
負債合計	6,212,789	15,328,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,833,901,672	2,885,499,363
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,540,766,732	1,633,209,242
（分配準備積立金）	1,046,017,628	917,090,591
元本等合計	3,374,668,404	4,518,708,605
純資産合計	3,374,668,404	4,518,708,605
負債純資産合計	3,380,881,193	4,534,037,065

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日		自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		740,199,060		632,460,651
<b>営業収益合計</b>		<b>740,199,060</b>		<b>632,460,650</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,339		1,681
受託者報酬		708,036		868,235
委託者報酬		10,090,800		12,373,750
その他費用		176,849		216,904
<b>営業費用合計</b>		<b>10,977,024</b>		<b>13,460,570</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>729,222,036</b>		<b>645,921,220</b>
経常利益又は経常損失（ ）		729,222,036		645,921,220
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>729,222,036</b>		<b>645,921,220</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		129,604,024		43,402,419
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>1,071,242,345</b>		<b>1,540,766,732</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		329,583,165		936,135,752
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>329,583,165</b>		<b>936,135,752</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		459,676,790		241,174,441
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>459,676,790</b>		<b>241,174,441</b>
<b>分配金</b>		<b>1 -</b>		<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,540,766,732</b>		<b>1,633,209,242</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,298,185,009円	1,833,901,672円
期中追加設定元本額	503,558,139円	1,347,521,936円
期中一部解約元本額	967,841,476円	295,924,245円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,833,901,672口	2,885,499,363口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(599,618,174円)、投資信託約款に規定される収益調整金(494,750,295円)及び分配準備積立金(446,399,454円)より分配対象額は1,540,767,923円(1万口当たり8,401.58円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,264,103,722円)及び分配準備積立金(917,090,591円)より分配対象額は2,181,194,313円(1万口当たり7,559.16円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	640,660,755	617,918,234
合計	640,660,755	617,918,234

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.8402円	1.5660円
（1万口当たり純資産額）	（18,402円）	（15,660円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,785,354,002	4,518,016,837	
親投資信託受益証券 合計			4,518,016,837	
合計			4,518,016,837	

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

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	170,499,695	694,397,177
コール・ローン	2,022,467,907	2,058,655,210
株式	76,523,797,150	69,882,489,642

投資証券		1,902,993,076	1,729,033,392
派生商品評価勘定		835,409,584	4,349,312,599
未収入金		11,421,770	51,270,150
未収配当金		84,152,640	97,761,111
差入委託証拠金		748,621,975	862,069,568
流動資産合計		82,299,363,797	79,724,988,849
資産合計		82,299,363,797	79,724,988,849
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,294,015	3,443,341
未払金		10,922,729	-
未払解約金		3,240,000	5,970,010
その他未払費用		83,023	-
流動負債合計		23,539,767	9,413,351
負債合計		23,539,767	9,413,351
純資産の部			
元本等			
元本	1	27,761,727,263	31,500,797,366
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,514,096,767	48,214,778,132
元本等合計		82,275,824,030	79,715,575,498
純資産合計		82,275,824,030	79,715,575,498
負債純資産合計		82,299,363,797	79,724,988,849

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式



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

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	26,586,986,393円	27,761,727,263円
期中追加設定元本額	6,902,835,120円	9,104,226,092円
期中一部解約元本額	5,728,094,250円	5,365,155,989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）	21,329,154,782円	24,705,925,232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）	1,138,524,932円	1,785,354,002円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,553,864,915円	2,612,904,427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）	- 円	360,396円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	3,740,182,634円	2,396,253,309円
計	27,761,727,263円	31,500,797,366円
2. 期末日における受益権の総数	27,761,727,263口	31,500,797,366口

## （金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	11,446,405,422	10,531,418,378
投資証券	430,773,544	427,808,078
合計	11,877,178,966	10,959,226,456

（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1月13日から2021年11月30日まで、及び2022年1月12日から2022年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	2,988,965,000	-	3,055,897,771	66,932,771	3,645,757,877	-	3,818,076,756	172,318,879
合計	2,988,965,000	-	3,055,897,771	66,932,771	3,645,757,877	-	3,818,076,756	172,318,879

## （注） 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	80,196,929,768	-	79,437,746,970	759,182,798	75,961,729,804	-	71,788,179,425	4,173,550,379
アメリカ・ドル	58,645,426,218	-	58,488,051,926	157,374,292	56,558,293,764	-	52,959,745,956	3,598,547,808
イギリス・ポ ンド	3,518,705,343	-	3,421,709,496	96,995,847	3,310,054,105	-	3,229,608,000	80,446,105
イスラエル・ シケル	109,632,262	-	109,730,969	98,707	134,933,621	-	129,521,429	5,412,192
オーストラ リア・ドル	1,739,465,672	-	1,651,270,226	88,195,446	1,712,697,296	-	1,672,864,390	39,832,906
カナダ・ドル	2,859,792,381	-	2,773,108,499	86,683,882	2,875,368,542	-	2,697,102,633	178,265,909
シンガポ ール・ドル	259,144,977	-	255,038,606	4,106,371	319,658,561	-	308,021,437	11,637,124
スイス・フラン	2,382,488,912	-	2,357,165,145	25,323,767	2,192,550,294	-	2,150,646,187	41,904,107
スウェー デン・クロー ナ	957,236,295	-	904,038,764	53,197,531	795,606,838	-	776,354,024	19,252,814
デンマーク ・クローネ	681,739,696	-	664,199,386	17,540,310	644,710,638	-	631,256,357	13,454,281
ニュージ ーランド・ ドル	55,546,276	-	52,709,316	2,836,960	45,022,215	-	44,834,811	187,404
ノルウェ ー・クロー ネ	181,739,077	-	169,571,043	12,168,034	190,387,486	-	185,326,941	5,060,545
ユーロ	8,105,568,523	-	7,894,030,752	211,537,771	6,617,687,850	-	6,471,841,495	145,846,355
香港・ドル	700,444,136	-	697,122,842	3,321,294	564,758,594	-	531,055,765	33,702,829
合計	80,196,929,768	-	79,437,746,970	759,182,798	75,961,729,804	-	71,788,179,425	4,173,550,379

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,9636円 (29,636円)	2,5306円 (25,306円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	1,228	142.820	175,382.960	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,555	170.510	606,163.050	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,829	173.110	316,618.190	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	106.070	169,075.580	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	155.650	116,114.900	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,606	37.280	208,991.680	
	ABBOTT LABORATORIES	18,738	105.000	1,967,490.000	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	37.220	147,019.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,656	176.930	292,996.080	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,880	44.660	173,280.800	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,218	77.400	481,273.200	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	474	354.950	168,246.300	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,293	67.530	424,966.290		

QORVO INC	1,147	93.980	107,795.060	
AFLAC INC	6,622	70.880	469,367.360	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,357	144.960	196,710.720	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	70.210	128,835.350	
ADOBE INC	5,075	326.780	1,658,408.500	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,083	106.400	221,631.200	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,442	363.320	523,907.440	
GARMIN LTD	1,724	89.810	154,832.440	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,303	302.180	695,920.540	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,260	216.720	1,573,387.200	
WR BERKLEY CORP	2,312	75.040	173,492.480	
AUTOZONE INC	207	2,556.050	529,102.350	
DOLLAR TREE INC	2,312	146.500	338,708.000	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	8.670	107,204.550	
CELANESE CORP	1,211	105.550	127,821.050	
DR HORTON INC	3,601	84.220	303,276.220	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	30.210	74,014.500	
AUTODESK INC	2,253	195.180	439,740.540	
MOODY'S CORP	1,870	289.530	541,421.100	
DEVON ENERGY CORP	6,669	67.500	450,157.500	
ALBEMARLE CORP	1,233	270.020	332,934.660	
ATMOS ENERGY CORP	1,465	118.640	173,807.600	
ALLIANT ENERGY CORP	2,692	55.070	148,248.440	
CITIGROUP INC	20,903	47.570	994,355.710	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,483	257.060	1,152,399.980	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,681	94.650	537,706.650	
DOMINO'S PIZZA INC	407	383.060	155,905.420	
HESS CORP	2,881	141.980	409,044.380	
DAVITA INC	609	71.650	43,634.850	
DANAHER CORP	7,414	259.020	1,920,374.280	
FORTIVE CORP	3,433	65.600	225,204.800	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,840	105.340	615,185.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5,944	96.450	573,298.800	
BUNGE LTD	1,693	104.160	176,342.880	
TE CONNECTIVITY LTD	3,389	123.940	420,032.660	
APPLE INC	173,401	141.170	24,479,019.170	

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,919	108.550	316,857.450	
BOEING CO/THE	6,161	175.320	1,080,146.520	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,611	108.130	174,197.430	
BECTON DICKINSON AND CO	3,008	241.020	724,988.160	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	108.500	151,900.000	
NISOURCE INC	4,111	27.230	111,942.530	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	97.600	137,030.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,219	44.840	368,539.960	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	44,831	38.340	1,718,820.540	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	13,759	315.130	4,335,873.670	
ANSYS INC	956	240.630	230,042.280	
TRUIST FINANCIAL CORP	13,581	45.910	623,503.710	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	7,964	88.210	702,504.440	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,743	79.030	1,797,379.290	
JPMORGAN CHASE & CO	31,418	136.560	4,290,442.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,296	120.500	276,668.000	
LKQ CORP	2,916	52.930	154,343.880	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,384	71.120	240,670.080	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,883	163.520	471,428.160	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,148	324.480	372,503.040	
DOLLAR GENERAL CORP	2,405	252.850	608,104.250	
SERVICENOW INC	2,134	396.850	846,877.900	
CATERPILLAR INC	5,715	235.120	1,343,710.800	
BROWN & BROWN INC	2,446	57.360	140,302.560	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,558	47.050	120,353.900	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	239.500	137,473.000	
CMS ENERGY CORP	2,775	60.200	167,055.000	
MOSAIC CO/THE	3,841	50.730	194,853.930	
DELTA AIR LINES INC	75	34.610	2,595.750	
CORNING INC	8,106	33.410	270,821.460	
CISCO SYSTEMS INC	44,167	48.280	2,132,382.760	
MORGAN STANLEY	14,000	91.080	1,275,120.000	
MSCI INC	836	486.320	406,563.520	
FAIR ISAAC CORP	299	590.740	176,631.260	
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	260.830	122,590.100	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	51.630	154,786.740	
BROADCOM INC	4,295	521.390	2,239,370.050	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,360	204.790	278,514.400	



ARAMARK	2,858	40.570	115,949.060	
DTE ENERGY COMPANY	2,031	114.130	231,798.030	
CENTENE CORP	6,046	84.420	510,403.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,119	123.250	137,916.750	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,071	41.790	211,917.090	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,391	195.680	467,870.880	
GARTNER INC	869	340.080	295,529.520	
SPLUNK INC	1,921	75.890	145,784.690	
DOMINION ENERGY INC	8,959	59.770	535,479.430	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,095	99.790	408,640.050	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	60.490	84,686.000	
DEERE & CO	3,123	440.970	1,377,149.310	
QUANTA SERVICES INC	1,539	144.550	222,462.450	
POOL CORP	438	320.750	140,488.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,911	99.830	290,605.130	
VMWARE INC-CLASS A	2,382	118.030	281,147.460	
CABLE ONE INC	60	719.970	43,198.200	
BURLINGTON STORES INC	766	192.490	147,447.340	
NASDAQ INC	3,672	66.100	242,719.200	
VAIL RESORTS INC	448	256.300	114,822.400	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	6,360	7.430	47,254.800	
TARGA RESOURCES CORP	2,431	73.720	179,213.320	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	139.960	122,325.040	
WESTLAKE CORP	424	107.170	45,440.080	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,609	96.300	347,546.700	
COGNEX CORP	1,994	47.750	95,213.500	
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,200	53.400	117,480.000	
TELEFLEX INC	502	226.150	113,527.300	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	861	179.830	154,833.630	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	797	223.500	178,129.500	
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	399.550	96,291.550	
CATALENT INC	1,863	47.180	87,896.340	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,736	182.440	316,715.840	
MOLINA HEALTHCARE INC	610	322.720	196,859.200	
CARLISLE COS INC	600	255.530	153,318.000	
IDEX CORP	801	231.060	185,079.060	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,348	75.970	634,197.560	

ROLLINS INC	2,337	39.830	93,082.710	
AMETEK INC	2,360	139.010	328,063.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,412	79.490	191,729.880	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,454	54.790	79,664.660	
HEICO CORP	535	156.570	83,764.950	
GENERAC HOLDINGS INC	684	100.660	68,851.440	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	399	449.120	179,198.880	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,760	84.840	234,158.400	
TYLER TECHNOLOGIES INC	467	324.150	151,378.050	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,726	528.960	2,499,864.960	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	56.920	64,205.760	
EPAM SYSTEMS INC	624	343.940	214,618.560	
RPM INTERNATIONAL INC	1,457	101.670	148,133.190	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	288	1,552.720	447,183.360	
UGI CORP	2,907	37.840	110,000.880	
CUMMINS INC	1,522	246.420	375,051.240	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,143	74.340	605,350.620	
CDW CORP/DE	1,426	184.080	262,498.080	
SIGNATURE BANK	692	135.580	93,821.360	
COSTAR GROUP INC	4,957	78.250	387,885.250	
SVB FINANCIAL GROUP	582	219.130	127,533.660	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,140	292.070	332,959.800	
MERCADOLIBRE INC	551	889.260	489,982.260	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	778	185.900	144,630.200	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,889	138.750	400,848.750	
DEXCOM INC	4,456	110.390	491,897.840	
NORDSON CORP	547	230.800	126,247.600	
COPART INC	4,218	64.440	271,807.920	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,726	146.740	253,273.240	
SEAGEN INC	1,745	117.370	204,810.650	
ALIGN TECHNOLOGY INC	744	191.830	142,721.520	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	904	239.910	216,878.640	
TRANSDIGM GROUP INC	550	609.880	335,434.000	
BIO-TECHNE CORP	430	327.070	140,640.100	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,079	121.740	131,357.460	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,431	78.760	191,465.560	
KINDER MORGAN INC	22,051	18.880	416,322.880	

HCA HEALTHCARE INC	2,538	235.810	598,485.780
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	256.080	107,553.600
COTERRA ENERGY INC	8,637	28.070	242,440.590
T-MOBILE US INC	6,947	148.620	1,032,463.140
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	35.310	63,063.660
COCA-COLA CO/THE	44,373	62.480	2,772,425.040
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	51.570	132,792.750
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	113.560	218,603.000
FRANKLIN RESOURCES INC	3,373	26.300	88,709.900
CSX CORP	22,882	32.170	736,113.940
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,001	239.780	240,019.780
EXPEDIA GROUP INC	1,563	102.450	160,129.350
AMAZON.COM INC	98,068	92.420	9,063,444.560
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,517	74.850	487,797.450
EXXON MOBIL CORP	44,997	110.540	4,973,968.380
AES CORP	7,037	28.260	198,865.620
EVEREST RE GROUP LTD	376	332.800	125,132.800
EOG RESOURCES INC	6,171	141.290	871,900.590
EQT CORP	3,828	42.660	163,302.480
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,676	91.030	152,566.280
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	799.620	107,149.080
ABIOMED INC	512	377.330	193,192.960
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,634	167.900	274,348.600
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,202	150.940	483,309.880
FORD MOTOR CO	43,756	13.750	601,645.000
EXACT SCIENCES CORP	1,959	41.190	80,691.210
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	19.720	47,643.520
ENTEGRIS INC	1,893	72.390	137,034.270
AERCAP HOLDINGS NV	1,700	60.240	102,408.000
FORTINET INC	7,013	51.590	361,800.670
MARKEL CORP	140	1,290.610	180,685.400
NEXTERA ENERGY INC	20,933	82.490	1,726,763.170
MASIMO CORP	623	140.650	87,624.950
FREEMPORT-MCMORAN INC	15,206	37.510	570,377.060
INSULET CORP	769	288.560	221,902.640
US BANCORP	14,904	44.590	664,569.360
UNITED RENTALS INC	849	342.730	290,977.770

F5 NETWORKS INC	659	149.820	98,731.380	
FASTENAL CO	5,941	50.270	298,654.070	
FISERV INC	6,531	101.520	663,027.120	
GENERAL ELECTRIC CO	11,567	85.660	990,829.220	
GENERAL MOTORS CO	14,483	39.750	575,699.250	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,500	251.220	628,050.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,615	383.710	1,387,111.650	
ALPHABET INC-CL A	63,962	95.190	6,088,542.780	
ALPHABET INC-CL C	60,377	95.440	5,762,380.880	
OWENS CORNING	1,083	89.630	97,069.290	
GENERAL MILLS INC	6,857	82.840	568,033.880	
FIRSTENERGY CORP	5,840	39.800	232,432.000	
GENUINE PARTS CO	1,539	180.550	277,866.450	
FIFTH THIRD BANCORP	7,230	36.000	260,280.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,022	225.610	456,183.420	
HALLIBURTON CO	10,652	37.160	395,828.320	
HOME DEPOT INC	10,944	315.960	3,457,866.240	
ASSURANT INC	532	126.390	67,239.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	15,352	15.300	234,885.600	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	431	228.020	98,276.620	
HERSHEY CO/THE	1,664	230.490	383,535.360	
HUMANA INC	1,334	533.140	711,208.760	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,723	164.690	448,450.870	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	35.090	32,177.530	
HENRY SCHEIN INC	1,491	80.600	120,174.600	
HP INC	10,699	28.880	308,987.120	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,115	15.460	218,217.900	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	681	42.890	29,208.090	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	2,262	59.140	133,774.680	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	43.070	87,345.960	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,274	58.980	252,080.520	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,629	39.040	297,836.160	
ENPHASE ENERGY INC	1,507	303.390	457,208.730	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,621	146.490	1,409,380.290	
INTERNATIONAL PAPER CO	3,457	36.330	125,592.810	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	65.740	98,610.000	
ZOETIS INC	4,996	147.850	738,658.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,456	174.990	429,775.440	
CHENIERE ENERGY INC	2,818	172.650	486,527.700	
ALLEGION PLC	942	110.770	104,345.340	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	2,912	20.460	59,579.520	
WASTE CONNECTIONS INC	3,014	140.820	424,431.480	
JUNIPER NETWORKS INC	3,530	31.870	112,501.100	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	151.520	185,612.000	
JOHNSON & JOHNSON	28,028	176.090	4,935,450.520	
PLUG POWER INC	6,251	14.900	93,139.900	
ABBVIE INC	18,941	158.200	2,996,466.200	
HOLOGIC INC	2,613	74.370	194,328.810	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,806	133.160	506,806.960	
KROGER CO	7,265	49.350	358,527.750	
KLA CORP	1,548	374.330	579,462.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,556	484.100	1,237,359.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	840	190.200	159,768.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	39.790	114,276.880	
LOWE'S COS INC	6,788	207.470	1,408,306.360	
ELI LILLY & CO	8,663	363.950	3,152,898.850	
LAM RESEARCH CORP	1,450	442.050	640,972.500	
LOEWS CORP	2,228	57.780	128,733.840	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,741	38.090	66,314.690	
MCDONALD'S CORP	7,902	271.410	2,144,681.820	
3M CO	5,924	126.130	747,194.120	
META PLATFORMS INC CLASS A	24,466	109.460	2,678,048.360	
S&P GLOBAL INC	3,716	347.140	1,289,972.240	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	357.540	269,942.700	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	575	290.850	167,238.750	
ALCOA CORP	2,093	47.700	99,836.100	
PHILLIPS 66	4,982	108.970	542,888.540	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,867	35.860	138,670.620	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,663	83.750	223,026.250	
METLIFE INC	7,575	76.070	576,230.250	
MARVELL TECHNOLOGY INC	10,239	42.910	439,355.490	
ARISTA NETWORKS INC	2,545	133.710	340,291.950	

MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,754	264.460	463,862.840	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	241	1,412.210	340,342.610	
BAKER HUGHES CO	10,110	28.650	289,651.500	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,253	259.630	325,316.390	
MERCK & CO. INC.	27,005	108.840	2,939,224.200	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,561	69.460	386,267.060	
MASCO CORP	2,541	49.870	126,719.670	
M & T BANK CORP	1,827	170.920	312,270.840	
MARSH & MCLENNAN COS	5,287	168.680	891,811.160	
BLACK KNIGHT INC	1,644	60.750	99,873.000	
HEICO CORP-CLASS A	754	122.430	92,312.220	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,886	161.260	465,396.360	
WORKDAY INC-CLASS A	2,448	143.300	350,798.400	
WAYFAIR INC- CLASS A	880	31.670	27,869.600	
BLOCK INC CLASS A	6,304	62.110	391,541.440	
TRANSUNION	2,557	60.460	154,596.220	
VISTRA CORP	4,057	24.230	98,301.110	
NOVOCURE LTD	1,054	74.680	78,712.720	
NETAPP INC	2,370	71.790	170,142.300	
NIKE INC -CL B	13,548	106.250	1,439,475.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,507	253.360	635,173.520	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,673	74.220	421,050.060	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,012	115.370	232,124.440	
ALLY FINANCIAL INC	3,709	26.510	98,325.590	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,577	528.350	833,207.950	
APTIV PLC	3,176	101.880	323,570.880	
NEWMONT CORP	8,148	45.760	372,852.480	
MCKESSON CORP	1,555	381.780	593,667.900	
XYLEM INC	1,972	109.880	216,683.360	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,616	97.790	1,624,878.640	
NUCOR CORP	2,725	146.990	400,547.750	
WESTERN UNION CO	4,350	14.470	62,944.500	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	75.070	144,885.100	
NEWELL BRANDS INC	4,058	12.870	52,226.460	
EVERGY INC	2,317	58.070	134,548.190	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,415	69.110	719,780.650	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	269.240	72,425.560	

OKTA INC	1,995	51.250	102,243.750
COUPA SOFTWARE INC	880	61.460	54,084.800
LIBERTY BROADBAND-C	1,312	89.430	117,332.160
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	12.250	59,743.250
LINDE PLC	4,761	331.970	1,580,509.170
WIX.COM LTD	785	84.550	66,371.750
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,293	30.840	132,396.120
KKR & CO INC	6,886	50.550	348,087.300
PAYCHEX INC	3,473	120.150	417,280.950
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	693	849.730	588,862.890
ALTRIA GROUP INC	19,293	45.820	884,005.260
P G & E CORP	16,482	15.170	250,031.940
PFIZER INC	59,953	49.490	2,967,073.970
CIGNA CORP	3,379	320.700	1,083,645.300
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	43.520	142,571.520
XCEL ENERGY INC	5,534	68.850	381,015.900
STERIS PLC	1,054	178.390	188,023.060
SEA LTD-ADR	4,100	54.260	222,466.000
FOX CORP - CLASS B	1,530	29.940	45,808.200
FOX CORP - CLASS A	3,495	31.720	110,861.400
STRYKER CORP	3,593	227.200	816,329.600
LYFT INC-A	3,191	10.760	34,335.160
DOW INC	7,617	50.650	385,801.050
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,130	58.530	66,138.900
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,751	70.570	194,138.070
PARKER HANNIFIN CORP	1,319	294.290	388,168.510
UBER TECHNOLOGIES INC	17,823	27.760	494,766.480
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,401	240.780	578,112.780
PROCTER & GAMBLE CO/THE	25,635	145.480	3,729,379.800
EXELON CORP	11,097	40.000	443,880.000
TELADOC HEALTH INC	2,575	27.130	69,859.750
INGERSOLL-RAND INC	4,003	52.820	211,438.460
NVR INC	33	4,557.920	150,411.360
CONOCOPHILLIPS	13,826	124.250	1,717,880.500
TWILIO INC - A	2,053	45.750	93,924.750
DOCUSIGN INC	2,333	44.560	103,958.480
PAYCOM SOFTWARE INC	550	321.980	177,089.000

CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	64.110	94,241.700	
PEPSICO INC	14,792	182.590	2,700,871.280	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	150.890	61,714.010	
DROPBOX INC-CLASS A	2,950	22.540	66,493.000	
MONGODB INC	821	142.300	116,828.300	
SNAP INC - A	12,910	9.820	126,776.200	
CORTEVA INC	7,674	65.570	503,184.180	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,084	106.590	435,313.560	
AMCOR PLC	15,231	12.110	184,447.410	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,406	138.000	332,028.000	
ROKU INC	1,417	54.180	76,773.060	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,910	147.140	281,037.400	
ACCENTURE PLC-CL A	6,786	287.980	1,954,232.280	
PENTAIR PLC	1,348	44.680	60,228.640	
QUALCOMM INC	11,908	118.380	1,409,669.040	
INVESCO LTD	3,700	18.840	69,708.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	664	147.930	98,225.520	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,895	89.840	260,086.800	
DATADOG INC - CLASS A	2,587	72.060	186,419.220	
PINTEREST INC- CLASS A	6,763	24.000	162,312.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,128	736.080	830,298.240	
REPUBLIC SERVICES INC	2,344	136.650	320,307.600	
BOOKING HOLDINGS INC	433	2,017.160	873,430.280	
ROSS STORES INC	3,750	116.790	437,962.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	132.690	132,424.620	
RESMED INC	1,482	223.200	330,782.400	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	149.010	197,736.270	
ROBERT HALF INTL INC	1,209	76.210	92,137.890	
MODERNA INC	3,538	173.150	612,604.700	
HUBSPOT INC	518	282.680	146,428.240	
PERKINELMER INC	1,230	133.650	164,389.500	
CARRIER GLOBAL CORP	8,939	43.520	389,025.280	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,520	76.880	347,497.600	
BILL.COM HOLDINGS INC	1,159	114.670	132,902.530	
AVANTOR INC	6,686	21.310	142,478.660	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,773	29.880	82,857.240	
DYNATRACE INC	2,339	36.390	85,116.210	



TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,191	48.690	252,749.790	
REGIONS FINANCIAL CORP	9,916	22.910	227,175.560	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	2,996	26.530	79,483.880	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,176	43.070	179,860.320	
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	48.590	49,610.390	
MATCH GROUP INC	3,049	46.880	142,937.120	
CHEVRON CORP	19,818	181.030	3,587,652.540	
ZSCALER INC	985	134.850	132,827.250	
EDISON INTERNATIONAL	4,460	63.510	283,254.600	
ETSY INC	1,409	121.880	171,728.920	
TESLA INC	28,303	180.830	5,118,031.490	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,502	136.560	341,673.120	
GEN DIGITAL INC	6,272	22.620	141,872.640	
UNITY SOFTWARE INC	2,239	36.020	80,648.780	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,745	80.510	140,489.950	
SYNOPSYS INC	1,714	323.660	554,753.240	
CHEWY INC - CLASS A	856	40.200	34,411.200	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,925	44.610	130,484.250	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	1,239	385.280	477,361.920	
VIATRIS INC	12,623	11.180	141,125.140	
DOORDASH INC - A	2,139	53.340	114,094.260	
ROBLOX CORP -CLASS A	3,970	29.830	118,425.100	
AIRBNB INC-CLASS A	4,053	95.380	386,575.140	
CBRE GROUP INC - A	3,379	76.460	258,358.340	
SOUTHERN CO/THE	11,652	65.730	765,885.960	
SYSCO CORP	5,663	85.090	481,864.670	
TRAVELERS COS INC/THE	2,519	187.210	471,581.990	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	58.500	35,100.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,011	61.380	62,055.180	
STEEL DYNAMICS INC	2,156	102.640	221,291.840	
SCHLUMBERGER LTD	14,879	51.050	759,572.950	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,749	44.000	76,956.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	2,035	12.810	26,068.350	
AT&T INC	76,332	19.010	1,451,071.320	
APA CORP	3,632	46.590	169,214.880	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,008	39.250	39,564.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	4,963	70.720	350,983.360	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,388	48.870	116,701.560	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,578	241.570	622,767.460	
SEMPRA ENERGY	3,285	161.320	529,936.200	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	37.500	84,900.000	
CLARIVATE PLC	3,377	9.170	30,967.090	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	18,593	7.080	131,638.440	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,240	51.450	115,248.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,335	43.110	57,551.850	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9,769	172.980	1,689,841.620	
SALESFORCE.COM INC	10,661	151.680	1,617,060.480	
WESTROCK CO	2,754	36.720	101,126.880	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,086	65.850	334,913.100	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,377	65.400	482,455.800	
TERADYNE INC	1,718	89.190	153,228.420	
UNION PACIFIC CORP	6,744	212.770	1,434,920.880	
MARATHON OIL CORP	7,622	30.350	231,327.700	
MARATHON PETROLEUM CORP	5,769	123.470	712,298.430	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	15,835	97.430	1,542,804.050	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,853	184.890	1,451,941.170	
IQVIA HOLDINGS INC	1,961	212.500	416,712.500	
AMEREN CORPORATION	2,690	87.240	234,675.600	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,990	528.000	5,274,720.000	
APPLOVIN CORP CLASS A	1,362	13.440	18,305.280	
VERISIGN INC	1,080	194.960	210,556.800	
LUCID GROUP INC	5,100	9.760	49,776.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	2,200	28.850	63,470.000	
VALERO ENERGY CORP	4,255	135.200	575,276.000	
ULTA BEAUTY INC	540	449.880	242,935.200	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	39.570	119,026.560	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	130.550	100,131.850	
ELEVANCE HEALTH INC	2,574	515.360	1,326,536.640	
WALT DISNEY CO/THE	19,421	94.690	1,838,974.490	
WELLS FARGO & CO	40,644	47.570	1,933,435.080	
WASTE MANAGEMENT INC	4,600	165.080	759,368.000	
WILLIAMS COS INC	12,870	34.320	441,698.400	

TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,190	219.010	260,621.900	
WHIRLPOOL CORP	636	145.980	92,843.280	
WALMART INC	16,256	152.970	2,486,680.320	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,226	119.000	264,894.000	
WYNN RESORTS LTD	1,145	80.290	91,932.050	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	13,900	2.830	39,337.000	
WABTEC CORP	1,898	98.700	187,332.600	
TJX COMPANIES INC	12,480	80.160	1,000,396.800	
WATERS CORP	651	330.160	214,934.160	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	571	266.820	152,354.220	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,793	41.080	320,136.440	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,184	238.500	282,384.000	
WESTERN DIGITAL CORP	3,264	36.030	117,601.920	
WEC ENERGY GROUP INC	3,366	96.980	326,434.680	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,350	58.290	311,851.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	17,542	209.060	3,667,330.520	
PPL CORP	7,299	29.020	211,816.980	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	3,460	94.430	326,727.800	
PULTEGROUP INC	2,592	44.090	114,281.280	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	25,542	11.140	284,537.880	
PPG INDUSTRIES INC	2,415	131.830	318,369.450	
NORTHERN TRUST CORP	2,131	91.760	195,540.560	
NVIDIA CORP	26,707	156.390	4,176,707.730	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,406	164.370	724,214.220	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	940	21.420	20,134.800	
TYSON FOODS INC-CL A	2,886	66.450	191,774.700	
NETFLIX INC	4,746	280.960	1,333,436.160	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,193	539.750	2,263,171.750	
NRG ENERGY INC	2,411	41.910	101,045.010	
GLOBE LIFE INC	1,011	117.300	118,590.300	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,041	121.570	248,124.370	
TEXTRON INC	2,388	70.330	167,948.040	

NEWS CORP - CLASS A	3,749	18.560	69,581.440	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	70	2,506.380	175,446.600	
OMNICOM GROUP	2,311	78.760	182,014.360	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,361	122.770	167,089.970	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	6,360	1.050	6,678.000	
ORACLE CORP	17,190	80.850	1,389,811.500	
MASTERCARD INC - A	9,278	343.130	3,183,560.140	
ONEOK INC	4,773	64.910	309,815.430	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	10,299	5.470	56,335.530	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,098	425.250	466,924.500	
AMERCO NON VOTING SERIES N	882	60.180	53,078.760	
YUM! BRANDS INC	3,035	126.040	382,531.400	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,715	101.350	173,815.250	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,961	54.920	107,698.120	
BANK OF AMERICA CORP	77,923	37.000	2,883,151.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	487	408.780	199,075.860	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,120	97.120	205,894.400	
AMERICAN EXPRESS CO	6,903	154.420	1,065,961.260	
ANALOG DEVICES INC	5,435	163.890	890,742.150	
ADVANCED MICRO DEVICES	17,292	73.390	1,269,059.880	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,374	61.440	514,498.560	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,734	90.270	156,528.180	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,609	59.930	156,357.370	
AVERY DENNISON CORP	869	188.420	163,736.980	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,492	59.620	327,433.040	
EMERSON ELECTRIC CO	6,080	94.310	573,404.800	
AON PLC-CLASS A	2,251	302.730	681,445.230	
AMGEN INC	5,762	281.990	1,624,826.380	
EATON CORP PLC	4,157	162.150	674,057.550	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,701	253.640	431,441.640	
APPLIED MATERIALS INC	9,287	103.250	958,882.750	
CME GROUP INC	3,783	174.810	661,306.230	
ECOLAB INC	2,675	144.910	387,634.250	
EQUIFAX INC	1,219	188.920	230,293.480	
GILEAD SCIENCES INC	13,352	85.760	1,145,067.520	

KEURIG DR PEPPER INC	8,423	38.100	320,916.300	
HORMEL FOODS CORP	2,415	48.190	116,378.850	
STATE STREET CORP	3,917	73.930	289,583.810	
SCHWAB (CHARLES) CORP	15,435	80.390	1,240,819.650	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,180	55.340	286,661.200	
CAMPBELL SOUP CO	1,302	52.620	68,511.240	
CROWN HOLDINGS INC	1,392	80.230	111,680.160	
CARDINAL HEALTH INC	2,973	78.650	233,826.450	
FEDEX CORP	2,550	177.820	453,441.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,052	102.080	413,628.160	
FMC CORP	1,360	127.710	173,685.600	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,662	102.400	272,588.800	
INTEL CORP	43,592	28.900	1,259,808.800	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,318	34.310	148,150.580	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,556	75.830	269,651.480	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,304	224.370	741,318.480	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,227	6.410	65,555.070	
ILLUMINA INC	1,689	208.570	352,274.730	
SEALED AIR CORP	1,450	52.030	75,443.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,788	258.800	980,334.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,239	131.030	162,346.170	
SNAP-ON INC	623	239.180	149,009.140	
CARMAX INC	1,749	67.120	117,392.880	
DUKE ENERGY CORP	7,998	97.940	783,324.120	
TARGET CORP	4,960	166.370	825,195.200	
DOVER CORP	1,526	139.370	212,678.620	
WW GRAINGER INC	541	590.990	319,725.590	
CINTAS CORP	964	450.690	434,465.160	
CONAGRA BRANDS INC	4,972	36.960	183,765.120	
CLOROX COMPANY	1,313	147.430	193,575.590	
ENTERGY CORP	2,110	112.810	238,029.100	
MICROSOFT CORP	76,066	240.330	18,280,941.780	
INCYTE CORP	2,006	77.800	156,066.800	
CVS HEALTH CORP	13,986	100.880	1,410,907.680	
MEDTRONIC PLC	14,207	76.480	1,086,551.360	
MICRON TECHNOLOGY INC	11,624	55.120	640,714.880	
BLACKROCK INC	1,626	714.000	1,160,964.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,606	30.580	202,011.480	

HASBRO INC	1,348	62.170	83,805.160	
KELLOGG CO	2,153	72.400	155,877.200	
KEYCORP	9,940	18.570	184,585.800	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	14,577	66.050	962,810.850	
COOPER COS INC/THE	471	307.440	144,804.240	
CHUBB LTD	4,488	216.680	972,459.840	
ARROW ELECTRONICS INC	737	106.230	78,291.510	
ALLSTATE CORP	2,938	133.380	391,870.440	
EBAY INC	6,211	43.770	271,855.470	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,753	77.640	912,502.920	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,392	85.250	118,668.000	
DISH NETWORK CORP-A	2,984	15.680	46,789.120	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,399	214.940	515,641.060	
TRIMBLE INC	2,636	56.390	148,644.040	
LENNAR CORP-A	2,744	86.400	237,081.600	
LEAR CORP	828	140.150	116,044.200	
PROGRESSIVE CORP	6,179	131.120	810,190.480	
PACCAR INC	3,595	104.260	374,814.700	
BIOGEN INC	1,578	291.410	459,844.980	
IDEXX LABORATORIES INC	894	408.960	365,610.240	
STARBUCKS CORP	12,336	98.660	1,217,069.760	
PTC INC	1,200	123.070	147,684.000	
EVERSOURCE ENERGY	3,492	80.650	281,629.800	
INTUIT INC	2,873	379.710	1,090,906.830	
BORGWARNER INC	2,741	41.930	114,930.130	
BEST BUY CO INC	2,316	84.160	194,914.560	
BALL CORP	3,359	54.740	183,871.660	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,912	44.500	708,084.000	
ELECTRONIC ARTS INC	2,902	127.590	370,266.180	
VULCAN MATERIALS CO	1,425	178.450	254,291.250	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,831	316.330	895,530.230	
VF CORP	3,212	32.460	104,261.520	
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	6,779	19.750	133,885.250	
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	100.940	56,930.160	
CARNIVAL CORP	9,986	9.750	97,363.500	
CLEVELAND-CLIFFS INC	7,674	15.140	116,184.360	
COMCAST CORP-CLASS A	47,399	35.480	1,681,716.520	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	48.600	92,340.000	

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	3.980	52,138.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 366,020,868.240 (50,829,317,972)	
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	24.005	1,937,827.630	
	HALEON PLC	54,552	2.853	155,664.130	
	BP PLC	210,312	4.920	1,034,840.190	
	UNILEVER PLC	27,806	41.245	1,146,858.470	
	BARCLAYS PLC	174,358	1.610	280,716.380	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	91,245	0.891	81,317.540	
	PRUDENTIAL PLC	29,590	9.648	285,484.320	
	NATWEST GROUP PLC	56,020	2.605	145,932.100	
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,080	21.370	65,819.600	
	BAE SYSTEMS PLC	34,216	8.104	277,286.460	
	AVIVA PLC	31,964	4.486	143,390.500	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	31.760	36,206.400	
	GSK	43,436	14.178	615,835.600	
	INFORMA PLC	16,200	6.104	98,884.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,776	1.314	58,858.050	
	AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	5.648	59,795.370	
	DCC PLC	726	44.750	32,488.500	
	OCADO GROUP PLC	5,149	6.170	31,769.330	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	112.100	82,954.000	
	HALMA PLC	3,978	21.280	84,651.840	
	ENTAIN PLC	5,823	13.975	81,376.420	
	JD SPORTS FASHION PLC	21,808	1.244	27,140.050	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	6,857	5.960	40,867.720	
	M&G PLC	25,964	1.922	49,915.790	
	RELX PLC	20,392	22.900	466,976.800	
	DIAGEO PLC	24,819	37.680	935,179.920	
	RIO TINTO PLC	11,928	55.630	663,554.640	
	STANDARD CHARTERED PLC	27,461	6.090	167,237.490	
	TESCO PLC	80,477	2.330	187,511.410	
	SMITH & NEPHEW PLC	9,237	10.780	99,574.860	
	GLENCORE PLC	102,863	5.508	566,569.400	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	8.506	27,219.200	
	SMITHS GROUP PLC	4,080	15.960	65,116.800	

PEARSON PLC	8,271	9.840	81,386.640	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.231	39,334.760	
NEXT PLC	1,456	57.400	83,574.400	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.021	32,912.950	
WHITBREAD PLC	1,547	25.860	40,005.420	
BUNZL PLC	3,703	30.660	113,533.980	
VODAFONE GROUP PLC	309,588	0.918	284,325.610	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,409	67.120	94,572.080	
KINGFISHER PLC	24,703	2.408	59,484.820	
WPP PLC	13,021	8.684	113,074.360	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.260	84,583.440	
SEVERN TRENT PLC	2,681	27.140	72,762.340	
RENTOKIL INITIAL PLC	19,857	5.356	106,354.090	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,092	59.400	480,664.800	
ST JAMES'S PLACE PLC	3,999	11.535	46,128.460	
SCHRODERS PLC	7,217	4.508	32,534.230	
SSE PLC	11,927	16.760	199,896.520	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	3.981	49,237.000	
ASTRAZENECA PLC	16,906	110.600	1,869,803.600	
FERGUSON PLC	2,396	94.900	227,380.400	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.544	173,582.200	
3I GROUP PLC	8,367	13.405	112,159.630	
ASHTED GROUP PLC	4,635	49.910	231,332.850	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	7.860	90,767.280	
NATIONAL GRID PLC	41,545	10.085	418,981.320	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	740,947	0.463	343,243.690	
IMPERIAL BRANDS PLC	9,822	21.230	208,521.060	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,155	37.830	43,693.650	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	23,330	33.505	781,671.650	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,483	15.850	55,205.550	
HSBC HOLDINGS PLC	219,262	5.103	1,118,893.980	
ANGLO AMERICAN PLC	13,276	32.895	436,714.020	
MONDI PLC	5,248	15.560	81,658.880	
COMPASS GROUP PLC	20,336	18.305	372,250.480	
PERSIMMON PLC	3,969	12.700	50,406.300	
BT GROUP PLC	75,578	1.228	92,847.570	



	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	20.180	51,943.320	
	BURBERRY GROUP PLC	4,508	21.400	96,471.200	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,078	47.450	98,601.100	
	INTERTEK GROUP PLC	1,713	39.440	67,560.720	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,381	80.440	271,967.640	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	14.965	30,513.630	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	20.270	31,823.900	
	ANTOFAGASTA PLC	6,056	13.640	82,603.840	
	ABRDN PLC	27,775	2.052	56,994.300	
	EXPERIAN PLC	9,546	28.690	273,874.740	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 19,820,656.110 (3,294,787,665)	
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	20.450	293,150.750	
	AZRIELI GROUP LTD	530	243.000	128,790.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,279	151.500	193,768.500	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	24,000	6.255	150,120.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	28.580	237,042.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	578.400	173,520.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	32.990	500,128.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	16,751	31.480	527,321.480	
	NICE LTD	742	650.900	482,967.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	126.900	238,952.700	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 2,925,762.150 (118,007,690)	
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	4.560	108,195.120	
	TELSTRA GROUP LTD	42,351	4.000	169,404.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,136	2.910	87,695.760	
	BHP GROUP LTD	55,761	44.820	2,499,208.020	
	SOUTH32 LTD	48,803	4.070	198,628.210	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	21,927	36.830	807,571.410	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	18,391	19.460	357,888.860	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,612	31.690	1,096,854.280	

WESTPAC BANKING CORP	37,244	23.830	887,524.520	
SANTOS LTD	33,160	7.330	243,062.800	
AUST AND NZ BANKING GROUP	32,365	24.910	806,212.150	
RIO TINTO LTD	4,000	107.830	431,320.000	
ORIGIN ENERGY LTD	18,280	7.970	145,691.600	
AURIZON HOLDINGS LTD	19,619	3.740	73,375.060	
XERO LTD	1,426	69.500	99,107.000	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	27.890	76,641.720	
COLES GROUP LTD	16,386	17.060	279,545.160	
WISETECH GLOBAL LTD	1,645	55.570	91,412.650	
IDP EDUCATION LTD	2,088	29.450	61,491.600	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	10,716	10.540	112,946.640	
EVOLUTION MINING LTD	17,017	2.670	45,435.390	
REECE LTD	2,322	15.500	35,991.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	7.040	97,898.240	
SEEK LTD	4,813	22.230	106,992.990	
TREASURY WINE ESTATES LTD	8,616	13.660	117,694.560	
NEWCREST MINING LTD	9,662	19.630	189,665.060	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,705	108.090	2,021,823.450	
AMPOL LTD	1,538	28.510	43,848.380	
ORICA LTD	4,783	14.970	71,601.510	
QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	12.960	198,910.080	
WOOLWORTHS GROUP LTD	14,042	34.990	491,329.580	
QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	6.190	39,448.870	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,796	29.400	141,002.400	
MACQUARIE GROUP LTD	4,004	178.000	712,712.000	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,462	35.450	229,077.900	
CSL LTD	5,288	302.580	1,600,043.040	
WESFARMERS LTD	11,899	48.360	575,435.640	
COCHLEAR LTD	697	211.420	147,359.740	
BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	17.110	85,960.640	
SUNCORP GROUP LTD	14,504	12.000	174,048.000	
ASX LTD	2,260	69.330	156,685.800	
COMPUTERSHARE LTD	6,054	27.660	167,453.640	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	4.800	130,065.600	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	31.680	165,464.640	

	BRAMBLES LTD	15,068	12.020	181,117.360	
	MINERAL RESOURCES LTD	1,881	83.770	157,571.370	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	65.440	135,068.160	
	REA GROUP LTD	608	122.750	74,632.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	760	65.600	49,856.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 16,977,969.600 (1,575,385,799)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,054	61.250	554,557.500	
	IMPERIAL OIL LTD	3,068	77.980	239,242.640	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	237	2,109.030	499,840.110	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,136	88.290	276,877.440	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,069	51.260	259,836.940	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,835	199.300	365,715.500	
	BCE INC	668	64.010	42,758.680	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,414	192.780	465,370.920	
	SUNCOR ENERGY INC	15,253	45.430	692,943.790	
	METRO INC/CN	2,379	77.850	185,205.150	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,599	98.420	354,213.580	
	BANK OF NOVA SCOTIA	13,165	69.670	917,205.550	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	9,656	64.190	619,818.640	
	TORONTO-DOMINION BANK	20,072	89.590	1,798,250.480	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	3,335	32.040	106,853.400	
	ROYAL BANK OF CANADA	15,608	133.770	2,087,882.160	
	TOURMALINE OIL CORP	3,656	81.100	296,501.600	
	TC ENERGY CORP	10,639	61.260	651,745.140	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,048	48.320	292,239.360	
	BARRICK GOLD CORP	19,119	21.580	412,588.020	
	CAE INC	3,752	28.700	107,682.400	
	THOMSON REUTERS CORP	1,968	154.200	303,465.600	
	EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	36.580	65,844.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	108.190	68,267.890	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	64.230	100,198.800	
	HYDRO ONE LTD	2,408	36.610	88,156.880	
	LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	121.260	225,664.860	
	NORTHLAND POWER INC	2,632	37.640	99,068.480	

WSP GLOBAL INC	1,345	160.150	215,401.750	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	101.810	99,162.940	
PARKLAND CORP	1,621	28.000	45,388.000	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	28.930	56,384.570	
EMERA INC	3,524	51.580	181,767.920	
TFI INTERNATIONAL INC	924	141.940	131,152.560	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,193	36.320	79,649.760	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,956	61.380	242,819.280	
BRP INC/CA- SUB VOTING	403	97.110	39,135.330	
IVANHOE MINES LTD-CL A	7,402	11.460	84,826.920	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,027	67.760	340,629.520	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,997	9.910	69,340.270	
AIR CANADA	1,700	18.920	32,164.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	5.470	80,720.790	
BANK OF MONTREAL	7,414	130.540	967,823.560	
POWER CORP OF CANADA	5,730	33.480	191,840.400	
SHOPIFY INC - CLASS A	12,670	50.450	639,201.500	
NUTRIEN LTD	6,364	110.870	705,576.680	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	42.620	65,293.840	
CAMECO CORP	4,472	31.650	141,538.800	
FIRSTSERVICE CORP	422	169.680	71,604.960	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	1,865	38.220	71,280.300	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,560	20.790	32,432.400	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	772	38.810	29,961.320	
TELUS CORP	600	28.560	17,136.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	48.010	258,005.740	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	148.900	92,764.700	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	12,748	80.710	1,028,891.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	274	786.000	215,364.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,167	81.840	259,187.280	
WESTON (GEORGE) LTD	800	169.860	135,888.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,615	20.740	54,235.100	
BLACKBERRY LTD	6,400	6.550	41,920.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,420	62.670	402,341.400	
ENBRIDGE INC	22,166	55.520	1,230,656.320	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,150	61.060	925,059.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	21,036	23.950	503,812.200	

	BAUSCH HEALTH COS INC	3,514	9.260	32,539.640	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,003	108.920	1,089,526.760	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,100	75.540	83,094.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,364	38.170	90,233.880	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,418	169.990	1,090,995.820	
	CGI INC - CLASS A	2,271	115.630	262,595.730	
	ONEX CORPORATION	1,104	68.840	75,999.360	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,172	36.720	189,915.840	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	38.810	51,151.580	
	TMX GROUP LTD	698	138.200	96,463.600	
	OPEN TEXT CORP	3,210	39.410	126,506.100	
	SAPUTO INC	2,900	32.260	93,554.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	31.320	197,316.000	
	FORTIS INC	5,938	53.450	317,386.100	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	72.370	98,061.350	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	8.240	54,384.000	
	CENOVUS ENERGY INC	15,373	27.680	425,524.640	
	DOLLARAMA INC	3,074	81.440	250,346.560	
	ALTAGAS LTD	3,201	22.420	71,766.420	
	KEYERA CORP	2,200	30.410	66,902.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,734	19.370	149,807.580	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 26,872,424.660 (2,745,286,902)	
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	3.670	111,568.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	14,900	30.800	458,920.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,300	34.950	744,435.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	11,750	5.470	64,272.500	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	7.530	130,269.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	6.490	19,470.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	8.260	42,952.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	40,700	12.370	503,459.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	46,000	0.875	40,250.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	17.300	55,360.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	81,400	2.730	222,222.000	

	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.490	49,209.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.140	107,852.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	4.090	113,702.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 2,663,940.500 (269,164,548)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	CS GROUP ANR RIGHTS AG	27,320	0.099	2,704.680	
	UBS GROUP AG-REG	38,238	17.350	663,429.300	
	ROCHE HOLDING AG-BR	324	372.800	120,787.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	645.500	57,449.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	32.430	56,882.220	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	7,339	309.250	2,269,585.750	
	SIKA AG-REG	1,611	232.800	375,040.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	97,400.000	97,400.000	
	ABB LTD-REG	17,976	29.430	529,033.680	
	SWISS RE AG	2,969	84.520	250,939.880	
	NESTLE SA-REG	29,776	111.260	3,312,877.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	243	908.400	220,741.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	261	179.300	46,797.300	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	27,320	2.902	79,282.640	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	53.940	144,774.960	
	SGS SA-REG	78	2,185.000	170,430.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	170.800	79,763.600	
	TEMENOS AG - REG	793	57.300	45,438.900	
	VAT GROUP AG	339	257.800	87,394.200	
	ALCON INC	5,550	64.160	356,088.000	
	SIG GROUP N AG	3,400	20.060	68,204.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	245.500	92,553.500	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,510	452.000	682,520.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	550	142.300	78,265.000	
	CLARIANT AG-REG	2,552	15.590	39,785.680	
	NOVARTIS AG-REG	22,697	83.300	1,890,660.100	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,920.000	78,720.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	87.700	34,203.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5,238	119.950	628,298.100	
	SWISSCOM AG-REG	196	504.800	98,940.800	

	GEBERIT AG-REG	433	445.600	192,944.800	
	GIVAUDAN-REG	106	3,126.000	331,356.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,271	105.500	134,090.500	
	SONOVA HOLDING AG-REG	613	241.800	148,223.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,730	55.480	95,980.400	
	LONZA GROUP AG-REG	746	486.300	362,779.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	45.740	20,583.000	
	HOLCIM LTD	5,418	48.930	265,102.740	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	329	503.000	165,487.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	225.200	144,128.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	78.300	74,071.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	9,760.000	136,640.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 14,730,379.190 (2,145,774,336)	
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	222.900	450,258.000	
	INVESTOR CLASS A	6,256	198.550	1,242,128.800	
	VOLVO CAR CLASS B	7,177	49.735	356,948.090	
	ERICSSON LM-B SHS	29,689	64.480	1,914,346.720	
	VOLVO AB-B SHS	16,333	190.680	3,114,376.440	
	SKF AB-B SHARES	4,000	173.100	692,400.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	145.580	378,508.000	
	SWEDISH MATCH AB	18,200	115.200	2,096,640.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	93.260	655,244.760	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	238.500	684,256.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	18,767	119.550	2,243,594.850	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,557	104.300	1,726,895.100	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	167.450	1,811,976.450	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,112	117.620	954,133.440	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	141.600	1,036,512.000	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	170.800	633,497.200	
	SANDVIK AB	12,212	192.000	2,344,704.000	
	INVESTOR AB-B SHS	19,446	191.420	3,722,353.320	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	28,712	128.960	3,702,699.520	
	VOLVO AB-A SHS	1,923	201.400	387,292.200	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	430.300	479,354.200	
	SECURITAS AB-B SHS	3,930	88.280	346,940.400	

TELIA CO AB	29,088	28.850	839,188.800	
ALFA LAVAL AB	3,803	295.500	1,123,786.500	
ATLAS COPCO AB-B SHS	16,329	116.400	1,900,695.600	
ASSA ABLOY AB-B	11,369	238.400	2,710,369.600	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,638	265.000	434,070.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,420	46.890	301,033.800	
INDUTRADE AB	3,600	219.800	791,280.000	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	1,911	219.100	418,700.100	
LUNDBERGS AB-B SHS	948	468.000	443,664.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	205.200	420,249.600	
LIFCO AB-B SHS	2,924	176.800	516,963.200	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,716	97.860	1,635,827.760	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,282	255.400	1,604,422.800	
EMBRACER GROUP AB	7,090	44.925	318,518.250	
BOLIDEN AB	3,171	380.500	1,206,565.500	
EPIROC AB-A	7,913	197.450	1,562,421.850	
EPIROC AB-B	4,015	170.000	682,550.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	80.320	433,728.000	
NORDEA BANK ABP	38,096	109.860	4,185,226.560	
EQT AB	3,365	236.000	794,140.000	
EVOLUTION AB	2,064	1,043.400	2,153,577.600	
KINNEVIK AB - B	3,003	158.650	476,425.950	
HEXAGON AB-B SHS	22,193	117.900	2,616,554.700	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,216	263.700	320,659.200	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 58,865,679.360 (773,495,026)	
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	879.900	16,093,371.000	
DANSKE BANK A/S	8,002	127.150	1,017,454.300	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	14,690.000	572,910.000	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	11,264	176.080	1,983,365.120	
GN STORE NORD A/S	1,551	168.300	261,033.300	
CARLSBERG AS-B	1,132	903.800	1,023,101.600	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,464	409.900	1,009,993.600	
COLOPLAST-B	1,400	863.400	1,208,760.000	
DSV PANALPINA A/S	2,004	1,106.500	2,217,426.000	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	1,575.000	154,350.000	



	DEMANT A/S	614	200.600	123,168.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	58	15,085.000	874,930.000	
	TRYG A/S	4,074	164.550	670,376.700	
	PANDORA A/S	1,128	503.800	568,286.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	435.800	549,979.600	
	GENMAB A/S	741	3,180.000	2,356,380.000	
	ORSTED A/S	2,246	604.200	1,357,033.200	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 32,041,919.220 (618,729,460)	
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	4.740	71,100.000	
	MERCURY NZ LTD	12,380	5.245	64,933.100	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	23,635	5.175	122,311.120	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.820	103,919.980	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	22.810	165,098.780	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 527,362.980 (45,421,773)	
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	190.800	2,108,149.200	
	NORSK HYDRO ASA	15,284	73.080	1,116,954.720	
	ORKLA ASA	11,618	69.380	806,056.840	
	TELENOR ASA	8,746	97.920	856,408.320	
	EQUINOR ASA	11,382	377.000	4,291,014.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	465.300	982,713.600	
	MOWI ASA	4,677	153.650	718,621.050	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	187.600	375,200.000	
	AKER BP ASA	3,655	339.600	1,241,238.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,203	400.000	481,200.000	
	SALMAR ASA	728	332.800	242,278.400	
	ADEVINTA ASA	3,382	76.300	258,046.600	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 13,477,880.730 (187,342,542)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	

UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	8,490	22.250	188,902.500
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	5,055	30.960	156,502.800
EXOR NV	1,300	73.900	96,070.000
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,320	106.450	140,514.000
BAYER AG-REG	9,724	55.960	544,155.040
EVONIK INDUSTRIES AG	2,431	18.535	45,058.580
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	23,478	10.210	239,710.380
COMMERZBANK AG	14,830	8.012	118,817.960
VOLKSWAGEN AG	341	181.700	61,959.700
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,824	137.840	251,420.160
SIEMENS AG-REG	7,696	133.080	1,024,183.680
E.ON SE	28,880	9.086	262,403.680
UNIPER SE	1,192	4.788	5,707.290
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,257	84.750	276,030.750
GEA GROUP AG	1,908	38.900	74,221.200
CONTINENTAL AG	1,272	57.880	73,623.360
BASF SE	9,198	49.060	451,253.880
ALLIANZ SE-REG	4,105	205.600	843,988.000
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,995	68.380	136,418.100
RHEINMETALL AG	502	193.450	97,111.900
RWE AG	7,330	41.740	305,954.200
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	7.592	50,205.890
BRENNTAG SE	1,773	60.580	107,408.340
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	26.270	127,015.450
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	19.140	18,355.260
SAP SE	10,305	103.080	1,062,239.400
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,408	301.500	424,512.000
ZALANDO SE	2,514	29.250	73,534.500
HEIDELBERGCEMENT AG	1,570	52.480	82,393.600
KION GROUP AG	600	27.110	16,266.000
COVESTRO AG	1,945	38.230	74,357.350
RATIONAL AG	74	582.500	43,105.000
SARTORIUS AG-VORZUG	279	353.400	98,598.600
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	58.000	100,920.000
DELIVERY HERO SE	1,832	39.380	72,144.160
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	126.900	71,064.000
BECHTLE AG	819	34.010	27,854.190

NEMETSCHKE SE	789	45.650	36,017.850	
SCOUT24 AG	1,083	51.100	55,341.300	
AROUNDTOWN SA	10,412	2.336	24,322.430	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,230	50.440	162,921.200	
KNORR-BREMSE AG	926	54.000	50,004.000	
HELLOFRESH SE	1,814	22.660	41,105.240	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	15.670	74,150.440	
BEIERSDORF AG	1,147	102.950	118,083.650	
MERCK KGAA	1,490	172.100	256,429.000	
ADIDAS AG	1,621	120.940	196,043.740	
PUMA SE	1,295	47.850	61,965.750	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	64.500	84,559.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	34,147	19.464	664,637.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,341	29.660	69,434.060	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	8,634	62.540	539,970.360	
QIAGEN N.V.	2,521	47.180	118,940.780	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14,228	30.600	435,376.800	
HANNOVER RUECK SE	644	181.200	116,692.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	9,596	37.840	363,112.640	
DEUTSCHE BOERSE AG	1,943	172.500	335,167.500	
MTU AERO ENGINES AG	619	197.400	122,190.600	
SYMRISE AG	1,509	107.650	162,443.850	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	2,105	2.268	4,774.140	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	733	80.150	58,749.950	
VONOVIA SE	7,135	23.800	169,813.000	
LEG IMMOBILIEN SE	869	61.560	53,495.640	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,030	14.080	127,142.400	
NN GROUP NV	3,860	40.330	155,673.800	
ARCELORMITTAL	6,975	25.940	180,931.500	
HEINEKEN NV	2,930	88.700	259,891.000	
AEGON NV	26,133	4.670	122,041.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	10,058	27.940	281,020.520	
AKZO NOBEL N.V.	2,168	68.280	148,031.040	
KONINKLIJKE DSM NV	2,014	119.950	241,579.300	
WOLTERS KLUWER	3,032	104.300	316,237.600	
ING GROEP NV	40,248	11.662	469,372.170	

KONINKLIJKE KPN NV	37,607	2.911	109,473.970	
ASML HOLDING NV	4,061	559.800	2,273,347.800	
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	12.280	49,488.400	
IMCD NV	715	139.150	99,492.250	
ADYEN NV	193	1,427.000	275,411.000	
JUST EAT TAKEAWAY	2,381	20.940	49,858.140	
PROSUS NV	8,121	60.270	489,452.670	
JDE PEET'S NV	1,476	29.200	43,099.200	
ASM INTERNATIONAL NV	555	256.150	142,163.250	
RANDSTAD NV	1,490	55.740	83,052.600	
HEINEKEN HOLDING NV	1,153	72.500	83,592.500	
OCI NV	1,197	39.940	47,808.180	
TOTALENERGIES SE	24,332	58.940	1,434,128.080	
MICHELIN (CGDE)	8,584	26.440	226,960.960	
AIR LIQUIDE SA	5,159	138.760	715,862.840	
KERING	734	552.600	405,608.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,330	138.880	740,230.400	
BOUYGUES SA	2,721	29.720	80,868.120	
BNP PARIBAS	11,143	53.570	596,930.510	
THALES SA	1,235	121.850	150,484.750	
DANONE	6,414	50.300	322,624.200	
CARREFOUR SA	6,641	16.510	109,642.910	
VIVENDI	8,930	8.550	76,351.500	
L'OREAL	2,410	347.500	837,475.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,639	44.180	249,131.020	
LEGRAND SA	3,052	78.060	238,239.120	
PERNOD RICARD SA	2,068	186.950	386,612.600	
EURAZEO SE	400	60.500	24,200.000	
SOCIETE GENERALE SA	9,112	24.075	219,371.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,795	702.000	1,962,090.000	
ACCOR SA	1,850	24.880	46,028.000	
CAPGEMINI SE	1,919	172.750	331,507.250	
VALEO SA	2,245	17.630	39,579.350	
PUBLICIS GROUPE	2,918	63.000	183,834.000	
BUREAU VERITAS SA	3,227	25.170	81,223.590	
EIFFAGE	945	94.440	89,245.800	
SODEXO SA	1,085	91.040	98,778.400	
IPSEN	640	108.800	69,632.000	

AMUNDI SA	1,005	52.600	52,863.000	
TELEPERFORMANCE	745	214.000	159,430.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	26.200	25,597.400	
EURONEXT NV	929	71.780	66,683.620	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	67.040	99,219.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	314	315.700	99,129.800	
SEB SA	216	76.800	16,588.800	
ESSILORLUXOTTICA	2,758	175.500	484,029.000	
DASSAULT AVIATION SA	220	151.200	33,264.000	
WORLDLINE SA	2,641	44.810	118,343.210	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	878	37.410	32,845.980	
AXA SA	18,609	27.355	509,049.190	
EDENRED	3,007	52.620	158,228.340	
RENAULT SA	2,044	33.780	69,046.320	
HERMES INTERNATIONAL	304	1,484.000	451,136.000	
STMICROELECTRONICS NV	8,570	35.750	306,377.500	
REMY COINTREAU	253	161.800	40,935.400	
DASSAULT SYSTEMES SE	7,626	34.755	265,041.630	
WENDEL	331	87.050	28,813.550	
ORANGE	22,580	9.844	222,277.520	
ALSTOM	3,668	24.560	90,086.080	
SANOFI	11,373	88.190	1,002,984.870	
VINCI SA	5,238	96.590	505,938.420	
AIRBUS SE	5,858	109.180	639,576.440	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,368	24.320	179,189.760	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	9.606	140,334.050	
BIOMERIEUX	457	96.060	43,899.420	
ENGIE	20,960	14.360	300,985.600	
EDF	6,760	12.000	81,120.000	
SAFRAN SA	3,650	116.500	425,225.000	
ARKEMA	650	83.940	54,561.000	
ADP	350	145.700	50,995.000	
GETLINK SE	4,973	15.905	79,095.560	
BOLLORE	14,302	5.235	74,870.970	
UCB SA	1,550	77.140	119,567.000	
KBC GROUP NV	3,011	52.520	158,137.720	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	77.060	87,771.340	
SOLVAY SA	873	94.140	82,184.220	
UMICORE	2,270	34.220	77,679.400	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,300	56.200	522,660.000
AGEAS	1,887	37.810	71,347.470
D' IETEREN GROUP	296	178.000	52,688.000
PROXIMUS	2,269	10.155	23,041.690
ELIA GROUP SA/NV	502	134.200	67,368.400
SOFINA	146	211.000	30,806.000
ARGENX SE	614	364.300	223,680.200
PRYSMIAN SPA	2,949	33.720	99,440.280
ASSICURAZIONI GENERALI	12,944	16.940	219,271.360
MEDIOBANCA SPA	7,465	9.256	69,096.040
TENARIS SA	4,700	16.380	76,986.000
UNICREDIT SPA	23,887	12.960	309,575.520
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.217	23,610.250
INTESA SANPAOLO	164,057	2.134	350,179.660
ATLANTIA SPA	5,557	22.930	127,422.010
POSTE ITALIANE SPA	6,465	9.422	60,913.230
MONCLER SPA	2,435	48.000	116,880.000
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	40.010	51,412.850
ENI SPA	24,147	14.196	342,790.810
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5,546	10.035	55,654.110
DIASORIN SPA	277	128.900	35,705.300
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	9.386	22,657.800
NEXI SPA	6,511	8.340	54,301.740
AMPLIFON SPA	1,440	27.110	39,038.400
ENEL SPA	82,994	5.106	423,767.360
SNAM SPA	24,300	4.797	116,567.100
TERNA SPA	15,815	7.198	113,836.370
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	15.200	177,703.200
FINECOBANK SPA	8,077	15.120	122,124.240
STELLANTIS NV	21,477	14.710	315,926.670
FERRARI NV	1,599	208.500	333,391.500
TELEFONICA SA	67,494	3.590	242,303.460
ENDESA SA	3,760	17.545	65,969.200
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	66,350	5.624	373,152.400
IBERDROLA SA	63,278	10.655	674,227.090
REPSOL SA	19,220	14.635	281,284.700
GRIFOLS SA	2,795	9.944	27,793.480

BANCO SANTANDER SA	170,827	2.835	484,379.950	
AMADEUS IT GROUP SA	5,160	50.860	262,437.600	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,668	26.220	43,734.960	
CAIXABANK SA	50,378	3.548	178,741.140	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,953	26.830	79,228.990	
AENA SME SA	866	121.350	105,089.100	
CELLNEX TELECOM SA	6,812	32.610	222,139.320	
ACCIONA SA	291	181.300	52,758.300	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	10,791	24.920	268,911.720	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	2,739	18.010	49,329.390	
ENAGAS SA	3,218	17.300	55,671.400	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2,828	16.985	48,033.580	
FERROVIAL SA	5,367	25.530	137,019.510	
UPM-KYMMENE OYJ	6,124	34.660	212,257.840	
NOKIA OYJ	67,262	4.571	307,454.600	
WARTSILA OYJ ABP	8,227	8.170	67,214.590	
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,911	14.040	82,990.440	
ELISA OYJ	939	49.560	46,536.840	
SAMPO OYJ-A SHS	5,826	48.330	281,570.580	
FORTUM OYJ	4,400	15.020	66,088.000	
KESKO OYJ-B SHS	3,470	20.530	71,239.100	
KONE OYJ-B	3,334	48.500	161,699.000	
NESTE OYJ	4,941	46.690	230,695.290	
ORION OYJ-CLASS B	1,315	50.420	66,302.300	
VERBUND AG	876	85.700	75,073.200	
OMV AG	2,056	49.580	101,936.480	
ERSTE GROUP BANK AG	3,489	29.420	102,646.380	
VOESTALPINE AG	1,323	26.200	34,662.600	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,693	34.730	93,527.890	
KINGSPAN GROUP PLC	1,744	54.040	94,245.760	
JERONIMO MARTINS	2,900	21.340	61,886.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	31,772	4.420	140,432.240	
GALP ENERGIA SGPS SA	6,135	11.590	71,104.650	
EDP RENOVAVEIS SA	3,029	21.730	65,820.170	
KERRY GROUP PLC-A	1,822	90.860	165,546.920	
CRH PLC	7,287	38.370	279,602.190	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,557	138.650	215,878.050	

ユーロ 小計				ユーロ	
				46,816,086.190	
				(6,721,853,655)	
香港・ドル	株	香港・ドル	香港・ドル		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	40.000	700,000.000		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	22,000	45.650	1,004,300.000		
MTR CORP	16,500	37.250	614,625.000		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	17,000	92.700	1,575,900.000		
SINO LAND CO	34,000	9.990	339,660.000		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,552	44.250	1,263,426.000		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	60.200	301,000.000		
CLP HOLDINGS LTD	19,000	56.500	1,073,500.000		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	24.300	451,129.500		
HONG KONG & CHINA GAS	138,027	6.600	910,978.200		
HANG SENG BANK LTD	9,000	119.400	1,074,600.000		
NEW WORLD DEVELOPMENT	15,500	18.520	287,060.000		
WH GROUP LTD	89,500	4.500	402,750.000		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,400	300.000	4,020,000.000		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	15,000	13.460	201,900.000		
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	22,000	14.380	316,360.000		
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	17.580	140,640.000		
CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	47.150	1,110,476.800		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	38.900	213,950.000		
AIA GROUP LTD	136,000	76.200	10,363,200.000		
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	12,000	15.240	182,880.000		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	36.050	721,000.000		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	21.300	408,960.000		
ESR CAYMAN LTD	22,000	16.660	366,520.000		
SANDS CHINA LTD	29,000	19.880	576,520.000		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	26,000	13.520	351,520.000		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	15,000	88.900	1,333,500.000		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	43,000	24.950	1,072,850.000		
香港・ドル 小計			香港・ドル		
			31,379,205.500		



			(557,922,274)	
合計			69,882,489,642	[69,882,489,642]

## (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	259,600.800	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,535	415,221.100	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	117,204.020	
		VORNADO REALTY TRUST	1,851	46,848.810	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,229	362,001.950	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,833	243,702.140	
		EQUINIX INC	946	634,728.160	
		AMERICAN TOWER CORP	4,876	1,059,164.720	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	7,895	147,320.700	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3,155	102,569.050	
		KIMCO REALTY CORP	7,054	160,266.880	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	5,382	107,263.260	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,000	154,710.000	
		INVITATION HOMES INC	7,588	242,208.960	
		VICI PROPERTIES INC	9,791	329,662.970	
		VENTAS INC	4,401	199,805.400	
		WEYERHAEUSER CO	7,465	237,088.400	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,563	634,758.930	
		IRON MOUNTAIN INC	3,160	170,197.600	
		SUN COMMUNITIES INC	1,461	211,567.410	
		PROLOGIS INC	9,807	1,116,134.670	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,561	238,083.720	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,049	123,519.750	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	704	151,000.960	
		WELLTOWER INC	4,790	331,468.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,888	150,968.320	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,236	200,133.120	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	127,588.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,245	111,246.450	
		REALTY INCOME CORP	6,221	387,568.300	
		PUBLIC STORAGE	1,647	478,618.200	
		REGENCY CENTERS CORP	1,761	115,909.020	

	UDR INC	3,360	136,920.000	
	WP CAREY INC	2,131	166,686.820	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,233	351,588.750	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,429	219,380.080	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6,944	90,133.120	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 10,332,839.040 (1,434,921,358)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,946	49,312.870	
	SEGRO PLC	10,113	81,753.490	
	BRITISH LAND CO PLC	9,799	39,656.550	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 170,722.910 (28,379,270)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	12,537	98,540.820	
	LENDLEASE GROUP	6,942	52,898.040	
	TRANSURBAN GROUP	33,749	478,898.310	
	APA GROUP	13,286	149,201.780	
	SCENTRE GROUP	64,017	188,209.980	
	GPT GROUP	21,774	95,152.380	
	MIRVAC GROUP	43,513	96,598.860	
	STOCKLAND	14,352	54,537.600	
	GOODMAN GROUP	18,558	346,849.020	
	VICINITY CENTRES	50,371	102,253.130	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,663,139.920 (154,322,753)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	35,982.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	925	19,674.750	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 55,657.050 (5,685,924)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	47,500	131,100.000	

	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56,826	118,198.080	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	30,000	48,300.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	37,600	65,048.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 362,646.080 (36,641,760)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	78,333.860	ユーロ
	GECINA SA	578	54,765.500	
	KLEPIERRE	2,394	53,338.320	
	COVIVIO	353	19,891.550	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,846	47,479.120	
ユーロ 小計				ユーロ 253,808.350 (36,441,803)
香港・ドル	LINK REIT	25,000	1,315,000.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	33,000	183,480.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	36,000	337,320.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 1,835,800.000 (32,640,524)
投資証券 合計				1,729,033,392 [1,729,033,392]
合計				1,729,033,392 [1,729,033,392]

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 597銘柄	97.3%	2.7%	73.0%
	投資証券 37銘柄			
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	99.1%	0.9%	4.6%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%

オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	91.1%	8.9%	2.4%
	投資証券	10銘柄			
カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.8%	0.2%	3.8%
	投資証券	2銘柄			
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	88.0%	12.0%	0.4%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	42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%	-%	0.9%
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%	-%	0.3%
ユーロ	株式	224銘柄	99.5%	0.5%	9.4%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	28銘柄	94.5%	5.5%	0.8%
	投資証券	3銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	27,262,842	35,118,842
親投資信託受益証券	2,608,113,005	3,443,555,449
未収入金	-	2,700,000
流動資産合計	2,635,375,847	3,481,374,291
<b>資産合計</b>		
2,635,375,847		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,014,805	4,092,878
未払受託者報酬	275,692	378,682
未払委託者報酬	4,067,136	5,586,272
その他未払費用	68,843	94,597
流動負債合計	6,426,476	10,152,429
<b>負債合計</b>		
6,426,476		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,473,643,378	1,850,387,371
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,155,305,993	1,620,834,491
（分配準備積立金）	800,456,378	810,150,798
元本等合計	2,628,949,371	3,471,221,862
<b>純資産合計</b>		
2,628,949,371		
<b>負債純資産合計</b>		
2,635,375,847		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
営業収益				
受取利息		4		6
有価証券売買等損益		726,623,582		143,827,444
営業収益合計		726,623,586		143,827,450
営業費用				
支払利息		6,935		8,425
受託者報酬		547,523		689,359
委託者報酬		8,077,271		10,169,454
その他費用		136,733		172,190
営業費用合計		8,768,462		11,039,428
営業利益		717,855,124		132,788,022
経常利益		717,855,124		132,788,022
当期純利益		717,855,124		132,788,022
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		157,604,428		4,114,938
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		640,583,593		1,155,305,993
剰余金増加額又は欠損金減少額		242,451,909		551,123,829
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		242,451,909		551,123,829
剰余金減少額又は欠損金増加額		287,980,205		214,268,415
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		287,980,205		214,268,415
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,155,305,993		1,620,834,491

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,873,069,139円	1,473,643,378円
期中追加設定元本額	415,335,713円	645,807,754円
期中一部解約元本額	814,761,474円	269,063,761円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,473,643,378口	1,850,387,371口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日



1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(560,252,154円)、投資信託約款に規定される収益調整金(354,855,620円)及び分配準備積立金(240,204,224円)より分配対象額は1,155,311,998円(1万口当たり7,839.83円)であり、分配を行っておりません。	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(128,676,016円)、投資信託約款に規定される収益調整金(810,691,742円)及び分配準備積立金(681,474,782円)より分配対象額は1,620,842,540円(1万口当たり8,759.48円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	599,399,202	137,830,892
合計	599,399,202	137,830,892

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.7840円	1.8759円
（1万口当たり純資産額）	（17,840円）	（18,759円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	351,550,275	692,448,576	
	外国株式インデックスマザーファンド	637,435,268	2,751,106,873	
親投資信託受益証券 合計			3,443,555,449	
合計			3,443,555,449	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,248,475,444	2,031,852,254
コール・ローン	9,574,164,291	17,666,040,102

株式	229,141,995,652	267,590,825,704
投資証券	5,638,901,532	6,560,957,279
派生商品評価勘定	448,705,586	654,308,499
未収入金	24,502,132	1,175,053
未収配当金	248,294,417	373,891,289
差入委託証拠金	4,653,123,326	4,463,843,737
流動資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917
資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	130,578,047	869,807,209
未払金	4,990,970	5,561,220
未払解約金	65,382,000	94,261,100
流動負債合計	200,951,017	969,629,529
負債合計	200,951,017	969,629,529
純資産の部		
元本等		
元本	1 61,024,141,090	69,133,888,947
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	189,753,070,273	229,239,375,441
元本等合計	250,777,211,363	298,373,264,388
純資産合計	250,777,211,363	298,373,264,388
負債純資産合計	250,978,162,380	299,342,893,917

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	54,067,455,177円	61,024,141,090円
期中追加設定元本額	13,499,704,777円	13,890,679,058円
期中一部解約元本額	6,543,018,864円	5,780,931,201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	372,377,534円	308,081,421円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,453,234円	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)	59,956,664円	38,681,400円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,408,815円	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)	236,485,519円	180,994,510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)	36,674,409円	67,499,826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)	508,352,729円	507,554,812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)	2,520,260,966円	2,997,935,211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)	513,644,174円	637,435,268円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	15,304,858円	18,410,629円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	32,174,123円	45,911,834円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	4,063,382,462円	5,903,409,265円
i F r e e 8資産バランス	1,116,648,157円	1,346,263,819円
i F r e e 年金バランス	171,426,649円	249,849,751円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	38,249,671,210円	43,789,686,887円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	500,854,698円	521,693,855円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	919,288,192円	1,000,508,647円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	740,101,154円	822,473,467円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,732,619,609円	1,893,327,736円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,075,244円	12,179,865円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	10,707,802円	12,114,090円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	811,486,824円	1,381,872,090円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,690,959円	1,875,196円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,170,527円	2,222,293円
ダイワつみたてインデックス バランス70	3,559,196円	4,706,722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)	- 円	4,098,586円
ダイワ世界バランスファンド40VA	107,882,488円	72,721,941円
ダイワ世界バランスファンド60VA	208,152,302円	53,797,340円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,461,676,506円	1,210,030,069円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	73,896,117円	62,518,246円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	211,630,253円	- 円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	212,845,169円	173,081,567円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	927,057,365円	1,145,121,735円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	324,437,993円	424,216,950円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,929,148,713円	1,263,595,028円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,822,903,027円	2,883,082,448円
ダイワライフスタイル25	12,346,386円	10,488,019円
ダイワライフスタイル50	49,688,514円	43,394,568円
ダイワライフスタイル75	39,700,549円	33,119,707円
計	61,024,141,090円	69,133,888,947円
2. 期末日における受益権の総数	61,024,141,090口	69,133,888,947口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。



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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	41,450,751,465	39,581,029,860

投資証券	1,091,405,878	1,505,805,187
合計	42,542,157,343	41,086,835,047

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	15,914,463,645	-	16,312,448,688	397,985,043	23,750,625,017	-	24,154,881,137	404,256,120
合計	15,914,463,645	-	16,312,448,688	397,985,043	23,750,625,017	-	24,154,881,137	404,256,120

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外 の取引								

為替予約取引								
買 建	9,828,774,794	-	9,748,917,290	79,857,504	17,573,621,210	-	16,953,866,380	619,754,830
アメリカ・ドル	7,046,626,660	-	7,027,555,314	19,071,346	12,336,972,570	-	11,834,462,290	502,510,280
イギリス・ポンド	308,287,051	-	301,604,400	6,682,651	828,018,030	-	813,955,170	14,062,860
イスラエル・シケル	-	-	-	-	32,484,240	-	32,263,680	220,560
オーストラリア・ドル	286,703,319	-	274,744,314	11,959,005	594,996,870	-	584,194,590	10,802,280
カナダ・ドル	439,283,847	-	428,403,360	10,880,487	847,777,660	-	806,418,570	41,359,090
スイス・フラン	443,805,440	-	440,052,480	3,752,960	829,345,070	-	815,725,680	13,619,390
ユーロ	1,304,068,477	-	1,276,557,422	27,511,055	2,104,026,770	-	2,066,846,400	37,180,370
合計	9,828,774,794	-	9,748,917,290	79,857,504	17,573,621,210	-	16,953,866,380	619,754,830

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	4.1095円	4.3159円
(1万口当たり純資産額)	(41,095円)	(43,159円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	4,900	142.820	699,818.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	12,300	170.510	2,097,273.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,500	173.110	1,298,325.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	106.070	572,778.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,600	155.650	404,690.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	37.280	786,608.000	
	ABBOTT LABORATORIES	72,366	105.000	7,598,430.000	
	HOWMET AEROSPACE INC	15,583	37.220	579,999.260	
	VERISK ANALYTICS INC	6,500	176.930	1,150,045.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	44.660	620,774.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	24,700	77.400	1,911,780.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	354.950	638,910.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	25,300	67.530	1,708,509.000	
	QORVO INC	4,420	93.980	415,391.600	
	AFLAC INC	25,300	70.880	1,793,264.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	144.960	739,296.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,100	70.210	498,491.000	
	ADOBE INC	19,520	326.780	6,378,745.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,600	106.400	915,040.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	363.320	1,743,936.000	
	GARMIN LTD	6,300	89.810	565,803.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,200	302.180	2,780,056.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,200	216.720	6,111,504.000	
	WR BERKLEY CORP	8,642	75.040	648,495.680	
	AUTOZONE INC	820	2,556.050	2,095,961.000	
DOLLAR TREE INC	9,271	146.500	1,358,201.500		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	47,800	8.670	414,426.000		
CELANESE CORP	4,450	105.550	469,697.500		
DR HORTON INC	13,816	84.220	1,163,583.520		

DENTSPLY SIRONA INC	8,900	30.210	268,869.000	
AUTODESK INC	9,000	195.180	1,756,620.000	
MOODY'S CORP	6,900	289.530	1,997,757.000	
DEVON ENERGY CORP	25,900	67.500	1,748,250.000	
ALBEMARLE CORP	4,800	270.020	1,296,096.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,800	118.640	688,112.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	55.070	561,714.000	
CITIGROUP INC	80,473	47.570	3,828,100.610	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,400	257.060	4,472,844.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,300	94.650	2,016,045.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	383.060	586,081.800	
HESS CORP	11,600	141.980	1,646,968.000	
DAVITA INC	2,750	71.650	197,037.500	
DANAHER CORP	28,650	259.020	7,420,923.000	
FORTIVE CORP	14,100	65.600	924,960.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23,100	105.340	2,433,354.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,300	96.450	2,247,285.000	
BUNGE LTD	6,300	104.160	656,208.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	123.940	1,635,388.300	
APPLE INC	670,000	141.170	94,583,900.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,600	108.550	1,259,180.000	
BOEING CO/THE	23,300	175.320	4,084,956.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	108.130	672,027.950	
BECTON DICKINSON AND CO	11,799	241.020	2,843,794.980	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	108.500	585,900.000	
NISOURCE INC	16,500	27.230	449,295.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,300	97.600	517,280.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	31,771	44.840	1,424,611.640	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	173,704	38.340	6,659,811.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,250	315.130	16,780,672.500	
ANSYS INC	3,600	240.630	866,268.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,117	45.910	2,530,421.470	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	29,000	88.210	2,558,090.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	79.030	6,978,349.000	
JPMORGAN CHASE & CO	121,470	136.560	16,587,943.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	120.500	1,120,650.000	
LKQ CORP	11,100	52.930	587,523.000	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,812	71.120	911,189.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,400	163.520	1,864,128.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	324.480	1,460,160.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	252.850	2,376,790.000	
SERVICENOW INC	8,300	396.850	3,293,855.000	
CATERPILLAR INC	22,100	235.120	5,196,152.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	57.360	556,392.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,300	47.050	484,615.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,100	239.500	502,950.000	
CMS ENERGY CORP	12,000	60.200	722,400.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	50.730	755,877.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	34.610	214,582.000	
CORNING INC	33,200	33.410	1,109,212.000	
CISCO SYSTEMS INC	171,350	48.280	8,272,778.000	
MORGAN STANLEY	54,152	91.080	4,932,164.160	
MSCI INC	3,400	486.320	1,653,488.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	590.740	649,814.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	260.830	339,079.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	51.630	485,322.000	
BROADCOM INC	16,712	521.390	8,713,469.680	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,000	204.790	1,023,950.000	
ARAMARK	9,600	40.570	389,472.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	114.130	901,627.000	
CENTENE CORP	24,207	84.420	2,043,554.940	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,400	123.250	542,300.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	41.790	844,158.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,700	195.680	1,702,416.000	
GARTNER INC	3,350	340.080	1,139,268.000	
SPLUNK INC	6,700	75.890	508,463.000	
DOMINION ENERGY INC	33,541	59.770	2,004,745.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,400	99.790	1,636,556.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	60.490	320,597.000	
DEERE & CO	12,000	440.970	5,291,640.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	144.550	867,300.000	
POOL CORP	1,700	320.750	545,275.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,684	99.830	1,166,413.720	
VMWARE INC-CLASS A	8,700	118.030	1,026,861.000	
CABLE ONE INC	200	719.970	143,994.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	192.490	519,723.000	

NASDAQ INC	14,300	66.100	945,230.000	
VAIL RESORTS INC	1,700	256.300	435,710.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	7.430	155,287.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	73.720	663,480.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,000	139.960	419,880.000	
WESTLAKE CORP	1,600	107.170	171,472.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,700	96.300	1,415,610.000	
COGNEX CORP	6,900	47.750	329,475.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	53.400	389,820.000	
TELEFLEX INC	1,900	226.150	429,685.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,500	179.830	629,405.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,100	223.500	692,850.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	399.550	359,595.000	
CATALENT INC	6,900	47.180	325,542.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,800	182.440	1,058,152.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	322.720	774,528.000	
CARLISLE COS INC	2,200	255.530	562,166.000	
IDEX CORP	3,100	231.060	716,286.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,900	75.970	2,499,413.000	
ROLLINS INC	9,207	39.830	366,714.810	
AMETEK INC	9,600	139.010	1,334,496.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,000	79.490	794,900.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	54.790	353,395.500	
HEICO CORP	1,800	156.570	281,826.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	100.660	261,716.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	449.120	718,592.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,800	84.840	916,272.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	324.150	551,055.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	18,260	528.960	9,658,809.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	56.920	184,990.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,400	343.940	825,456.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	101.670	538,851.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,200	1,552.720	1,863,264.000	
UGI CORP	8,500	37.840	321,640.000	
CUMMINS INC	5,800	246.420	1,429,236.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,300	74.340	2,401,182.000	

CDW CORP/DE	5,600	184.080	1,030,848.000	
SIGNATURE BANK	2,650	135.580	359,287.000	
COSTAR GROUP INC	16,400	78.250	1,283,300.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	219.130	525,912.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	292.070	1,168,280.000	
MERCADOLIBRE INC	1,890	889.260	1,680,701.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	185.900	557,700.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,516	138.750	1,597,845.000	
DEXCOM INC	16,200	110.390	1,788,318.000	
NORDSON CORP	2,090	230.800	482,372.000	
COPART INC	17,400	64.440	1,121,256.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,000	146.740	1,027,180.000	
SEAGEN INC	5,700	117.370	669,009.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,100	191.830	594,673.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	239.910	791,703.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	609.880	1,274,649.200	
BIO-TECHNE CORP	1,580	327.070	516,770.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	121.740	474,786.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,000	78.760	708,840.000	
KINDER MORGAN INC	84,381	18.880	1,593,113.280	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	235.810	2,310,938.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,600	256.080	409,728.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	28.070	926,310.000	
T-MOBILE US INC	25,927	148.620	3,853,270.740	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	35.310	238,342.500	
COCA-COLA CO/THE	170,450	62.480	10,649,716.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,800	51.570	453,816.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	113.560	789,242.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,400	26.300	326,120.000	
CSX CORP	89,900	32.170	2,892,083.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	239.780	911,164.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,325	102.450	647,996.250	
AMAZON.COM INC	378,800	92.420	35,008,696.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,700	74.850	1,923,645.000	
EXXON MOBIL CORP	174,205	110.540	19,256,620.700	
AES CORP	27,100	28.260	765,846.000	



EVEREST RE GROUP LTD	1,600	332.800	532,480.000	
EOG RESOURCES INC	24,200	141.290	3,419,218.000	
EQT CORP	14,100	42.660	601,506.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	91.030	591,695.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	799.620	399,810.000	
ABIOMED INC	1,900	377.330	716,927.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,500	167.900	1,091,350.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,400	150.940	1,871,656.000	
FORD MOTOR CO	163,423	13.750	2,247,066.250	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	41.190	292,449.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	19.720	122,993.640	
ENTEGRIS INC	6,200	72.390	448,818.000	
AERCAP HOLDINGS NV	5,600	60.240	337,344.000	
FORTINET INC	28,200	51.590	1,454,838.000	
MARKEL CORP	550	1,290.610	709,835.500	
NEXTERA ENERGY INC	81,280	82.490	6,704,787.200	
MASIMO CORP	2,200	140.650	309,430.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	59,908	37.510	2,247,149.080	
INSULET CORP	2,900	288.560	836,824.000	
US BANCORP	58,400	44.590	2,604,056.000	
UNITED RENTALS INC	3,000	342.730	1,028,190.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	149.820	374,550.000	
FASTENAL CO	23,800	50.270	1,196,426.000	
FISERV INC	25,433	101.520	2,581,958.160	
GENERAL ELECTRIC CO	45,506	85.660	3,898,043.960	
GENERAL MOTORS CO	57,300	39.750	2,277,675.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,800	251.220	2,461,956.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,250	383.710	5,467,867.500	
ALPHABET INC-CL A	248,800	95.190	23,683,272.000	
ALPHABET INC-CL C	233,340	95.440	22,269,969.600	
OWENS CORNING	3,900	89.630	349,557.000	
GENERAL MILLS INC	24,900	82.840	2,062,716.000	
FIRSTENERGY CORP	22,418	39.800	892,236.400	
GENUINE PARTS CO	5,950	180.550	1,074,272.500	
FIFTH THIRD BANCORP	28,400	36.000	1,022,400.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,050	225.610	1,816,160.500	
HALLIBURTON CO	37,300	37.160	1,386,068.000	
HOME DEPOT INC	42,550	315.960	13,444,098.000	
ASSURANT INC	2,250	126.390	284,377.500	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	59,500	15.300	910,350.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,710	228.020	389,914.200	
HERSHEY CO/THE	6,000	230.490	1,382,940.000	
HUMANA INC	5,200	533.140	2,772,328.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	164.690	1,795,121.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	35.090	116,498.800	
HENRY SCHEIN INC	5,600	80.600	451,360.000	
HP INC	47,300	28.880	1,366,024.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	53,800	15.460	831,748.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	42.890	292,852.920	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,900	59.140	467,206.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	43.070	127,056.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	58.980	908,292.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	30,403	39.040	1,186,933.120	
ENPHASE ENERGY INC	5,600	303.390	1,698,984.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,200	146.490	5,449,428.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	36.330	519,519.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	65.740	341,848.000	
ZOETIS INC	19,500	147.850	2,883,075.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,699	174.990	1,697,228.010	
CHENIERE ENERGY INC	9,500	172.650	1,640,175.000	
ALLEGION PLC	3,650	110.770	404,310.500	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	20.460	265,427.580	
WASTE CONNECTIONS INC	10,637	140.820	1,497,902.340	
JUNIPER NETWORKS INC	13,400	31.870	427,058.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	151.520	666,688.000	
JOHNSON & JOHNSON	108,900	176.090	19,176,201.000	
PLUG POWER INC	21,100	14.900	314,390.000	
ABBVIE INC	73,072	158.200	11,559,990.400	
HOLOGIC INC	10,100	74.370	751,137.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	13,900	133.160	1,850,924.000	
KROGER CO	28,600	49.350	1,411,410.000	
KLA CORP	6,200	374.330	2,320,846.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	484.100	4,792,590.000	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	190.200	589,620.000
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	39.790	417,795.000
LOWE'S COS INC	27,200	207.470	5,643,184.000
ELI LILLY & CO	33,385	363.950	12,150,470.750
LAM RESEARCH CORP	5,680	442.050	2,510,844.000
LOEWS CORP	8,600	57.780	496,908.000
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	38.090	253,260.410
MCDONALD'S CORP	30,650	271.410	8,318,716.500
3M CO	23,490	126.130	2,962,793.700
META PLATFORMS INC CLASS A	94,800	109.460	10,376,808.000
S&P GLOBAL INC	14,439	347.140	5,012,354.460
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,600	357.540	929,604.000
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,320	290.850	674,772.000
ALCOA CORP	7,700	47.700	367,290.000
PHILLIPS 66	19,900	108.970	2,168,503.000
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	35.860	575,553.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,400	83.750	871,000.000
METLIFE INC	28,400	76.070	2,160,388.000
MARVELL TECHNOLOGY INC	35,200	42.910	1,510,432.000
ARISTA NETWORKS INC	10,200	133.710	1,363,842.000
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,898	264.460	1,824,245.080
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,412.210	1,270,989.000
BAKER HUGHES CO	40,823	28.650	1,169,578.950
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,800	259.630	1,246,224.000
MERCK & CO. INC.	104,621	108.840	11,386,949.640
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	69.460	1,441,364.460
MASCO CORP	9,800	49.870	488,726.000
M & T BANK CORP	7,399	170.920	1,264,637.080
MARSH & MCLENNAN COS	20,770	168.680	3,503,483.600
BLACK KNIGHT INC	6,350	60.750	385,762.500
HEICO CORP-CLASS A	3,020	122.430	369,738.600
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,502	161.260	1,854,812.520
WORKDAY INC-CLASS A	8,200	143.300	1,175,060.000
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	31.670	91,843.000
BLOCK INC CLASS A	21,512	62.110	1,336,110.320
TRANSUNION	8,000	60.460	483,680.000

VISTRA CORP	17,600	24.230	426,448.000	
NOVOCURE LTD	3,850	74.680	287,518.000	
NETAPP INC	9,200	71.790	660,468.000	
NIKE INC -CL B	52,500	106.250	5,578,125.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,900	253.360	2,508,264.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,900	74.220	1,699,638.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,105	115.370	935,073.850	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	26.510	376,442.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,100	528.350	3,222,935.000	
APTIV PLC	11,200	101.880	1,141,056.000	
NEWMONT CORP	32,811	45.760	1,501,431.360	
MCKESSON CORP	6,100	381.780	2,328,858.000	
XYLEM INC	7,300	109.880	802,124.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,100	97.790	6,268,339.000	
NUCOR CORP	11,100	146.990	1,631,589.000	
WESTERN UNION CO	15,246	14.470	220,609.620	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	75.070	510,476.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	12.870	211,608.540	
EVERGY INC	9,350	58.070	542,954.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,824	69.110	2,683,126.640	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,150	269.240	309,626.000	
OKTA INC	6,200	51.250	317,750.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	61.460	178,234.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	89.430	500,808.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	12.250	211,986.250	
LINDE PLC	20,846	331.970	6,920,246.620	
WIX.COM LTD	2,310	84.550	195,310.500	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	30.840	487,272.000	
KKR & CO INC	23,300	50.550	1,177,815.000	
PAYCHEX INC	13,400	120.150	1,610,010.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	849.730	2,294,271.000	
ALTRIA GROUP INC	74,900	45.820	3,431,918.000	
P G & E CORP	61,700	15.170	935,989.000	
PFIZER INC	232,113	49.490	11,487,272.370	
CIGNA CORP	13,100	320.700	4,201,170.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	43.520	513,579.520	
XCEL ENERGY INC	22,500	68.850	1,549,125.000	
STERIS PLC	4,100	178.390	731,399.000	
SEA LTD-ADR	15,500	54.260	841,030.000	

FOX CORP - CLASS B	6,033	29.940	180,628.020	
FOX CORP - CLASS A	12,799	31.720	405,984.280	
STRYKER CORP	14,080	227.200	3,198,976.000	
LYFT INC-A	12,500	10.760	134,500.000	
DOW INC	30,118	50.650	1,525,476.700	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,500	58.530	263,385.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,400	70.570	663,358.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,300	294.290	1,559,737.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	60,900	27.760	1,690,584.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,500	240.780	2,287,410.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	99,267	145.480	14,441,363.160	
EXELON CORP	40,522	40.000	1,620,880.000	
TELADOC HEALTH INC	6,500	27.130	176,345.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,808	52.820	887,798.560	
NVR INC	130	4,557.920	592,529.600	
CONOCOPHILLIPS	53,502	124.250	6,647,623.500	
TWILIO INC - A	7,000	45.750	320,250.000	
DOCUSIGN INC	8,300	44.560	369,848.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	321.980	676,158.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,700	64.110	365,427.000	
PEPSICO INC	57,200	182.590	10,444,148.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,820	150.890	274,619.800	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	22.540	272,734.000	
MONGODB INC	2,800	142.300	398,440.000	
SNAP INC - A	45,800	9.820	449,756.000	
CORTEVA INC	29,868	65.570	1,958,444.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,500	106.590	1,652,145.000	
AMCOR PLC	61,400	12.110	743,554.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,400	138.000	1,159,200.000	
ROKU INC	4,800	54.180	260,064.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,500	147.140	1,103,550.000	
ACCENTURE PLC-CL A	26,200	287.980	7,545,076.000	
PENTAIR PLC	6,675	44.680	298,239.000	
QUALCOMM INC	46,300	118.380	5,480,994.000	
INVESCO LTD	14,100	18.840	265,644.000	

ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	147.930	377,221.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	89.840	952,304.000	
DATADOG INC - CLASS A	10,000	72.060	720,600.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,800	24.000	571,200.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,500	736.080	3,312,360.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,100	136.650	1,243,515.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	2,017.160	3,429,172.000	
ROSS STORES INC	14,500	116.790	1,693,455.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	132.690	508,202.700	
RESMED INC	6,100	223.200	1,361,520.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,930	149.010	734,619.300	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	76.210	342,945.000	
MODERNA INC	13,900	173.150	2,406,785.000	
HUBSPOT INC	1,880	282.680	531,438.400	
PERKINELMER INC	5,100	133.650	681,615.000	
CARRIER GLOBAL CORP	35,087	43.520	1,526,986.240	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,538	76.880	1,348,321.440	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,900	114.670	447,213.000	
AVANTOR INC	24,800	21.310	528,488.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	29.880	239,040.000	
DYNATRACE INC	8,100	36.390	294,759.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	18,300	48.690	891,027.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	38,685	22.910	886,273.350	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	26.530	291,830.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,400	43.070	620,208.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	48.590	156,945.700	
MATCH GROUP INC	11,600	46.880	543,808.000	
CHEVRON CORP	77,218	181.030	13,978,774.540	
ZSCALER INC	3,500	134.850	471,975.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,800	63.510	1,003,458.000	
ETSY INC	5,200	121.880	633,776.000	
TESLA INC	109,150	180.830	19,737,594.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,200	136.560	1,256,352.000	
GEN DIGITAL INC	23,600	22.620	533,832.000	
UNITY SOFTWARE INC	7,900	36.020	284,558.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	80.510	531,527.020	
SYNOPSYS INC	6,300	323.660	2,039,058.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,950	40.200	158,790.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,500	44.610	468,405.000	

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	385.280	1,889,798.400	
VIATRIS INC	49,021	11.180	548,054.780	
DOORDASH INC - A	7,850	53.340	418,719.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	29.830	435,518.000	
AIRBNB INC-CLASS A	15,600	95.380	1,487,928.000	
CBRE GROUP INC - A	13,600	76.460	1,039,856.000	
SOUTHERN CO/THE	44,000	65.730	2,892,120.000	
SYSCO CORP	21,100	85.090	1,795,399.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,903	187.210	1,853,940.630	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	58.500	146,250.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	61.380	282,348.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	102.640	805,724.000	
SCHLUMBERGER LTD	58,452	51.050	2,983,974.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	44.000	272,800.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	12.810	98,637.000	
AT&T INC	296,191	19.010	5,630,590.910	
APA CORP	14,400	46.590	670,896.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	39.250	237,462.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,000	70.720	1,272,960.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	48.870	425,169.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,200	241.570	2,464,014.000	
SEMPRA ENERGY	13,000	161.320	2,097,160.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	37.500	292,500.000	
CLARIVATE PLC	13,400	9.170	122,878.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,500	7.080	484,980.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	51.450	434,752.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	43.110	211,239.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,100	172.980	6,590,538.000	
SALESFORCE.COM INC	41,066	151.680	6,228,890.880	
WESTROCK CO	10,700	36.720	392,904.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,609	65.850	1,093,702.650	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,834	65.400	1,885,743.600	
TERADYNE INC	6,600	89.190	588,654.000	
UNION PACIFIC CORP	25,980	212.770	5,527,764.600	

MARATHON OIL CORP	29,900	30.350	907,465.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	123.470	2,961,798.360	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	61,479	97.430	5,989,898.970	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,400	184.890	5,620,656.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,804	212.500	1,658,350.000	
AMEREN CORPORATION	10,700	87.240	933,468.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,766	528.000	20,468,448.000	
APPROVIN CORP CLASS A	4,900	13.440	65,856.000	
VERISIGN INC	4,100	194.960	799,336.000	
LUCID GROUP INC	16,800	9.760	163,968.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	13,200	28.850	380,820.000	
VALERO ENERGY CORP	16,942	135.200	2,290,558.400	
ULTA BEAUTY INC	2,200	449.880	989,736.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	39.570	430,838.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	130.550	369,456.500	
ELEVANCE HEALTH INC	10,000	515.360	5,153,600.000	
WALT DISNEY CO/THE	75,262	94.690	7,126,558.780	
WELLS FARGO & CO	156,722	47.570	7,455,265.540	
WASTE MANAGEMENT INC	17,200	165.080	2,839,376.000	
WILLIAMS COS INC	50,400	34.320	1,729,728.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	219.010	1,007,446.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	145.980	350,352.000	
WALMART INC	62,600	152.970	9,575,922.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,700	119.000	1,035,300.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	80.290	361,305.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	55,900	2.830	158,197.000	
WABTEC CORP	7,111	98.700	701,855.700	
TJX COMPANIES INC	48,400	80.160	3,879,744.000	
WATERS CORP	2,500	330.160	825,400.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	266.820	587,004.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,400	41.080	1,248,832.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	238.500	1,159,825.500	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	36.030	457,581.000	
WEC ENERGY GROUP INC	13,000	96.980	1,260,740.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	58.290	1,189,116.000	



VISA INC-CLASS A SHARES	68,150	209.060	14,247,439.000	
PPL CORP	30,400	29.020	882,208.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,524	94.430	1,277,071.320	
PULTEGROUP INC	9,850	44.090	434,286.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	95,453	11.140	1,063,346.420	
PPG INDUSTRIES INC	9,800	131.830	1,291,934.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,200	91.760	752,432.000	
NVIDIA CORP	103,580	156.390	16,198,876.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,113	164.370	2,812,863.810	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	21.420	74,970.000	
TYSON FOODS INC-CL A	12,100	66.450	804,045.000	
NETFLIX INC	18,390	280.960	5,166,854.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,200	539.750	8,743,950.000	
NRG ENERGY INC	9,850	41.910	412,813.500	
GLOBE LIFE INC	3,855	117.300	452,191.500	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,400	121.570	899,618.000	
TEXTRON INC	8,900	70.330	625,937.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	18.560	283,726.720	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	250	2,506.380	626,595.000	
OMNICOM GROUP	8,300	78.760	653,708.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,220	122.770	640,859.400	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	20,900	1.050	21,945.000	
ORACLE CORP	66,233	80.850	5,354,938.050	
MASTERCARD INC - A	35,900	343.130	12,318,367.000	
ONEOK INC	18,500	64.910	1,200,835.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	5.470	204,315.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,400	425.250	1,871,100.000	
AMERCO NON VOTING SERIES N	3,600	60.180	216,648.000	
YUM! BRANDS INC	11,700	126.040	1,474,668.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,600	101.350	668,910.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	54.920	406,408.000	
BANK OF AMERICA CORP	299,901	37.000	11,096,337.000	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	408.780	776,682.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,700	97.120	747,824.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,500	154.420	4,092,130.000	
ANALOG DEVICES INC	21,491	163.890	3,522,159.990	
ADVANCED MICRO DEVICES	67,027	73.390	4,919,111.530	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	61.440	2,025,799.680	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	90.270	595,782.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	59.930	557,349.000	
AVERY DENNISON CORP	3,430	188.420	646,280.600	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,600	59.620	1,287,792.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,600	94.310	2,320,026.000	
AON PLC-CLASS A	8,800	302.730	2,664,024.000	
AMGEN INC	22,600	281.990	6,372,974.000	
EATON CORP PLC	16,536	162.150	2,681,312.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	253.640	1,699,388.000	
APPLIED MATERIALS INC	36,000	103.250	3,717,000.000	
CME GROUP INC	14,900	174.810	2,604,669.000	
ECOLAB INC	10,600	144.910	1,536,046.000	
EQUIFAX INC	5,100	188.920	963,492.000	
GILEAD SCIENCES INC	51,900	85.760	4,450,944.000	
KEURIG DR PEPPER INC	32,300	38.100	1,230,630.000	
HORMEL FOODS CORP	12,400	48.190	597,556.000	
STATE STREET CORP	15,213	73.930	1,124,697.090	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,140	80.390	4,834,654.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,800	55.340	1,151,072.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	52.620	452,532.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	80.230	399,545.400	
CARDINAL HEALTH INC	11,300	78.650	888,745.000	
FEDEX CORP	10,200	177.820	1,813,764.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	102.080	1,710,248.320	
FMC CORP	5,150	127.710	657,706.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,513	102.400	1,076,531.200	
INTEL CORP	169,200	28.900	4,889,880.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	34.310	548,960.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	75.830	1,019,913.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,900	224.370	2,894,373.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.410	247,426.000	

ILLUMINA INC	6,500	208.570	1,355,705.000	
SEALED AIR CORP	5,800	52.030	301,774.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,900	258.800	3,856,120.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	131.030	569,980.500	
SNAP-ON INC	2,200	239.180	526,196.000	
CARMAX INC	6,600	67.120	442,992.000	
DUKE ENERGY CORP	31,828	97.940	3,117,234.320	
TARGET CORP	19,400	166.370	3,227,578.000	
DOVER CORP	6,000	139.370	836,220.000	
WW GRAINGER INC	1,900	590.990	1,122,881.000	
CINTAS CORP	3,800	450.690	1,712,622.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,900	36.960	735,504.000	
CLOROX COMPANY	5,100	147.430	751,893.000	
ENERGY CORP	8,400	112.810	947,604.000	
MICROSOFT CORP	294,100	240.330	70,681,053.000	
INCYTE CORP	7,600	77.800	591,280.000	
CVS HEALTH CORP	54,169	100.880	5,464,568.720	
MEDTRONIC PLC	54,998	76.480	4,206,247.040	
MICRON TECHNOLOGY INC	46,200	55.120	2,546,544.000	
BLACKROCK INC	6,300	714.000	4,498,200.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	26,000	30.580	795,080.000	
HASBRO INC	5,400	62.170	335,718.000	
KELLOGG CO	10,400	72.400	752,960.000	
KEYCORP	38,600	18.570	716,802.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	57,211	66.050	3,778,786.550	
COOPER COS INC/THE	2,000	307.440	614,880.000	
CHUBB LTD	17,599	216.680	3,813,351.320	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	106.230	286,821.000	
ALLSTATE CORP	11,400	133.380	1,520,532.000	
EBAY INC	24,900	43.770	1,089,873.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	45,550	77.640	3,536,502.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	85.250	443,300.000	
DISH NETWORK CORP-A	9,600	15.680	150,528.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,600	214.940	2,063,424.000	
TRIMBLE INC	10,200	56.390	575,178.000	
LENNAR CORP-A	10,600	86.400	915,840.000	
LEAR CORP	2,500	140.150	350,375.000	
PROGRESSIVE CORP	24,200	131.120	3,173,104.000	

	PACCAR INC	14,437	104.260	1,505,201.620	
	BIOGEN INC	6,100	291.410	1,777,601.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,500	408.960	1,431,360.000	
	STARBUCKS CORP	47,400	98.660	4,676,484.000	
	PTC INC	4,600	123.070	566,122.000	
	EVERSOURCE ENERGY	14,300	80.650	1,153,295.000	
	INTUIT INC	11,080	379.710	4,207,186.800	
	BORGWARNER INC	9,700	41.930	406,721.000	
	BEST BUY CO INC	8,850	84.160	744,816.000	
	BALL CORP	13,004	54.740	711,838.960	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,097	44.500	2,629,816.500	
	ELECTRONIC ARTS INC	11,600	127.590	1,480,044.000	
	VULCAN MATERIALS CO	5,500	178.450	981,475.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,600	316.330	3,353,098.000	
	VF CORP	13,400	32.460	434,964.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	25,225	19.750	498,193.750	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	100.940	222,068.000	
	CARNIVAL CORP	40,900	9.750	398,775.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	15.140	330,052.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	184,790	35.480	6,556,349.200	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	48.600	422,820.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	48,600	3.980	193,428.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 1,414,769,604.940 (196,469,055,038)	
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	24.005	7,328,654.480	
	HALEON PLC	204,162	2.853	582,576.260	
	BP PLC	788,177	4.920	3,878,224.920	
	UNILEVER PLC	104,121	41.245	4,294,470.640	
	BARCLAYS PLC	683,263	1.610	1,100,053.430	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.891	299,790.760	
	PRUDENTIAL PLC	112,204	9.648	1,082,544.190	
	NATWEST GROUP PLC	218,395	2.605	568,918.970	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	21.370	150,957.680	
	BAE SYSTEMS PLC	128,820	8.104	1,043,957.280	
	AVIVA PLC	115,648	4.486	518,796.920	
	AVEVA GROUP PLC	4,948	31.760	157,148.480	

GSK	165,976	14.178	2,353,207.720	
INFORMA PLC	60,095	6.104	366,819.880	
MELROSE INDUSTRIES PLC	178,792	1.314	235,022.080	
AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.648	214,635.290	
DCC PLC	3,964	44.750	177,389.000	
OCADO GROUP PLC	23,827	6.170	147,012.590	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	112.100	325,090.000	
HALMA PLC	15,260	21.280	324,732.800	
ENTAIN PLC	24,059	13.975	336,224.520	
JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.244	124,076.650	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	5.960	179,801.280	
M&G PLC	104,504	1.922	200,908.940	
RELX PLC	78,540	22.900	1,798,566.000	
DIAGEO PLC	93,276	37.680	3,514,639.680	
RIO TINTO PLC	45,886	55.630	2,552,638.180	
STANDARD CHARTERED PLC	104,659	6.090	637,373.310	
TESCO PLC	306,336	2.330	713,762.880	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	10.780	380,652.580	
GLENCORE PLC	402,288	5.508	2,215,802.300	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	8.506	112,704.500	
SMITHS GROUP PLC	15,383	15.960	245,512.680	
PEARSON PLC	28,363	9.840	279,091.920	
SAINSBURY (J) PLC	71,864	2.231	160,328.580	
NEXT PLC	5,311	57.400	304,851.400	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.021	149,753.130	
WHITBREAD PLC	8,127	25.860	210,164.220	
BUNZL PLC	13,562	30.660	415,810.920	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	0.918	992,793.150	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	67.120	375,939.120	
KINGFISHER PLC	78,711	2.408	189,536.080	
WPP PLC	45,847	8.684	398,135.340	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	27,881	10.260	286,059.060	
SEVERN TRENT PLC	10,232	27.140	277,696.480	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	5.356	400,125.330	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,182	59.400	1,733,410.800	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	11.535	250,678.620	
SCHRODERS PLC	27,352	4.508	123,302.810	
SSE PLC	43,575	16.760	730,317.000	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	3.981	157,249.500	
ASTRAZENECA PLC	63,233	110.600	6,993,569.800	
FERGUSON PLC	8,777	94.900	832,937.300	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.544	609,768.810	
3I GROUP PLC	39,073	13.405	523,773.560	
ASHTED GROUP PLC	17,854	49.910	891,093.140	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.860	315,296.040	
NATIONAL GRID PLC	148,817	10.085	1,500,819.440	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.463	1,320,268.520	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	21.230	810,158.030	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	37.830	160,096.560	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,850	33.505	2,943,414.250	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	15.850	218,730.000	
HSBC HOLDINGS PLC	819,921	5.103	4,184,056.860	
ANGLO AMERICAN PLC	51,856	32.895	1,705,803.120	
MONDI PLC	19,853	15.560	308,912.680	
COMPASS GROUP PLC	72,800	18.305	1,332,604.000	
PERSIMMON PLC	12,832	12.700	162,966.400	
BT GROUP PLC	345,300	1.228	424,201.050	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	20.180	157,404.000	
BURBERRY GROUP PLC	16,061	21.400	343,705.400	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,523	47.450	356,966.350	
INTERTEK GROUP PLC	6,481	39.440	255,610.640	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,450	80.440	1,081,918.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	14.965	98,769.000	
ADMIRAL GROUP PLC	7,500	20.270	152,025.000	
ANTOFAGASTA PLC	15,300	13.640	208,692.000	
ABRDN PLC	84,362	2.052	173,110.820	
EXPERIAN PLC	37,575	28.690	1,078,026.750	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 74,742,607.850 (12,424,463,703)	
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	20.450	1,053,134.100	
AZRIELI GROUP LTD	1,826	243.000	443,718.000	

	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	151.500	687,961.500	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	89,000	6.255	556,695.000	
	ICL GROUP LTD	30,461	28.580	870,575.380	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	578.400	636,240.000	
	BANK HAPOALIM BM	54,645	32.990	1,802,738.550	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	66,426	31.480	2,091,090.480	
	NICE LTD	2,731	650.900	1,777,607.900	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	126.900	813,048.300	
	イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 10,732,809.210 (432,897,127)	
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	4.560	387,372.000	
	TELSTRA GROUP LTD	156,394	4.000	625,576.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	2.910	305,823.540	
	BHP GROUP LTD	197,318	44.820	8,843,792.760	
	SOUTH32 LTD	177,077	4.070	720,703.390	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	74,059	36.830	2,727,592.970	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,005	19.460	1,284,457.300	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,031	31.690	3,962,232.390	
	WESTPAC BANKING CORP	136,277	23.830	3,247,480.910	
	SANTOS LTD	125,413	7.330	919,277.290	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	116,889	24.910	2,911,704.990	
	RIO TINTO LTD	14,467	107.830	1,559,976.610	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,887	7.970	549,029.390	
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	3.740	252,824.000	
	XERO LTD	5,135	69.500	356,882.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	27.890	220,331.000	
	COLES GROUP LTD	52,080	17.060	888,484.800	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,400	55.570	300,078.000	
	IDP EDUCATION LTD	7,900	29.450	232,655.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	10.540	469,915.360	
	EVOLUTION MINING LTD	65,600	2.670	175,152.000	
	REECE LTD	10,500	15.500	162,750.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.040	360,870.400	
	SEEK LTD	12,845	22.230	285,544.350	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	13.660	376,046.140	
	NEWCREST MINING LTD	34,097	19.630	669,324.110	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,519	108.090	7,190,038.710	
	AMPOL LTD	8,800	28.510	250,888.000	
	ORICA LTD	17,751	14.970	265,732.470	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	12.960	729,246.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	47,331	34.990	1,656,111.690	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	6.190	219,553.110	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,415	29.400	512,001.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,198	178.000	2,527,244.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	35.450	812,124.050	
	CSL LTD	18,775	302.580	5,680,939.500	
	WESFARMERS LTD	44,206	48.360	2,137,802.160	
	COCHLEAR LTD	2,510	211.420	530,664.200	
	BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	17.110	304,558.000	
	SUNCORP GROUP LTD	48,015	12.000	576,180.000	
	ASX LTD	7,365	69.330	510,615.450	
	COMPUTERSHARE LTD	20,689	27.660	572,257.740	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	96,410	4.800	462,768.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	31.680	548,951.040	
	BRAMBLES LTD	56,158	12.020	675,019.160	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,666	83.770	558,410.820	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	65.440	456,313.120	
	REA GROUP LTD	2,023	122.750	248,323.250	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	65.600	144,320.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 60,365,938.910 (5,601,355,471)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	61.250	2,051,875.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	77.980	740,810.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	2,109.030	1,687,224.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	88.290	1,031,845.230	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	51.260	917,554.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,150	199.300	1,424,995.000	
	BCE INC	4,930	64.010	315,569.300	



FRANCO-NEVADA CORP	7,800	192.780	1,503,684.000	
SUNCOR ENERGY INC	58,230	45.430	2,645,388.900	
METRO INC/CN	9,600	77.850	747,360.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	98.420	1,318,828.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	69.670	3,358,094.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,600	64.190	2,349,354.000	
TORONTO-DOMINION BANK	73,700	89.590	6,602,783.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,400	32.040	365,256.000	
ROYAL BANK OF CANADA	57,550	133.770	7,698,463.500	
TOURMALINE OIL CORP	12,900	81.100	1,046,190.000	
TC ENERGY CORP	39,750	61.260	2,435,085.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,329	48.320	1,078,937.280	
BARRICK GOLD CORP	72,100	21.580	1,555,918.000	
CAE INC	12,600	28.700	361,620.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	154.200	1,050,410.400	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	36.580	237,770.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	108.190	378,665.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,150	64.230	395,014.500	
HYDRO ONE LTD	13,100	36.610	479,591.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,760	121.260	819,717.600	
NORTHLAND POWER INC	9,400	37.640	353,816.000	
WSP GLOBAL INC	5,000	160.150	800,750.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	101.810	335,973.000	
PARKLAND CORP	5,800	28.000	162,400.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	28.930	173,580.000	
EMERA INC	10,400	51.580	536,432.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	141.940	468,402.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	36.320	174,336.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,400	61.380	883,872.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	97.110	155,376.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,600	11.460	281,916.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,517	67.760	1,254,711.920	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	9.910	264,597.000	
AIR CANADA	6,500	18.920	122,980.000	
KINROSS GOLD CORP	53,000	5.470	289,910.000	
BANK OF MONTREAL	27,300	130.540	3,563,742.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	33.480	743,256.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	46,300	50.450	2,335,835.000	
NUTRIEN LTD	22,319	110.870	2,474,507.530	

BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,300	42.620	225,886.000	
CAMECO CORP	15,800	31.650	500,070.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	169.680	254,520.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	38.220	271,362.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	20.790	110,187.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	38.810	100,906.000	
TELUS CORP	10,800	28.560	308,448.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	19,400	48.010	931,394.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	148.900	327,580.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	80.710	3,761,086.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	786.000	786,000.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	81.840	924,792.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,937	169.860	498,878.820	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	20.740	161,772.000	
BLACKBERRY LTD	22,400	6.550	146,720.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,800	62.670	1,491,546.000	
ENBRIDGE INC	82,100	55.520	4,558,192.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	57,125	61.060	3,488,052.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	78,000	23.950	1,868,100.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	9.260	104,638.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	37,720	108.920	4,108,462.400	
IA FINANCIAL CORP INC	4,400	75.540	332,376.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	38.170	286,275.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,750	169.990	4,037,262.500	
CGI INC - CLASS A	8,700	115.630	1,005,981.000	
ONEX CORPORATION	2,900	68.840	199,636.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	36.720	697,680.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	38.810	120,311.000	
TMX GROUP LTD	2,300	138.200	317,860.000	
OPEN TEXT CORP	11,000	39.410	433,510.000	
SAPUTO INC	10,200	32.260	329,052.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	31.320	729,756.000	
FORTIS INC	19,300	53.450	1,031,585.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	72.370	318,428.000	
LUNDIN MINING CORP	24,600	8.240	202,704.000	
CENOVUS ENERGY INC	55,500	27.680	1,536,240.000	

	DOLLARAMA INC	11,200	81.440	912,128.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	22.420	248,862.000	
	KEYERA CORP	8,800	30.410	267,608.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	19.370	553,982.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 98,464,224.380 (10,059,105,163)	
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	3.670	394,158.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,800	30.800	1,564,640.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	77,900	34.950	2,722,605.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.470	295,243.250	
	KEPPEL CORP LTD	62,700	7.530	472,131.000	
	UOL GROUP LTD	20,000	6.490	129,800.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.260	132,986.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	145,700	12.370	1,802,309.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.875	208,250.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.300	193,760.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,350	2.730	970,105.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	3.490	218,823.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.140	326,298.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.090	327,200.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 9,758,308.750 (985,979,516)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	CS GROUP ANR RIGHTS AG	104,049	0.099	10,300.850	
	UBS GROUP AG-REG	140,483	17.350	2,437,380.050	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	372.800	439,904.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	645.500	180,740.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,360	32.430	206,254.800	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	28,061	309.250	8,677,864.250	
	SIKA AG-REG	5,834	232.800	1,358,155.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	97,400.000	389,600.000	
	ABB LTD-REG	65,605	29.430	1,930,755.150	
	SWISS RE AG	12,047	84.520	1,018,212.440	

NESTLE SA-REG	112,433	111.260	12,509,295.580	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	908.400	817,560.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	179.300	287,059.300	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	2.902	301,950.190	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	53.940	469,709.520	
SGS SA-REG	252	2,185.000	550,620.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	170.800	159,527.200	
TEMENOS AG - REG	2,500	57.300	143,250.000	
VAT GROUP AG	1,050	257.800	270,690.000	
ALCON INC	19,959	64.160	1,280,569.440	
SIG GROUP N AG	13,000	20.060	260,780.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,159	245.500	284,534.500	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,010	452.000	2,716,520.000	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	142.300	256,140.000	
CLARIANT AG-REG	8,678	15.590	135,290.020	
NOVARTIS AG-REG	86,320	83.300	7,190,456.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	1,920.000	270,720.000	
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	87.700	109,625.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,849	119.950	2,500,837.550	
SWISSCOM AG-REG	1,036	504.800	522,972.800	
GEBERIT AG-REG	1,433	445.600	638,544.800	
GIVAUDAN-REG	369	3,126.000	1,153,494.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	105.500	463,039.500	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	241.800	510,198.000	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,929	55.480	384,420.920	
LONZA GROUP AG-REG	2,974	486.300	1,446,256.200	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	45.740	86,906.000	
HOLCIM LTD	21,829	48.930	1,068,092.970	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	503.000	622,211.000	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	225.200	480,802.000	
SWISS PRIME SITE-REG	3,025	78.300	236,857.500	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,760.000	409,920.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 55,188,016.730 (8,039,238,397)	
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	222.900	1,766,259.600	
INVESTOR CLASS A	21,458	198.550	4,260,485.900	

VOLVO CAR CLASS B	24,808	49.735	1,233,825.880	
ERICSSON LM-B SHS	125,588	64.480	8,097,914.240	
VOLVO AB-B SHS	64,930	190.680	12,380,852.400	
SKF AB-B SHARES	16,495	173.100	2,855,284.500	
ELECTROLUX AB-SER B	8,600	145.580	1,251,988.000	
SWEDISH MATCH AB	65,778	115.200	7,577,625.600	
TELE2 AB-B SHS	24,423	93.260	2,277,688.980	
GETINGE AB-B SHS	9,200	238.500	2,194,200.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	70,028	119.550	8,371,847.400	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	62,759	104.300	6,545,763.700	
SWEDBANK AB - A SHARES	38,966	167.450	6,524,856.700	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	31,425	117.620	3,696,208.500	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	26,069	141.600	3,691,370.400	
SKANSKA AB-B SHS	14,638	170.800	2,500,170.400	
SANDVIK AB	45,700	192.000	8,774,400.000	
INVESTOR AB-B SHS	78,394	191.420	15,006,179.480	
ATLAS COPCO AB-A SHS	115,575	128.960	14,904,552.000	
VOLVO AB-A SHS	8,000	201.400	1,611,200.000	
HOLMEN AB-B SHARES	3,906	430.300	1,680,751.800	
SECURITAS AB-B SHS	11,950	88.280	1,054,946.000	
TELIA CO AB	110,667	28.850	3,192,742.950	
ALFA LAVAL AB	12,700	295.500	3,752,850.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	67,161	116.400	7,817,540.400	
ASSA ABLOY AB-B	43,126	238.400	10,281,238.400	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	265.000	1,389,395.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	46.890	1,231,706.520	
INDUTRADE AB	11,371	219.800	2,499,345.800	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	219.100	1,540,711.200	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	468.000	1,404,000.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	205.200	1,169,640.000	
LIFCO AB-B SHS	9,500	176.800	1,679,600.000	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,208	97.860	6,381,254.880	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,204	255.400	6,692,501.600	
EMBRACER GROUP AB	26,594	44.925	1,194,735.450	
BOLIDEN AB	11,387	380.500	4,332,753.500	
EPIROC AB-A	27,436	197.450	5,417,238.200	
EPIROC AB-B	16,780	170.000	2,852,600.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	80.320	1,369,456.000	

	NORDEA BANK ABP	146,748	109.860	16,121,735.280	
	EQT AB	12,318	236.000	2,907,048.000	
	EVOLUTION AB	7,867	1,043.400	8,208,427.800	
	KINNEVIK AB - B	10,431	158.650	1,654,878.150	
	HEXAGON AB-B SHS	83,750	117.900	9,874,125.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	263.700	1,634,940.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 222,858,835.610 (2,928,365,100)	
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	879.900	61,685,389.500	
	DANSKE BANK A/S	29,678	127.150	3,773,557.700	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	14,690.000	1,924,390.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	43,042	176.080	7,578,835.360	
	GN STORE NORD A/S	5,465	168.300	919,759.500	
	CARLSBERG AS-B	4,180	903.800	3,777,884.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,800	409.900	3,607,120.000	
	COLOPLAST-B	5,112	863.400	4,413,700.800	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	1,106.500	9,161,820.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,575.000	582,750.000	
	DEMANT A/S	4,275	200.600	857,565.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	15,085.000	3,469,550.000	
	TRYG A/S	14,990	164.550	2,466,604.500	
	PANDORA A/S	4,000	503.800	2,015,200.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	435.800	1,873,940.000	
	GENMAB A/S	2,829	3,180.000	8,996,220.000	
	ORSTED A/S	8,140	604.200	4,918,188.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 122,022,474.360 (2,356,253,980)	
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	4.740	248,850.000	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.245	157,350.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,530	5.175	416,742.750	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.820	407,523.660	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	22.810	552,002.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル	

				1,782,468.410	
				(153,524,004)	
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	190.800	7,636,770.000	
	NORSK HYDRO ASA	57,866	73.080	4,228,847.280	
	ORKLA ASA	32,317	69.380	2,242,153.460	
	TELENOR ASA	29,131	97.920	2,852,507.520	
	EQUINOR ASA	42,051	377.000	15,853,227.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,124	465.300	3,314,797.200	
	MOWI ASA	17,800	153.650	2,734,970.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	187.600	1,510,180.000	
	AKER BP ASA	13,597	339.600	4,617,541.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	400.000	1,489,200.000	
	SALMAR ASA	2,452	332.800	816,025.600	
	ADEVINTA ASA	12,000	76.300	915,600.000	
ノルウェー・クローネ	小計			ノルウェー・クローネ 48,211,819.260 (670,144,288)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	29,169	22.250	649,010.250	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	30.960	554,245.920	
	EXOR NV	4,500	73.900	332,550.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	4,600	106.450	489,670.000	
	BAYER AG-REG	39,442	55.960	2,207,174.320	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	18.535	148,280.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	10.210	830,358.880	
	COMMERZBANK AG	42,031	8.012	336,752.370	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	181.700	218,040.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,451	137.840	1,027,045.840	
	SIEMENS AG-REG	30,742	133.080	4,091,145.360	
	E.ON SE	90,136	9.086	818,975.690	
	UNIPER SE	6,650	4.788	31,840.200	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,293	84.750	1,126,581.750	
	GEA GROUP AG	5,800	38.900	225,620.000	
	CONTINENTAL AG	4,342	57.880	251,314.960	
	BASF SE	36,875	49.060	1,809,087.500	
	ALLIANZ SE-REG	16,411	205.600	3,374,101.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,168	68.380	490,147.840	

RHEINMETALL AG	1,813	193.450	350,724.850	
RWE AG	25,791	41.740	1,076,516.340	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	7.592	166,644.400	
BRENNTAG SE	6,090	60.580	368,932.200	
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	26.270	433,008.410	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	19.140	73,478.460	
SAP SE	41,960	103.080	4,325,236.800	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,625	301.500	1,695,937.500	
ZALANDO SE	8,783	29.250	256,902.750	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	52.480	299,555.840	
KION GROUP AG	2,700	27.110	73,197.000	
COVESTRO AG	7,300	38.230	279,079.000	
RATIONAL AG	190	582.500	110,675.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	353.400	427,614.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	58.000	350,030.000	
DELIVERY HERO SE	6,443	39.380	253,725.340	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	126.900	202,024.800	
BECHTLE AG	3,238	34.010	110,124.380	
NEMETSCHKE SE	2,284	45.650	104,264.600	
SCOUT24 AG	3,600	51.100	183,960.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	2.336	88,768.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	50.440	559,732.680	
KNORR-BREMSE AG	2,800	54.000	151,200.000	
HELLOFRESH SE	6,516	22.660	147,652.560	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	15.670	270,934.300	
BEIERSDORF AG	3,980	102.950	409,741.000	
MERCK KGAA	5,189	172.100	893,026.900	
ADIDAS AG	7,200	120.940	870,768.000	
PUMA SE	4,163	47.850	199,199.550	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	64.500	264,514.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	130,122	19.464	2,532,694.600	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	29.660	239,356.200	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	62.540	2,032,550.000	
QIAGEN N.V.	9,105	47.180	429,573.900	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,430	30.600	1,604,358.000	
HANNOVER RUECK SE	2,378	181.200	430,893.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,796	37.840	1,505,880.640	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,628	172.500	1,315,830.000	



MTU AERO ENGINES AG	2,104	197.400	415,329.600	
SYMRISE AG	5,228	107.650	562,794.200	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.268	93,695.610	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,200	80.150	176,330.000	
VONOVIA SE	28,770	23.800	684,726.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	61.560	172,368.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	14.080	491,392.000	
NN GROUP NV	11,292	40.330	455,406.360	
ARCELORMITTAL	25,700	25.940	666,658.000	
HEINEKEN NV	10,407	88.700	923,100.900	
AEGON NV	72,059	4.670	336,515.530	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,983	27.940	1,173,005.020	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	68.280	484,788.000	
KONINKLIJKE DSM NV	7,017	119.950	841,689.150	
WOLTERS KLUWER	10,540	104.300	1,099,322.000	
ING GROEP NV	156,862	11.662	1,829,324.640	
KONINKLIJKE KPN NV	132,781	2.911	386,525.490	
ASML HOLDING NV	16,320	559.800	9,135,936.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	12.280	205,076.000	
IMCD NV	2,246	139.150	312,530.900	
ADYEN NV	870	1,427.000	1,241,490.000	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	20.940	151,186.800	
PROSUS NV	35,480	60.270	2,138,379.600	
JDE PEET'S NV	3,700	29.200	108,040.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,883	256.150	482,330.450	
RANDSTAD NV	4,720	55.740	263,092.800	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	72.500	308,125.000	
OCI NV	4,386	39.940	175,176.840	
TOTALENERGIES SE	99,542	58.940	5,867,005.480	
MICHELIN (CGDE)	26,740	26.440	707,005.600	
AIR LIQUIDE SA	20,995	138.760	2,913,266.200	
KERING	3,004	552.600	1,660,010.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,787	138.880	3,025,778.560	
BOUYGUES SA	9,062	29.720	269,322.640	
BNP PARIBAS	44,602	53.570	2,389,329.140	
THALES SA	4,291	121.850	522,858.350	

DANONE	25,708	50.300	1,293,112.400	
CARREFOUR SA	24,454	16.510	403,735.540	
VIVENDI	29,591	8.550	253,003.050	
L'OREAL	9,688	347.500	3,366,580.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,987	44.180	883,025.660	
LEGRAND SA	10,737	78.060	838,130.220	
PERNOD RICARD SA	8,411	186.950	1,572,436.450	
EURAZEO SE	1,724	60.500	104,302.000	
SOCIETE GENERALE SA	31,964	24.075	769,533.300	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	11,146	702.000	7,824,492.000	
ACCOR SA	6,717	24.880	167,118.960	
CAPGEMINI SE	6,574	172.750	1,135,658.500	
VALEO SA	8,400	17.630	148,092.000	
PUBLICIS GROUPE	9,179	63.000	578,277.000	
BUREAU VERITAS SA	11,605	25.170	292,097.850	
EIFFAGE	3,285	94.440	310,235.400	
SODEXO SA	3,491	91.040	317,820.640	
IPSEN	1,400	108.800	152,320.000	
AMUNDI SA	2,250	52.600	118,350.000	
TELEPERFORMANCE	2,315	214.000	495,410.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	26.200	94,320.000	
EURONEXT NV	3,300	71.780	236,874.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	67.040	355,043.840	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	315.700	347,270.000	
SEB SA	997	76.800	76,569.600	
ESSILORLUXOTTICA	11,549	175.500	2,026,849.500	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	151.200	151,200.000	
WORLDLINE SA	9,606	44.810	430,444.860	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	37.410	155,737.830	
AXA SA	76,206	27.355	2,084,615.130	
EDENRED	10,044	52.620	528,515.280	
RENAULT SA	7,755	33.780	261,963.900	
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,484.000	1,887,648.000	
STMICROELECTRONICS NV	27,439	35.750	980,944.250	
REMY COINTREAU	900	161.800	145,620.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	26,758	34.755	929,974.290	
WENDEL	930	87.050	80,956.500	
ORANGE	80,096	9.844	788,465.020	

ALSTOM	12,525	24.560	307,614.000	
SANOFI	45,721	88.190	4,032,134.990	
VINCI SA	21,423	96.590	2,069,247.570	
AIRBUS SE	23,736	109.180	2,591,496.480	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	24.320	636,673.280	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	9.606	471,923.560	
BIOMERIEUX	1,691	96.060	162,437.460	
ENGIE	73,328	14.360	1,052,990.080	
EDF	22,120	12.000	265,440.000	
SAFRAN SA	13,722	116.500	1,598,613.000	
ARKEMA	2,395	83.940	201,036.300	
ADP	1,110	145.700	161,727.000	
GETLINK SE	17,345	15.905	275,872.220	
BOLLORE	35,675	5.235	186,758.620	
UCB SA	4,976	77.140	383,848.640	
KBC GROUP NV	9,843	52.520	516,954.360	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	77.060	323,652.000	
SOLVAY SA	2,984	94.140	280,913.760	
UMICORE	8,269	34.220	282,965.180	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,872	56.200	1,959,806.400	
AGEAS	6,290	37.810	237,824.900	
D' IETEREN GROUP	1,036	178.000	184,408.000	
PROXIMUS	6,035	10.155	61,285.420	
ELIA GROUP SA/NV	1,333	134.200	178,888.600	
SOFINA	600	211.000	126,600.000	
ARGENX SE	2,229	364.300	812,024.700	
PRYSMIAN SPA	10,040	33.720	338,548.800	
ASSICURAZIONI GENERALI	44,600	16.940	755,524.000	
MEDIOBANCA SPA	24,407	9.256	225,911.190	
TENARIS SA	18,608	16.380	304,799.040	
UNICREDIT SPA	83,217	12.960	1,078,492.320	
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.217	82,422.960	
INTESA SANPAOLO	663,075	2.134	1,415,333.580	
ATLANTIA SPA	19,531	22.930	447,845.830	
POSTE ITALIANE SPA	21,074	9.422	198,559.220	
MONCLER SPA	8,261	48.000	396,528.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,217	40.010	168,722.170	
ENI SPA	101,329	14.196	1,438,466.480	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	21,064	10.035	211,377.240	

DIASORIN SPA	1,000	128.900	128,900.000
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.386	120,140.800
NEXI SPA	19,900	8.340	165,966.000
AMPLIFON SPA	4,700	27.110	127,417.000
ENEL SPA	326,535	5.106	1,667,287.710
SNAM SPA	79,350	4.797	380,641.950
TERNA SPA	55,464	7.198	399,229.870
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	15.200	612,028.000
FINECOBANK SPA	23,200	15.120	350,784.000
STELLANTIS NV	88,350	14.710	1,299,628.500
FERRARI NV	5,061	208.500	1,055,218.500
TELEFONICA SA	210,478	3.590	755,616.020
ENDESA SA	12,100	17.545	212,294.500
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,700	5.624	1,505,544.800
IBERDROLA SA	239,538	10.655	2,552,277.390
REPSOL SA	57,201	14.635	837,136.630
GRIFOLS SA	11,830	9.944	117,637.520
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.835	1,934,760.890
AMADEUS IT GROUP SA	18,086	50.860	919,853.960
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.220	270,066.000
CAIXABANK SA	174,927	3.548	620,640.990
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.830	238,143.080
AENA SME SA	2,900	121.350	351,915.000
CELLNEX TELECOM SA	21,460	32.610	699,810.600
ACCIONA SA	1,028	181.300	186,376.400
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	43,794	24.920	1,091,346.480
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	18.010	169,546.140
ENAGAS SA	9,884	17.300	170,993.200
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	16.985	266,664.500
FERROVIAL SA	19,018	25.530	485,529.540
UPM-KYMMENE OYJ	21,428	34.660	742,694.480
NOKIA OYJ	217,254	4.571	993,068.030
WARTSILA OYJ ABP	19,124	8.170	156,243.080
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	14.040	300,456.000
ELISA OYJ	5,725	49.560	283,731.000

	SAMPO OYJ-A SHS	19,622	48.330	948,331.260	
	FORTUM OYJ	16,900	15.020	253,838.000	
	KESKO OYJ-B SHS	10,400	20.530	213,512.000	
	KONE OYJ-B	13,375	48.500	648,687.500	
	NESTE OYJ	16,985	46.690	793,029.650	
	ORION OYJ-CLASS B	4,000	50.420	201,680.000	
	VERBUND AG	2,740	85.700	234,818.000	
	OMV AG	5,650	49.580	280,127.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	13,546	29.420	398,523.320	
	VOESTALPINE AG	4,250	26.200	111,350.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,948	34.730	345,494.040	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,076	54.040	328,347.040	
	JERONIMO MARTINS	11,416	21.340	243,617.440	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.420	483,548.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	20,196	11.590	234,071.640	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,594	21.730	251,937.620	
	KERRY GROUP PLC-A	6,272	90.860	569,873.920	
	CRH PLC	30,632	38.370	1,175,349.840	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,704	138.650	929,509.600	
ユーロ 小計				ユーロ 176,596,804.590 (25,355,769,203)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	40.000	2,320,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	94,000	45.650	4,291,100.000	
	MTR CORP	66,500	37.250	2,477,125.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	92.700	5,608,350.000	
	SINO LAND CO	142,000	9.990	1,418,580.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	44.250	4,941,353.250	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	21,500	60.200	1,294,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	70,000	56.500	3,955,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	24.300	1,446,020.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	482,475	6.600	3,184,335.000	
	HANG SENG BANK LTD	32,900	119.400	3,928,260.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	18.520	1,176,020.000	
	WH GROUP LTD	361,000	4.500	1,624,500.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	51,100	300.000	15,330,000.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	87,000	13.460	1,171,020.000	

XINYI GLASS HOLDINGS LTD	78,000	14.380	1,121,640.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	17.580	791,100.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	47.150	4,298,618.350	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	38.900	1,030,850.000	
AIA GROUP LTD	509,600	76.200	38,831,520.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	15.240	822,960.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	36.050	2,595,600.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	74,100	21.300	1,578,330.000	
ESR CAYMAN LTD	86,200	16.660	1,436,092.000	
SANDS CHINA LTD	104,400	19.880	2,075,472.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	13.520	1,108,640.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	88.900	5,111,750.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	159,000	24.950	3,967,050.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 118,935,585.700 (2,114,674,714)	
合計			267,590,825,704 [267,590,825,704]	

## (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	996,901.230	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,607	1,598,278.220	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,200	438,278.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	159,377.070	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,500	1,325,475.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	14,800	940,984.000	
		EQUINIX INC	3,808	2,555,015.680	
		AMERICAN TOWER CORP	18,900	4,105,458.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	541,942.380	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	422,630.000	
		KIMCO REALTY CORP	25,000	568,000.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15,500	308,915.000			

	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,000	567,270.000	
	INVITATION HOMES INC	25,200	804,384.000	
	VICI PROPERTIES INC	39,800	1,340,066.000	
	VENTAS INC	16,500	749,100.000	
	WEYERHAEUSER CO	30,814	978,652.640	
	CROWN CASTLE INTL CORP	17,900	2,490,069.000	
	IRON MOUNTAIN INC	11,800	635,548.000	
	SUN COMMUNITIES INC	5,000	724,050.000	
	PROLOGIS INC	38,154	4,342,306.740	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,400	976,128.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,200	494,550.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,700	579,123.000	
	WELLTOWER INC	18,800	1,300,960.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	561,516.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	777,216.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	471,096.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	17,900	379,659.000	
	REALTY INCOME CORP	24,895	1,550,958.500	
	PUBLIC STORAGE	6,500	1,888,900.000	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	414,666.000	
	UDR INC	12,900	525,675.000	
	WP CAREY INC	8,000	625,760.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	1,283,250.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,600	859,712.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	314,116.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 39,595,986.460 (5,498,694,640)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	175,735.300	
	SEGRO PLC	48,274	390,247.010	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	143,243.560	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 709,225.870 (117,894,616)	
	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	40,978	322,087.080	
	LENLEASE GROUP	25,300	192,786.000	

	TRANSURBAN GROUP	119,689	1,698,386.910	
	APA GROUP	45,041	505,810.430	
	SCENTRE GROUP	203,007	596,840.580	
	GPT GROUP	73,031	319,145.470	
	MIRVAC GROUP	144,900	321,678.000	
	STOCKLAND	91,123	346,267.400	
	GOODMAN GROUP	65,537	1,224,886.530	
	VICINITY CENTRES	151,865	308,285.950	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,836,174.350 (541,538,618)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	147,220.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	123,366.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 270,586.000 (27,643,066)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	144,500	398,820.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	457,745.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	140,800	226,688.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	101,300	175,249.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,258,502.600 (127,159,103)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	239,108.000	
	GECINA SA	1,817	172,160.750	
	KLEPIERRE	8,527	189,981.560	
	COVIVIO	2,000	112,700.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	159,258.240	
ユーロ 小計			ユーロ 873,208.550 (125,375,284)	
香港・ドル	LINK REIT	90,800	4,776,080.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	594,920.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	163,000	1,527,310.000	



	香港・ドル 小計		香港・ドル 6,898,310.000 (122,651,952)
投資証券	合計		6,560,957,279 [6,560,957,279]
合計			6,560,957,279 [6,560,957,279]

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 597銘柄 投資証券 37銘柄	97.3%	2.7%	73.6%
イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	99.1%	0.9%	4.6%
イスラエル・シケル	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%	2.2%
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 42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%	-%	0.9%
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	94.5%	5.5%	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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	659,917,348	780,150,979
コール・ローン	600,473,265	1,045,319,129
株式	13,499,628,357	19,364,127,629
投資証券	1,239,446,103	2,137,550,364
派生商品評価勘定	-	159
未収配当金	13,553,472	96,179,202
差入委託証拠金	205,263,401	679,446,519
流動資産合計	16,218,281,946	24,102,773,981
資産合計	16,218,281,946	24,102,773,981
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	80,747,580	116,746,252
未払金	-	420,178,653
未払解約金	11,533,875	5,223,931
その他未払費用	-	13,887
流動負債合計	92,281,455	542,162,723
負債合計	92,281,455	542,162,723
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,761,904,042	11,961,794,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,364,096,449	11,598,816,568
元本等合計	16,126,000,491	23,560,611,258
純資産合計	16,126,000,491	23,560,611,258
負債純資産合計	16,218,281,946	24,102,773,981

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	7,600,562,331円	8,761,904,042円
期中追加設定元本額	2,668,922,872円	3,615,384,570円
期中一部解約元本額	1,507,581,161円	415,493,922円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投 資家専用）	39,405,208円	62,994,567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）	277,391,903円	290,206,546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）	270,194,117円	351,550,275円
D - I ' s 新興国株式イン デックス	125,705,126円	134,112,257円
i F r e e 新興国株式イン デックス	3,749,273,501円	4,771,431,065円
i F r e e 8資産バランス ダイワ新興国株式インデック ス（為替ヘッジなし）（投資 一任専用）	2,353,124,357円	3,025,622,618円
新興国株式ファンダメンタ ル・インデックスファンド （為替ヘッジなし/適格機関 投資家専用）	- 円	5,718,844円
DCダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	314,532,254円	1,479,007,486円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	1,182,115,153円	1,393,775,876円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	363,852,121円	350,319,215円
計	86,310,302円	97,055,941円
	8,761,904,042円	11,961,794,690円
2. 期末日における受益権の総数	8,761,904,042口	11,961,794,690口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	559,723,185	2,665,555
投資証券	67,043,105	52,046,810
合計	626,766,290	49,381,255

（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7月6日から2021年11月30日まで、及び2022年7月6日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,381,410,130	-	1,302,515,754	78,894,376	1,970,664,592	-	1,905,301,261	65,363,331
合計	1,381,410,130	-	1,302,515,754	78,894,376	1,970,664,592	-	1,905,301,261	65,363,331

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	440,698	-	440,539	159
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	440,698	-	440,539	159
買 建	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204	1,170,424,324	-	1,119,041,403	51,382,921
アメリカ・ドル	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204	1,117,089,424	-	1,065,709,503	51,379,921
香港・ドル	-	-	-	-	53,334,900	-	53,331,900	3,000
合計	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204	1,170,865,022	-	1,119,481,942	51,382,762

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)



	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8405円 (18,405円)	1.9697円 (19,697円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	JOYY INC-ADR	4,200	29.910	125,622.000	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	35,900	10.090	362,231.000	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	55,700	5.770	321,389.000	
	CANADIAN SOLAR INC	5,400	33.820	182,628.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	33,000	1.610	53,130.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	3,400	45.740	155,516.000	
	BANK VTB	382,434,000	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	1,829	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	19,500	29.200	569,400.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4	0.000	0.000	
SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000		
TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000		
SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000		
INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000		
ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000		

	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,769,916.000 (245,788,235)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	477,270	106.100	50,638,347.000	
	AXIS BANK LTD	57,955	892.550	51,727,735.250	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,550	8,910.200	22,721,010.000	
	TATA POWER CO LTD	62,546	223.450	13,975,903.700	
	BANK OF BARODA	101,129	167.800	16,969,446.200	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,566	2,634.200	27,832,957.200	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	58,785	238.500	14,020,222.500	
	STATE BANK OF INDIA	83,656	608.550	50,908,858.800	
	NTPC LTD	193,405	170.150	32,907,860.750	
	JSW STEEL LTD	35,041	732.550	25,669,284.550	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	141,550	219.350	31,048,992.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	239,492	75.300	18,033,747.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	76,540	339.050	25,950,887.000	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	30,388	515.000	15,649,820.000	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,897	6,928.900	13,144,123.300	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,517	820.600	4,527,250.200	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,020	1,270.300	11,458,106.000	
	TECH MAHINDRA LTD	13,202	1,074.550	14,186,209.100	
	YES BANK LTD	878,240	17.050	14,973,992.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	28,175	227.450	6,408,403.750	
	REC LTD	96,688	109.450	10,582,501.600	
	COAL INDIA LTD	184,298	227.200	41,872,505.600	
	INDUS TOWERS LTD	41,172	199.450	8,211,755.400	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	78,703	143.550	11,297,815.650	
	GAIL INDIA LTD	210,454	94.150	19,814,244.100	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	74,018	435.950	32,268,147.100	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	14,811	1,719.150	25,462,330.650	
	WIPRO LTD	15,583	405.150	6,313,452.450	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	15,639	3,397.350	53,131,156.650	
	INFOSYS LTD	60,275	1,629.050	98,190,988.750	
	LARSEN & TOUBRO LTD	21,447	2,050.550	43,978,145.850	

	TATA MOTORS LTD	145,111	433.150	62,854,829.650	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	41,893	2,665.250	111,655,318.250	
	ICICI BANK LTD	32,064	946.750	30,356,592.000	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	82,302	2,712.200	223,219,484.400	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	247,158	140.250	34,663,909.500	
	ITC LTD	104,071	342.300	35,623,503.300	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	40,770	1,257.100	51,251,967.000	
	HERO MOTOCORP LTD	6,406	2,828.250	18,117,769.500	
	BHARTI AIRTEL LTD	46,167	835.850	38,588,686.950	
	UPL LTD	17,176	774.850	13,308,823.600	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,016	1,049.850	18,914,097.600	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	19,604	1,128.950	22,131,935.800	
	VEDANTA LTD	86,058	301.850	25,976,607.300	
インド・ルピー 小計				インド・ルピー 1,500,539,726.050 (2,565,922,931)	
インドネシア・ルピア		株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	581,300	6,050.000	3,516,865,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,463,100	3,980.000	5,823,138,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	382,100	9,375.000	3,582,187,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	849,700	8,975.000	7,626,057,500.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	532,600	10,325.000	5,499,095,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,804,300	4,850.000	8,750,855,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	950,900	3,880.000	3,689,492,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 38,487,690,000.000 (342,540,441)	
オフショア・人民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	120,100	17.810	2,138,981.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	186,000	4.310	801,660.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO- A	62,500	44.780	2,798,750.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	327,800	4.320	1,416,096.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	13,000	19.180	249,340.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,700	29.290	196,243.000	

KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	700	1,599.000	1,119,300.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	22,300	29.000	646,700.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	56,400	17.900	1,009,560.000	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	291,900	7.270	2,122,113.000	
CITIC SECURITIES CO-A	29,600	19.740	584,304.000	
CHINA MERCHANTS BANK-A	62,300	34.860	2,171,778.000	
PING AN BANK CO LTD-A	87,500	12.990	1,136,625.000	
GF SECURITIES CO LTD-A	14,800	16.030	237,244.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	536,800	5.880	3,156,384.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	15,000	24.600	369,000.000	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	94,500	14.770	1,395,765.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	3.620	158,918.000	
CHINA COAL ENERGY CO-A	39,200	9.570	375,144.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	17,160	12.460	213,813.600	
METALLURGICAL CORP OF CHINA	107,900	3.370	363,623.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	98,600	4.540	447,644.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	22,200	17.340	384,948.000	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	6,800	39.900	271,320.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	5.600	171,360.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,221,900	2.880	3,519,072.000	
BANK OF CHINA LTD-A	398,000	3.140	1,249,720.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	332,000	4.490	1,490,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	395,500	4.760	1,882,580.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	43,100	30.250	1,303,775.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	74,200	18.830	1,397,186.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	42,100	24.440	1,028,924.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	48,700	5.140	250,318.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	463,900	3.520	1,632,928.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	435,600	3.000	1,306,800.000	
CRRC CORP LTD-A	143,200	5.330	763,256.000	
CHINA UNITED NETWORK-A	249,500	4.140	1,032,930.000	

	CGN POWER CO LTD-A	18,900	2.760	52,164.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21,300	13.170	280,521.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	33,500	8.980	300,830.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	226,100	5.940	1,343,034.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	123,100	5.650	695,515.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	10,200	28.840	294,168.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	158,300	5.240	829,492.000	
	BYD CO LTD -A	1,600	248.300	397,280.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	19,700	11.720	230,884.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	23,700	10.610	251,457.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	45,000	9.870	444,150.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	72,000	7.770	559,440.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	95,300	4.530	431,709.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 46,905,426.600 (910,678,239)	
サウジアラビア・リアル		株	サウジアラビア・リアル	サウジアラビア・リアル	
	SAUDI ARABIAN MINING	15,480	64.900	1,004,652.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	26,756	83.400	2,231,450.400	
	SAUDI TELECOM CO	48,196	38.000	1,831,448.000	
	AL RAJHI BANK	29,940	80.300	2,404,182.000	
	RIYAD BANK	27,266	35.300	962,489.800	
	ETIHAD ETISALAT CO	16,510	36.050	595,185.500	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	8,947	40.550	362,800.850	
	ALINMA BANK	22,219	33.000	733,227.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	31,599	51.200	1,617,868.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	66,973	33.200	2,223,503.600	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	27,576	11.180	308,299.680	
	SAUDI ELECTRICITY CO	42,276	24.640	1,041,680.640	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 15,316,788.270 (565,036,319)	
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	

	YANGZIJANG FINANCIAL HOLDING	126,000	0.345	43,470.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	155,000	1.390	215,450.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 258,920.000 (26,161,276)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	194,600	105.000	20,433,000.000	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100	145.000	3,929,500.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	59,200	340.000	20,128,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	145.500	5,601,750.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	87,100	145.500	12,673,050.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,704,800	1.380	5,112,624.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	113,300	41.750	4,730,275.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	47,400	190.000	9,006,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	827,300	17.600	14,560,480.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	553,900	12.900	7,145,310.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	249,100	29.750	7,410,725.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	91,200	188.500	17,191,200.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,338,200	3.100	4,148,420.000	
	PTT PCL-NVDR	1,098,100	33.250	36,511,825.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	151,600	55.500	8,413,800.000	
	CP ALL PCL-NVDR	202,100	63.500	12,833,350.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	60,700	145.000	8,801,500.000	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	467,200	9.450	4,415,040.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	431,300	23.700	10,221,810.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	240,200	48.250	11,589,650.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 224,857,309.000 (883,689,225)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	541	77,285.000	41,811,185.000	
	CENCOSUD SA	67,112	1,310.100	87,923,431.200	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,776,855	34.250	163,607,283.750	
	ENEL AMERICAS SA	1,555,894	119.000	185,151,386.000	

	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,172	86,250.000	187,335,000.000	
	FALABELLA SA	55,841	1,555.000	86,832,755.000	
	BANCO DE CHILE	2,545,772	83.650	212,953,827.800	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 965,614,868.750 (148,330,031)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	426,852	26.800	11,439,633.600	
	AKBANK T.A.S.	646,632	17.660	11,419,521.120	
	TURKIYE IS BANKASI-C	910,136	10.290	9,365,299.440	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	220,933	34.200	7,555,908.600	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	22,507	485.000	10,915,895.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	126,593	41.860	5,299,182.980	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	218,802	40.580	8,878,985.160	
	TURKIYE HALK BANKASI	377,245	10.280	3,878,078.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI	460,252	11.870	5,463,191.240	
	KOC HOLDING AS	128,998	70.800	9,133,058.400	
	TURK HAVA YOLLARI AO	135,146	120.500	16,285,093.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	38,599	134.400	5,187,705.600	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 104,821,552.740 (780,889,121)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	41,100	7.330	301,263.000	
	ENERGISA SA-UNITS	16,900	43.140	729,066.000	
	RUMO SA	62,700	19.460	1,220,142.000	
	VIBRA ENERGIA SA	133,000	16.360	2,175,880.000	
	VIA SA	265,200	2.150	570,180.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	49,000	11.510	563,990.000	
	TIM SA	61,726	13.120	809,845.120	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	69,000	5.190	358,110.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	433,800	25.380	11,009,844.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	31,200	7.720	240,864.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	546,359	15.510	8,474,028.090	

ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	476,736	25.740	12,271,184.640	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	37,900	14.350	543,865.000	
VALE SA	209,090	84.440	17,655,559.600	
GERDAU SA-PREF	76,700	31.020	2,379,234.000	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	297,500	29.380	8,740,550.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	116,073	11.410	1,324,392.930	
ITAUSA SA	174,342	8.790	1,532,466.180	
BRASKEM SA-PREF A	19,900	29.200	581,080.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	29,100	49.040	1,427,064.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	147,600	35.250	5,202,900.000	
COSAN SA	45,100	17.270	778,877.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	64,500	46.520	3,000,540.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	124,700	8.010	998,847.000	
EMBRAER SA	56,800	13.510	767,368.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	138,400	13.500	1,868,400.000	
CCR SA	94,900	11.750	1,115,075.000	
BRF SA	97,100	10.010	971,971.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	31,000	59.840	1,855,040.000	
LOJAS RENNEN S.A.	36,175	22.960	830,578.000	
JBS SA	89,800	22.460	2,016,908.000	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	11,500	7.650	87,975.000	
SUZANO SA	17,745	53.310	945,985.950	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	163,700	12.550	2,054,435.000	
CIELO SA	346,628	4.790	1,660,348.120	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	45,700	27.430	1,253,551.000	
SUL AMERICA SA - UNITS	39,818	21.890	871,616.020	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	33,230	17.820	592,158.600	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	46,400	27.560	1,278,784.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	39,900	38.440	1,533,756.000	
KLABIN SA - UNIT	37,000	20.000	740,000.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	127,600	13.740	1,753,224.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	58,900	22.200	1,307,580.000	
COGNA EDUCACAO	445,300	2.250	1,001,925.000	



	BANCO BRADESCO S.A.	167,721	13.340	2,237,398.140	
	AMBEV SA	223,600	15.760	3,523,936.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 113,157,785.390 (2,972,870,021)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MALAYAN BANKING BHD	98,300	8.700	855,210.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	188,600	4.410	831,726.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	91,700	8.520	781,284.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	127,400	5.820	741,468.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 3,209,688.000 (98,825,330)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	58,210	8.180	476,157.800	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,257,500	18.640	23,439,800.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	123,600	20.670	2,554,812.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,293,619	8.460	10,944,016.740	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA- UBD	104,100	151.140	15,733,674.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	22,600	160.880	3,635,888.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	85,700	72.190	6,186,683.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	192,200	72.380	13,911,436.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	98,400	149.640	14,724,576.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 91,607,043.540 (661,604,390)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	51,000	3.300	168,300.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	640,000	4.310	2,758,400.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	221,000	10.260	2,267,460.000	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	217,000	3.350	726,950.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	120,000	11.040	1,324,800.000	

CHINA GAS HOLDINGS LTD	149,200	9.250	1,380,100.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,725,800	3.580	13,338,364.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	38,500	17.380	669,130.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	71,800	285.800	20,520,440.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	544,000	4.420	2,404,480.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	204,000	14.380	2,933,520.000	
PETROCHINA CO LTD-H	2,634,000	3.480	9,166,320.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	24,500	37.650	922,425.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	237,120	1.250	296,400.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	462,000	3.700	1,709,400.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	74,000	28.000	2,072,000.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	78,000	9.310	726,180.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,838,000	4.720	22,835,360.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	635,000	3.420	2,171,700.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	84,500	13.060	1,103,570.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	64,600	11.060	714,476.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	66,600	8.950	596,070.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	30,500	34.400	1,049,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	684,000	4.690	3,207,960.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	274,000	23.100	6,329,400.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	177,120	9.790	1,734,004.800	
SINOPHARM GROUP CO-H	52,000	17.860	928,720.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	182,000	35.750	6,506,500.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	110,000	24.650	2,711,500.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	188,500	4.510	850,135.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	36,000	26.550	955,800.000	
BYD CO LTD-H	6,500	182.000	1,183,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,042,000	2.570	10,387,940.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	142,000	4.170	592,140.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	74,700	17.640	1,317,708.000	

PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	773,000	2.600	2,009,800.000	
CITIC LTD	178,000	7.790	1,386,620.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	168,500	7.080	1,192,980.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	5,240,000	3.880	20,331,200.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,716,000	0.820	1,407,120.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	380,800	9.970	3,796,576.000	
MEITUAN-CLASS B	20,400	155.400	3,170,160.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	390,400	78.750	30,744,000.000	
JD.COM INC - CL A	34,195	210.800	7,208,306.000	
NETEASE INC	29,300	109.700	3,214,210.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	159,600	20.750	3,311,700.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	287,000	1.750	502,250.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	79,800	25.400	2,026,920.000	
BAIDU INC-CLASS A	74,050	98.150	7,268,007.500	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	326,000	21.350	6,960,100.000	
CRRC CORP LTD - H	286,000	3.100	886,600.000	
CGN POWER CO LTD-H	629,000	1.850	1,163,650.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	471,500	47.250	22,278,375.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	177,000	6.960	1,231,920.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	746,000	4.580	3,416,680.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	82,050	7.960	653,118.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,301,580	2.630	3,423,155.400	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	465,000	3.050	1,418,250.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	12,000	87.650	1,051,800.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	196,100	16.560	3,247,416.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	114,000	5.300	604,200.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,200	66.900	816,180.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	57,000	33.050	1,883,850.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	282,000	7.830	2,208,060.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	73,000	10.340	754,820.000	
WEI CHAI POWER CO LTD-H	110,000	9.830	1,081,300.000	

	CHINA POWER INTERNATIONAL	482,000	2.920	1,407,440.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	7,900	90.050	711,395.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	264,000	3.220	850,080.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	214,800	17.460	3,750,408.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	95,800	12.900	1,235,820.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	390,000	11.640	4,539,600.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	23,200	105.700	2,452,240.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	208,000	5.730	1,191,840.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	120,000	10.000	1,200,000.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	272,000	6.790	1,846,880.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,100,100	4.440	4,884,444.000	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	142,000	1.650	234,300.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	357,000	2.600	928,200.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	154,500	38.300	5,917,350.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	5,275,000	2.760	14,559,000.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	70,000	15.180	1,062,600.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	424,000	2.350	996,400.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,000	4.680	804,960.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	89,500	23.100	2,067,450.000	
	香港・ドル 小計			香港・ドル 319,849,583.700 (5,686,925,598)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	32,000	122.000	3,904,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	23,000	156.000	3,588,000.000	
	TAIWAN CEMENT	197,247	33.550	6,617,636.850	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	191,000	95.400	18,221,400.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	25,000	85.400	2,135,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	78,112	65.800	5,139,769.600	
	FORMOSA PLASTICS CORP	133,600	88.900	11,877,040.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	110,140	76.700	8,447,738.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	50,390	74.000	3,728,860.000	

CHINA STEEL CORP	547,686	28.700	15,718,588.200	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	63,616	65.600	4,173,209.600	
DELTA ELECTRONICS INC	61,000	298.000	18,178,000.000	
YAGEO CORPORATION	12,734	438.000	5,577,492.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	70,000	57.600	4,032,000.000	
ACER INC	204,000	24.600	5,018,400.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	76,000	50.100	3,807,600.000	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10,000	314.500	3,145,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	125,000	71.500	8,937,500.000	
AUO CORP	638,600	16.150	10,313,390.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	124,400	112.000	13,932,800.000	
MEDIATEK INC	26,003	713.000	18,540,139.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	33,000	181.000	5,973,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	10,800	161.000	1,738,800.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	271,155	59.600	16,160,838.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	316,838	43.450	13,766,611.100	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	696,000	13.200	9,187,200.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	236,610	24.500	5,796,945.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	250,682	22.500	5,640,345.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	244,517	31.500	7,702,285.500	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	292,583	15.000	4,388,745.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,200,231	8.850	10,622,044.350	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	266,180	17.750	4,724,695.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	489,028	22.850	11,174,289.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	216,658	26.200	5,676,439.600	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	2,270.000	9,080,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	13,000	293.000	3,809,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	19,000	151.000	2,869,000.000	
WISTRON CORP	162,110	27.650	4,482,341.500	
INNOLUX CORP	784,375	12.350	9,687,031.250	
PEGATRON CORP	75,000	61.500	4,612,500.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	30,033	192.500	5,781,352.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	205,560	26.500	5,447,340.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	48,400	82.300	3,983,320.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	43,000	84.500	3,633,500.000	

	COMPAL ELECTRONICS	201,000	21.500	4,321,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	357,000	487.000	173,859,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	340,902	100.000	34,090,200.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	17,000	268.500	4,564,500.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	32,760	267.000	8,746,920.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	372,000	44.650	16,609,800.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 573,163,106.850 (2,573,616,982)	
南アフリカ・ラ ンド		株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	GOLD FIELDS LTD	28,182	184.590	5,202,115.380	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,313	1,982.500	2,603,022.500	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	1,156,370	1.610	1,861,755.700	
	OLD MUTUAL LTD	181,777	10.940	1,988,640.380	
	VODACOM GROUP LTD	18,179	127.100	2,310,550.900	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	18,654	250.160	4,666,484.640	
	NEDBANK GROUP LTD	19,494	225.010	4,386,344.940	
	BIDVEST GROUP LTD	10,912	223.990	2,444,178.880	
	BID CORP LTD	10,149	328.260	3,331,510.740	
	STANDARD BANK GROUP LTD	35,384	177.970	6,297,290.480	
	SASOL LTD	35,010	292.730	10,248,477.300	
	REMGRO LTD	16,267	142.200	2,313,167.400	
	DISCOVERY LTD	13,047	123.920	1,616,784.240	
	EXXARO RESOURCES LTD	11,992	224.170	2,688,246.640	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,567	469.670	1,675,312.890	
	SANLAM LTD	51,373	54.910	2,820,891.430	
	FIRSTRAND LTD	142,495	65.040	9,267,874.800	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	52,923	65.700	3,477,041.100	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	16,947	104.270	1,767,063.690	
	ABSA GROUP LTD	27,900	202.180	5,640,822.000	
	NASPERS LTD-N SHS	4,259	2,484.510	10,581,528.090	
	MTN GROUP LTD	58,577	135.950	7,963,543.150	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,150	201.450	2,649,067.500	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	16,042	142.750	2,289,995.500	

	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	15,652	302.200	4,730,034.400	
	MR PRICE GROUP LTD	10,072	166.620	1,678,196.640	
	SIBANYE STILLWATER LTD	87,407	45.160	3,947,300.120	
南アフリカ・ランド 小計				南アフリカ・ランド 110,447,241.430 (901,249,490)	
合計				19,364,127,629 [19,364,127,629]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	871,600	アメリカ・ドル 15,392,456.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 15,392,456.000 (2,137,550,364)	
投資証券 合計				2,137,550,364 [2,137,550,364]	
合計				2,137,550,364 [2,137,550,364]	

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 29銘柄 投資証券 1銘柄	10.3%	89.7%	11.1%
インド・ルピー	株式 44銘柄	100%	-%	11.9%
インドネシア・ルピア	株式 7銘柄	100%	-%	1.6%
オフショア・人民元	株式 50銘柄	100%	-%	4.2%
サウジアラビア・リアル	株式 12銘柄	100%	-%	2.6%
シンガポール・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 20銘柄	100%	-%	4.1%
チリ・ペソ	株式 7銘柄	100%	-%	0.7%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	100%	-%	3.6%
ブラジル・リアル	株式 46銘柄	100%	-%	13.8%
マレーシア・リンギット	株式 4銘柄	100%	-%	0.5%

メキシコ・ペソ	株式	9銘柄	100%	-%	3.1%
香港・ドル	株式	85銘柄	100%	-%	26.5%
台湾・ドル	株式	50銘柄	100%	-%	12.0%
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	100%	-%	4.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間（2021年12月1日から2022年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,351,695	5,371,005
親投資信託受益証券	3,038,297,670	2,871,296,462
流動資産合計	3,043,649,365	2,876,667,467
資産合計	3,043,649,365	2,876,667,467
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	612,482	789,141
未払受託者報酬	163,057	163,552
未払委託者報酬	1,467,893	1,472,379
その他未払費用	81,462	81,706
流動負債合計	2,324,894	2,506,778
負債合計	2,324,894	2,506,778
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,995,991,358	1 2,959,305,050
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 45,333,113	2 85,144,361
（分配準備積立金）	21,171,812	16,441,816
元本等合計	3,041,324,471	2,874,160,689
純資産合計	3,041,324,471	2,874,160,689
負債純資産合計	3,043,649,365	2,876,667,467

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		3,671,954		129,207,664
営業収益合計		3,671,954		129,207,663
営業費用				
支払利息		1,386		1,297
受託者報酬		307,685		328,956
委託者報酬		2,769,899		2,961,408
その他費用		153,717		164,335
営業費用合計		3,232,687		3,455,996
営業利益又は営業損失（ ）		439,267		132,663,659
経常利益又は経常損失（ ）		439,267		132,663,659
当期純利益又は当期純損失（ ）		439,267		132,663,659
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		960,095		16,483,798
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		36,202,700		45,333,113
剰余金増加額又は欠損金減少額		16,610,485		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		16,610,485		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,879,434		14,297,613
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,879,434		10,002,516
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		4,295,097
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,333,113		85,144,361

## (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6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,366,238,389円	2,995,991,358円
期中追加設定元本額	1,226,825,775円	723,779,301円
期中一部解約元本額	597,072,806円	760,465,609円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,995,991,358口	2,959,305,050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85,144,361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5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(37,681,657円)及び分配準備積立金(21,171,812円)より分配対象額は58,853,469円(1万口当たり196.44円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,912,769円)及び分配準備積立金(16,441,816円)より分配対象額は53,354,585円(1万口当たり180.29円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,070,368	116,839,313
合計	4,070,368	116,839,313

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0151円	0.9712円
（1万口当たり純資産額）	（10,151円）	（9,712円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	2,111,247,399	2,871,296,462	
親投資信託受益証券 合計			2,871,296,462	
合計			2,871,296,462	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	304,345,621	298,172,503
国債証券	85,097,080,600	104,845,798,810

地方債証券		3,514,853,500	2,911,753,400
特殊債券		2,703,089,900	2,016,980,400
社債券		2,976,109,700	2,780,464,900
未収入金		403,578,000	100,751,000
未収利息		195,282,238	218,481,441
前払費用		2,741,434	3,435,238
流動資産合計		95,197,080,993	113,175,837,692
資産合計		95,197,080,993	113,175,837,692
負債の部			
流動負債			
未払金		100,000,000	-
未払解約金		17,470,022	99,099,215
流動負債合計		117,470,022	99,099,215
負債合計		117,470,022	99,099,215
純資産の部			
元本等			
元本	1	66,960,247,306	83,142,525,531
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,119,363,665	29,934,212,946
元本等合計		95,079,610,971	113,076,738,477
純資産合計		95,079,610,971	113,076,738,477
負債純資産合計		95,197,080,993	113,175,837,692

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券



個別法に基づき、時価で評価しております。

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	63,632,169,674円	66,960,247,306円
期中追加設定元本額	13,191,022,279円	28,030,628,143円
期中一部解約元本額	9,862,944,647円	11,848,349,918円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	59,050,508円	52,917,204円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	412,666,474円	281,234,952円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	49,180,012円	46,312,087円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	693,952,196円	572,435,304円
DCダイワ日本債券インデックス	9,573,099,389円	10,377,310,449円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	704,912円	1,548,164,674円
ダイワ・バランスファンド35VA	10,117,083,683円	8,977,064,441円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,686,540,655円	1,543,317,679円

ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	219,254,803円	189,833,127円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	314,922,939円	241,971,948円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	61,401,829円	63,243,630円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	26,594,045,062円	26,333,485,063円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	6,074,653,568円	22,413,934,040円
ダイワファンドラップオンラ イン 日本債券インデックス	2,139,796,937円	2,111,247,399円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	965,018,800円	872,287,058円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,784,763,908円	6,396,124,679円
ダイワライフスタイル25	477,075,499円	432,831,898円
ダイワライフスタイル50	581,511,996円	548,823,097円
ダイワライフスタイル75	155,524,136円	139,986,802円
計	66,960,247,306円	83,142,525,531円
2. 期末日における受益権の総数	66,960,247,306口	83,142,525,531口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	500,217,670	4,707,923,020
地方債証券	20,927,900	97,363,200
特殊債券	11,147,300	79,586,200
社債券	5,480,800	92,144,400
合計	526,812,070	4,977,016,820

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4199円	1.3600円
（1万口当たり純資産額）	（14,199円）	（13,600円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 1 2年国債	300,000,000	300,255,000	
	4 3 3 2年国債	1,000,000,000	1,000,870,000	
	4 3 4 2年国債	100,000,000	100,087,000	
	4 3 5 2年国債	100,000,000	100,093,000	
	4 3 6 2年国債	2,300,000,000	2,302,277,000	
	4 3 8 2年国債	130,000,000	130,102,700	
	4 3 9 2年国債	650,000,000	650,487,500	
	4 4 0 2年国債	180,000,000	180,126,000	
	1 3 8 5年国債	1,200,000,000	1,202,328,000	
	1 3 9 5年国債	950,000,000	951,966,500	
	1 4 0 5年国債	1,120,000,000	1,122,520,000	
	1 4 1 5年国債	1,240,000,000	1,243,013,200	
	1 4 2 5年国債	1,040,000,000	1,042,662,400	
	1 4 3 5年国債	2,500,000,000	2,506,600,000	
	1 4 4 5年国債	1,180,000,000	1,183,457,400	
	1 4 5 5年国債	1,250,000,000	1,253,850,000	
	1 4 6 5年国債	780,000,000	782,496,000	
	1 4 7 5年国債	1,200,000,000	1,200,000,000	
	1 4 8 5年国債	1,050,000,000	1,049,622,000	
	1 4 9 5年国債	950,000,000	949,097,500	
	1 5 0 5年国債	1,250,000,000	1,247,725,000	
	1 5 1 5年国債	1,240,000,000	1,236,540,400	
	1 5 3 5年国債	850,000,000	846,719,000	
	1 5 4 5年国債	190,000,000	189,908,800	
	1 4 0年国債	70,000,000	85,554,700	
	2 4 0年国債	110,000,000	129,148,800	
	3 4 0年国債	150,000,000	176,842,500	
	4 4 0年国債	180,000,000	210,465,000	
	5 4 0年国債	185,000,000	207,629,200	
	6 4 0年国債	105,000,000	114,945,600	

7	40年国債	121,000,000	126,557,530	
8	40年国債	230,000,000	222,812,500	
9	40年国債	220,000,000	155,551,000	
10	40年国債	275,000,000	228,822,000	
11	40年国債	320,000,000	255,900,800	
12	40年国債	380,000,000	270,358,600	
13	40年国債	360,000,000	254,142,000	
14	40年国債	430,000,000	324,237,200	
15	40年国債	850,000,000	699,924,000	
332	10年国債	250,000,000	251,787,500	
333	10年国債	700,000,000	705,999,000	
334	10年国債	900,000,000	909,000,000	
335	10年国債	690,000,000	696,658,500	
336	10年国債	275,000,000	277,961,750	
337	10年国債	400,000,000	402,668,000	
338	10年国債	580,000,000	585,533,200	
339	10年国債	590,000,000	596,242,200	
340	10年国債	760,000,000	768,732,400	
341	10年国債	500,000,000	504,655,000	
342	10年国債	880,000,000	882,754,400	
343	10年国債	780,000,000	782,347,800	
344	10年国債	780,000,000	782,067,000	
345	10年国債	950,000,000	951,919,000	
346	10年国債	780,000,000	780,998,400	
347	10年国債	1,100,000,000	1,100,495,000	
348	10年国債	1,050,000,000	1,049,496,000	
349	10年国債	1,550,000,000	1,548,047,000	
350	10年国債	550,000,000	549,131,000	
351	10年国債	1,000,000,000	997,790,000	
352	10年国債	1,500,000,000	1,496,115,000	
353	10年国債	930,000,000	926,931,000	
354	10年国債	680,000,000	677,239,200	
355	10年国債	1,580,000,000	1,571,815,600	
356	10年国債	710,000,000	705,470,200	
357	10年国債	940,000,000	932,489,400	
358	10年国債	900,000,000	891,594,000	
359	10年国債	1,180,000,000	1,166,878,400	
360	10年国債	1,000,000,000	987,380,000	
361	10年国債	1,070,000,000	1,055,244,700	

362	10年国債	760,000,000	748,600,000
363	10年国債	1,200,000,000	1,180,968,000
364	10年国債	1,210,000,000	1,189,744,600
365	10年国債	1,130,000,000	1,112,033,000
366	10年国債	900,000,000	901,233,000
367	10年国債	960,000,000	956,860,800
368	10年国債	220,000,000	218,946,200
1	30年国債	16,000,000	18,817,120
2	30年国債	24,000,000	27,738,960
3	30年国債	30,000,000	34,570,500
4	30年国債	36,000,000	43,454,520
5	30年国債	28,000,000	32,485,880
6	30年国債	24,000,000	28,476,960
7	30年国債	55,000,000	65,184,350
8	30年国債	27,000,000	30,803,220
9	30年国債	43,000,000	47,361,060
10	30年国債	45,000,000	48,234,600
11	30年国債	40,000,000	45,286,800
12	30年国債	60,000,000	70,452,600
13	30年国債	75,000,000	87,330,750
14	30年国債	82,000,000	99,138,820
15	30年国債	50,000,000	61,086,500
16	30年国債	250,000,000	305,895,000
17	30年国債	130,000,000	157,717,300
18	30年国債	80,000,000	96,237,600
19	30年国債	57,000,000	68,630,280
21	30年国債	60,000,000	72,346,200
22	30年国債	170,000,000	209,392,400
24	30年国債	92,000,000	113,485,680
25	30年国債	150,000,000	181,167,000
26	30年国債	180,000,000	219,915,000
27	30年国債	150,000,000	185,344,500
28	30年国債	170,000,000	210,106,400
29	30年国債	200,000,000	244,208,000
30	30年国債	220,000,000	265,284,800
31	30年国債	300,000,000	356,661,000
32	30年国債	285,000,000	343,179,900
33	30年国債	280,000,000	323,780,800
34	30年国債	270,000,000	321,108,300

35	30年国債	250,000,000	289,107,500	
36	30年国債	350,000,000	404,652,500	
37	30年国債	450,000,000	511,866,000	
38	30年国債	300,000,000	335,400,000	
39	30年国債	230,000,000	261,059,200	
40	30年国債	150,000,000	167,349,000	
41	30年国債	210,000,000	230,160,000	
42	30年国債	205,000,000	224,481,150	
43	30年国債	260,000,000	284,450,400	
44	30年国債	300,000,000	327,903,000	
45	30年国債	250,000,000	263,307,500	
46	30年国債	210,000,000	220,886,400	
47	30年国債	370,000,000	395,914,800	
48	30年国債	280,000,000	288,218,000	
49	30年国債	220,000,000	226,107,200	
50	30年国債	310,000,000	280,773,200	
51	30年国債	340,000,000	272,550,800	
52	30年国債	385,000,000	322,849,450	
53	30年国債	250,000,000	213,820,000	
54	30年国債	310,000,000	277,028,400	
55	30年国債	260,000,000	231,496,200	
56	30年国債	340,000,000	301,607,200	
57	30年国債	330,000,000	291,654,000	
58	30年国債	400,000,000	352,200,000	
59	30年国債	300,000,000	256,854,000	
60	30年国債	410,000,000	366,966,400	
61	30年国債	200,000,000	169,710,000	
62	30年国債	430,000,000	344,679,400	
63	30年国債	300,000,000	232,914,000	
64	30年国債	220,000,000	170,156,800	
65	30年国債	200,000,000	154,980,000	
66	30年国債	200,000,000	154,694,000	
67	30年国債	300,000,000	242,403,000	
68	30年国債	290,000,000	233,519,600	
69	30年国債	350,000,000	289,009,000	
70	30年国債	300,000,000	246,684,000	
71	30年国債	260,000,000	213,096,000	
72	30年国債	320,000,000	261,667,200	
73	30年国債	363,000,000	296,440,320	

74	30年国債	320,000,000	283,395,200	
75	30年国債	330,000,000	315,839,700	
76	30年国債	40,000,000	39,095,600	
65	20年国債	175,000,000	178,647,000	
66	20年国債	185,000,000	188,661,150	
67	20年国債	55,000,000	56,400,850	
68	20年国債	120,000,000	123,524,400	
69	20年国債	110,000,000	113,087,700	
70	20年国債	83,000,000	86,149,020	
71	20年国債	125,000,000	129,353,750	
72	20年国債	105,000,000	109,043,550	
73	20年国債	120,000,000	124,988,400	
74	20年国債	73,000,000	76,184,260	
75	20年国債	80,000,000	83,890,400	
76	20年国債	51,000,000	53,245,530	
77	20年国債	130,000,000	136,022,900	
78	20年国債	61,000,000	63,980,460	
79	20年国債	50,000,000	52,570,500	
80	20年国債	53,000,000	55,859,880	
82	20年国債	87,000,000	92,146,050	
83	20年国債	93,000,000	98,975,250	
85	20年国債	58,000,000	62,007,220	
86	20年国債	80,000,000	86,055,200	
87	20年国債	55,000,000	58,981,450	
88	20年国債	100,000,000	108,108,000	
89	20年国債	78,000,000	84,048,120	
90	20年国債	20,000,000	21,648,400	
92	20年国債	310,000,000	335,695,900	
93	20年国債	100,000,000	108,271,000	
94	20年国債	130,000,000	141,310,000	
95	20年国債	50,000,000	55,020,000	
96	20年国債	55,000,000	60,023,700	
97	20年国債	40,000,000	44,004,400	
98	20年国債	320,000,000	350,505,600	
99	20年国債	100,000,000	109,942,000	
100	20年国債	155,000,000	171,929,100	
101	20年国債	350,000,000	391,912,500	
103	20年国債	170,000,000	190,275,900	
104	20年国債	10,000,000	11,082,500	



105	20年国債	126,000,000	140,214,060	
106	20年国債	150,000,000	167,785,500	
107	20年国債	90,000,000	100,525,500	
108	20年国債	300,000,000	331,485,000	
109	20年国債	55,000,000	60,986,200	
110	20年国債	260,000,000	291,543,200	
111	20年国債	200,000,000	226,302,000	
112	20年国債	150,000,000	168,754,500	
113	20年国債	310,000,000	349,999,300	
114	20年国債	70,000,000	79,248,400	
115	20年国債	180,000,000	205,032,600	
116	20年国債	200,000,000	228,526,000	
117	20年国債	200,000,000	227,090,000	
118	20年国債	95,000,000	107,479,200	
119	20年国債	93,000,000	103,836,360	
120	20年国債	317,000,000	349,229,390	
121	20年国債	200,000,000	225,256,000	
122	20年国債	200,000,000	223,724,000	
123	20年国債	200,000,000	229,022,000	
124	20年国債	300,000,000	341,169,000	
125	20年国債	130,000,000	150,425,600	
126	20年国債	110,000,000	125,496,800	
127	20年国債	250,000,000	283,190,000	
128	20年国債	250,000,000	284,057,500	
129	20年国債	200,000,000	225,574,000	
130	20年国債	140,000,000	158,348,400	
131	20年国債	150,000,000	168,370,500	
132	20年国債	100,000,000	112,585,000	
133	20年国債	430,000,000	487,916,700	
134	20年国債	30,000,000	34,132,500	
135	20年国債	92,000,000	103,838,560	
136	20年国債	550,000,000	615,791,000	
138	20年国債	400,000,000	444,564,000	
139	20年国債	370,000,000	414,659,000	
140	20年国債	500,000,000	565,310,000	
141	20年国債	400,000,000	452,436,000	
142	20年国債	190,000,000	216,752,000	
143	20年国債	210,000,000	235,624,200	
144	20年国債	490,000,000	544,929,000	

145	20年国債	450,000,000	509,476,500	
146	20年国債	350,000,000	396,294,500	
147	20年国債	400,000,000	448,664,000	
148	20年国債	450,000,000	499,725,000	
149	20年国債	532,000,000	590,413,600	
150	20年国債	530,000,000	581,860,500	
151	20年国債	480,000,000	515,260,800	
152	20年国債	460,000,000	493,304,000	
153	20年国債	680,000,000	736,841,200	
154	20年国債	570,000,000	609,934,200	
155	20年国債	440,000,000	459,078,400	
156	20年国債	370,000,000	357,146,200	
157	20年国債	560,000,000	524,367,200	
158	20年国債	350,000,000	340,116,000	
159	20年国債	310,000,000	304,280,500	
160	20年国債	460,000,000	456,145,200	
161	20年国債	420,000,000	409,315,200	
162	20年国債	580,000,000	563,151,000	
163	20年国債	480,000,000	464,294,400	
164	20年国債	600,000,000	569,640,000	
165	20年国債	300,000,000	283,629,000	
166	20年国債	600,000,000	582,588,000	
167	20年国債	400,000,000	375,188,000	
168	20年国債	420,000,000	386,034,600	
169	20年国債	320,000,000	287,984,000	
170	20年国債	420,000,000	376,080,600	
171	20年国債	500,000,000	445,765,000	
172	20年国債	200,000,000	180,704,000	
173	20年国債	510,000,000	459,168,300	
174	20年国債	600,000,000	538,272,000	
175	20年国債	400,000,000	364,124,000	
176	20年国債	580,000,000	526,187,600	
177	20年国債	530,000,000	470,300,800	
178	20年国債	420,000,000	378,672,000	
179	20年国債	380,000,000	341,665,600	
180	20年国債	490,000,000	464,745,400	
181	20年国債	500,000,000	482,355,000	
182	20年国債	140,000,000	139,433,000	
27	メキシコ国債	100,000,000	97,237,300	

	1 1	フィリピン共和国	100,000,000	100,244,200	
国債証券	合計			104,845,798,810	
地方債証券	7 5 1	東京都公債	100,000,000	100,760,200	
	1 6	東京都 2 0 年	100,000,000	110,254,200	
	3 - 5	北海道公債	100,000,000	97,322,200	
	2 2 2	神奈川県公債	100,000,000	99,710,300	
	3 1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	102,339,300	
	4 2 0	大阪府公債	200,000,000	199,324,800	
	2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	100,742,300	
	3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	202,041,200	
	1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	109,591,800	
	2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	100,820,600	
	2 1 - 5	愛知県公債	100,000,000	112,696,600	
	2 9 - 5	広島県公債	100,000,000	99,989,800	
	4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	98,654,500	
	9	埼玉県 2 0 年	100,000,000	112,943,400	
	2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	99,928,600	
	2 2 - 1	福岡県 1 5 年	100,000,000	104,612,400	
	1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	109,576,900	
	2 8 - 2	新潟県公債	100,000,000	99,971,000	
	1 3 1	共同発行地方	100,000,000	100,740,100	
	1 6 8	共同発行地方	100,000,000	100,051,300	
	2 7 - 1	滋賀県公債	100,000,000	101,064,800	
	1 1	名古屋市 2 0 年	100,000,000	112,369,000	
	2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	111,451,300	
	4	川崎市公債 3 0 年	100,000,000	114,919,500	
	2 3 - 4	福岡市 2 0 年	100,000,000	112,341,700	
	2 - 2	岡山県公債	100,000,000	97,535,600	
地方債証券	合計			2,911,753,400	
特殊債券	4 7	日本政策投資 C O	100,000,000	103,878,600	
	2 4 7	道路機構	200,000,000	173,425,800	
	8 6	政保道路機構	100,000,000	111,428,500	
	2 2 3	政保道路機構	100,000,000	108,959,400	
	2 3 6	政保道路機構	100,000,000	100,575,600	
	2 6 1	政保道路機構	200,000,000	201,865,800	
	2 8 4	政保道路機構	200,000,000	183,621,200	
	2 9 8	政保道路機構	100,000,000	96,276,500	
	F 1 4 3	地方公共団体	100,000,000	104,811,000	
	1	地方公共団 1 5 年	100,000,000	105,046,400	

	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	110,146,000	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	100,669,800	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	100,630,200	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,315,800	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	105,060,800	
	1 2 3 住宅支援機構	100,000,000	111,494,900	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,774,100	
特殊債券 合計			2,016,980,400	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,368,600	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	100,946,800	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	99,622,100	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	101,044,100	
	5 野村不動産HD	100,000,000	101,520,700	
	2 3 森ビル	100,000,000	93,675,300	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	99,661,200	
	2 0 ZHD	100,000,000	97,181,800	
	1 8 楽天グループ	100,000,000	86,407,800	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,154,000	
	1 5 デンソー	100,000,000	99,480,900	
	6 楽天カード	100,000,000	95,907,300	
	1 日生2021基金	100,000,000	99,745,000	
	7 凸版印刷	100,000,000	103,542,100	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	100,839,700	
	1 6 NTTファイナンス	100,000,000	99,570,800	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	99,528,800	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,403,200	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	103,230,800	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	98,947,600	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	110,291,200	
	1 5 ソフトバンク	100,000,000	97,226,500	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	99,650,000	
	4 8 2 九州電力	100,000,000	99,936,900	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	96,030,100	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	99,077,600	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	97,144,600	
	4 ファーストリテイリング	100,000,000	101,329,400	
社債券 合計			2,780,464,900	
合計			112,554,997,510	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,793,811	14,477,139
親投資信託受益証券	5,174,345,100	3,781,856,738
未収入金	-	8,106,868
流動資産合計	5,192,138,911	3,804,440,745
<b>資産合計</b>		
5,192,138,911		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	791,713	9,893,165
未払受託者報酬	557,770	420,635
未払委託者報酬	6,135,968	4,627,352
その他未払費用	209,103	157,652
流動負債合計	7,694,554	15,098,804
<b>負債合計</b>		
7,694,554		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 4,813,778,100	<sup>1</sup> 4,165,956,248
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 370,666,257	<sup>2</sup> 376,614,307
（分配準備積立金）	240,956,918	170,191,515
元本等合計	5,184,444,357	3,789,341,941
<b>純資産合計</b>		
5,184,444,357		
<b>負債純資産合計</b>		
5,192,138,911		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
営業収益				
受取利息		1		3
有価証券売買等損益		104,509,492		722,019,537
営業収益合計		104,509,491		722,019,534
営業費用				
支払利息		4,015		3,440
受託者報酬		1,032,440		938,359
委託者報酬		11,357,799		10,322,628
その他費用		387,036		351,718
営業費用合計		12,781,290		11,616,145
営業損失（ ）		117,290,781		733,635,679
経常損失（ ）		117,290,781		733,635,679
当期純損失（ ）		117,290,781		733,635,679
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		16,756,177		111,308,790
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		393,853,687		370,666,257
剰余金増加額又は欠損金減少額		152,344,990		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		152,344,990		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,997,816		124,953,675
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,997,816		112,849,298
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		12,104,377
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		370,666,257		376,614,307



## (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6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	3,599,799,209円	4,813,778,100円
期中追加設定元本額	1,938,477,119円	881,042,439円
期中一部解約元本額	724,498,228円	1,528,864,291円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,813,778,100口	4,165,956,248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376,614,307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5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(218,757,164円)及び分配準備積立金(240,956,918円)より分配対象額は459,714,082円(1万口当たり955.00円)であり、分配を行っていません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(227,655,452円)及び分配準備積立金(170,191,515円)より分配対象額は397,846,967円(1万口当たり955.00円)であり、分配を行っていません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	99,231,848	636,069,719
合計	99,231,848	636,069,719

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0770円	0.9096円
（1万口当たり純資産額）	（10,770円）	（9,096円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	4,269,907,123	3,781,856,738	
親投資信託受益証券 合計			3,781,856,738	
合計			3,781,856,738	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	759,252,677	1,151,749,018
コール・ローン	630,287,908	1,579,586,593

国債証券		129,099,884,257	112,059,642,197
派生商品評価勘定		2,089,085,342	5,184,138,586
未収入金		-	308,641,607
未収利息		731,941,321	751,487,963
前払費用		35,774,824	32,216,082
差入委託証拠金		240,386,498	286,231,791
流動資産合計		133,586,612,827	121,353,693,837
資産合計		133,586,612,827	121,353,693,837
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,537,759	5,101,036
未払金		592,781,697	-
未払解約金		-	8,106,868
流動負債合計		594,319,456	13,207,904
負債合計		594,319,456	13,207,904
純資産の部			
元本等			
元本	1	127,114,402,128	136,999,425,944
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	5,877,891,243	15,658,940,011
元本等合計		132,992,293,371	121,340,485,933
純資産合計		132,992,293,371	121,340,485,933
負債純資産合計		133,586,612,827	121,353,693,837

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	104,020,210,262円	127,114,402,128円
期中追加設定元本額	36,354,862,011円	33,481,573,422円
期中一部解約元本額	13,260,670,145円	23,596,549,606円

期末元本額の内訳			
ファンド名			
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	103,094,342,209円		111,430,379,707円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	4,945,846,970円		4,269,907,123円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	959,893円		3,742,598円
ダイワバランスファンド 2020-07（適格機関投資家専用）	3,285,353,528円		- 円
ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	3,362,089,827円		3,372,552,461円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	12,425,809,701円		17,922,844,055円
計	127,114,402,128円		136,999,425,944円
2. 期末日における受益権の総数	127,114,402,128口		136,999,425,944口
3. 2 元本の欠損			貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,658,940,011円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）



国債証券	365,563,764	1,673,487,605
合計	365,563,764	1,673,487,605

(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6月16日から2021年11月30日まで、及び2022年6月16日から2022年11月30日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買 建	-	-	-	-	1,905,215,246	-	1,900,130,815	5,084,431
合計	-	-	-	-	1,905,215,246	-	1,900,130,815	5,084,431

### (注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以 外の取引								

為替予約取引								
売 建	131,449,461,764	-	129,361,914,181	2,087,547,583	118,125,905,948	-	112,941,783,967	5,184,121,981
アメリカ・ドル	61,830,345,724	-	61,696,074,456	134,271,268	59,273,186,456	-	55,562,588,424	3,710,598,032
イギリス・ポンド	8,107,969,951	-	7,867,782,720	240,187,231	5,618,230,378	-	5,469,664,120	148,566,258
イスラエル・シェケル	610,830,504	-	609,201,686	1,628,818	523,588,698	-	500,616,666	22,972,032
オーストラリア・ドル	2,325,574,845	-	2,207,565,188	118,009,657	2,055,441,161	-	2,011,301,744	44,139,417
ア・オフショア・人民元	266,020,350	-	267,268,500	1,248,150	4,279,772,154	-	4,104,188,613	175,583,541
カナダ・ドル	2,602,730,485	-	2,527,170,380	75,560,105	2,449,642,075	-	2,303,354,580	146,287,495
シンガポール・ドル	555,965,324	-	547,263,288	8,702,036	429,402,747	-	414,230,674	15,172,073
スウェーデン・クローナ	371,157,834	-	350,344,592	20,813,242	340,765,632	-	333,365,408	7,400,224
デンマーク・クローネ	658,382,410	-	640,825,744	17,556,666	573,067,290	-	561,630,576	11,436,714
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	259,816,649	-	259,833,254	16,605
ノルウェー・クローネ	323,132,196	-	302,415,488	20,716,708	292,633,024	-	285,147,192	7,485,832
ポーランド・ズロチ	686,610,248	-	659,767,960	26,842,288	630,101,485	-	624,796,746	5,304,739
マレーシア・リングギット	583,070,020	-	578,372,054	4,697,966	721,109,640	-	714,428,280	6,681,360

メキシコ・ペソ	904,117,583	-	859,146,797	44,970,786	1,180,085,068	-	1,147,165,196	32,919,872
ユーロ	51,623,554,290	-	50,248,715,328	1,374,838,962	39,499,063,491	-	38,649,472,494	849,590,997
合計	131,449,461,764	-	129,361,914,181	2,087,547,583	118,125,905,948	-	112,941,783,967	5,184,121,981

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0462円	0.8857円
(1万口当たり純資産額)	(10,462円)	(8,857円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	アメリカ・ドル 15,905,000.000	アメリカ・ドル 15,606,145.050	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	15,000,000.000	14,647,200.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	16,580,000.000	16,063,035.600	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	8,950,000.000	9,784,498.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,940,907.000	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,612,618.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	698,298.300	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,000,000.000	2,166,820.000	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	340,299.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	410,959.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,494,346.200	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,518,491.600	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	2,510,733.500	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	579,840.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	588,206.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,000,000.000	1,636,940.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	816,210.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	2,077,525.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,030,986.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	2,415,122.880	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	934,600.000	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,200,000.000	1,971,486.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	2,940,000.000	2,524,372.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	12,810,000.000	12,270,570.900	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,500,000.000	2,098,425.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	1,100,000.000	842,875.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	15,300,000.000	14,508,072.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	309,860.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	13,956,735.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	12,800,000.000	12,096,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,400,000.000	1,171,450.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	11,072,760.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,307,424.700	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	813,735.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	11,750,000.000	10,694,262.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	361,050.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	14,850,000.000	13,713,529.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	817,960.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	7,670,000.000	7,134,557.300	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	752,409.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	8,050,000.000	7,508,476.500	

3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	794,656.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	12,961,900.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	14,700,000.000	14,106,120.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	6,676,740.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	15,800,000.000	15,166,104.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,406,525.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	859,490.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	7,300,000.000	6,909,596.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	8,000,000.000	7,556,800.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,261,455.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	6,980,333.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,670,772.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	15,500,000.000	14,390,665.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	2,702,368.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	1,650,000.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,800,000.000	3,469,552.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	7,000,000.000	6,479,620.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	1,518,636.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	4,745,250.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,300,000.000	967,122.000	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,856,950.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	1,698,525.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	1,884,994.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,541,320.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	6,300,000.000	4,995,900.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	3,700,000.000	2,119,693.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	3,000,000.000	2,420,970.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	2,331,490.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	3,822,525.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	5,300,000.000	4,510,035.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	2,685,951.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,028,486.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	1,721,184.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	4,790,225.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,901,352.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	4,400,000.000	3,252,216.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,220,832.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	5,700,000.000	4,654,392.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,633,709.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,750,000.000	3,981,760.000	

	0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,120,328.000	
	1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	4,500,000.000	3,692,430.000	
	1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	1,500,000.000	980,145.000	
	2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,446,160.000	
	1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	4,200,000.000	3,588,186.000	
	2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,000,000.000	717,810.000	
	2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	772,500.000	
	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	5,300,000.000	4,928,152.000	
	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,901,433.000	
	2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,000,000.000	1,836,860.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 400,110,009.930 (55,563,277,079)	
イギリス・ボ ンド		イギリス・ボ ンド	イギリス・ボ ンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,309,567.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	705,194.100	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,775,000.000	1,674,907.750	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	150,000.000	102,295.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	661,863.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	632,925.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	595,640.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	735,312.000	



1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	345,428.380	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,500,000.000	1,454,850.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000	575,080.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	574,991.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	689,064.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	600,000.000	421,062.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	323,588.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	368,985.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	189,861.800	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,450,000.000	1,046,117.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,330,012.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	297,105.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	200,000.000	123,182.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	130,458.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,104,570.630	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,600,000.000	1,753,104.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,323,883.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	1,002,080.550	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	638,181.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,012,945.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	869,183.700	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	300,000.000	313,425.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,049,244.250	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,015,202.100	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	621,235.440	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,240,186.300	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	673,476.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	621,522.720	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,103,530.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	751,548.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	843,771.250	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	838,900.000	928,788.130	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,000,000.000	990,190.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	740,000.000	743,100.600	
	イギリス・ボンド 小計		イギリス・ボンド 32,886,658.200 (5,466,749,192)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,538,592.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	1,650,000.000	1,657,854.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	479,170.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,788,080.000	

	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,239,804.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	943,370.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,448,706.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	782,890.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 11,878,466.000 (479,106,047)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	940,695.350	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,156,000.000	1,149,618.880	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	316,483.200	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,800,000.000	1,803,060.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	386,628.640	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,473,584.960	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	716,408.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	720,000.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	626,646.600	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,264,835.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	620,934.860	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	652,689.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,205,200.000	

	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	1,961,652.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	426,977.100	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,527,732.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,350,000.000	1,912,500.500	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	559,926.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,800,000.000	1,522,620.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 20,788,193.340 (1,928,936,460)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	3,000,000.000	3,065,490.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,702,540.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	3,000,000.000	3,102,990.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,071,460.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,427,147.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	14,000,000.000	14,149,380.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,000,000.000	5,912,520.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	19,000,000.000	19,142,120.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	13,000,000.000	13,242,840.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,400,960.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,000,000.000	6,233,400.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	3,000,000.000	3,280,860.000	

3.72% China Government Bond 20510412	1,600,000.000	1,723,600.000	
3.02% China Government Bond 20310527	1,800,000.000	1,821,240.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,014,450.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,082,040.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,097,370.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,796,920.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,356,940.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,400,000.000	4,957,832.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	4,000,000.000	4,400,920.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	15,000,000.000	15,508,350.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	4,800,000.000	4,874,928.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,527,930.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	3,424,872.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,309,911.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	1,800,000.000	1,779,084.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	3,990,120.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,300,000.000	2,319,803.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	9,000,000.000	8,876,160.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	1,952,560.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,000,000.000	2,952,570.000	
オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元	

			203,499,307.000 (3,950,979,745)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	428,664.800	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,052,373.960	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,303,302.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	366,111.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	696,849.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	149,493.400	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	400,000.000	391,280.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	900,000.000	851,886.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,440,376.800	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,798,944.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	846,011.700	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	568,770.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,216,015.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	287,118.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	2,000,000.000	1,955,120.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	2,200,000.000	2,110,064.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,503,089.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	824,958.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,776,980.000	

	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	750,000.000	558,322.500	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	882,340.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	458,870.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 21,466,939.360 (2,193,062,525)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	207,263.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	149,811.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	591,300.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	234,850.960	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	433,230.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	494,350.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	394,560.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	194,560.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	238,188.600	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	500,000.000	492,500.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	287,175.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	140,635.900	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 3,858,424.460 (389,855,208)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	

	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	3,146,346.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,111,820.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,820,000.000	3,828,709.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,572,117.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,387,590.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	518,340.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,768,850.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,460,120.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 24,793,893.900 (325,791,766)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	6,740,000.000	9,022,029.200	デンマーク・クローネ
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	670,000.000	666,576.300	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,830,000.000	2,802,549.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	2,967,808.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	4,216,840.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,535,712.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,656,820.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	3,000,000.000	2,872,440.000	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 25,740,774.500 (497,054,355)	



ニュージーランド ド・ドル		ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	1,005,730.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	285,342.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	252,708.000	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	466,890.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	406,550.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	149,998.000	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 2,567,218.000 (221,114,487)	
ノルウェー・ク ローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	6,300,000.000	6,265,476.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	144,586.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,350,863.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,823,630.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,885,160.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,833,840.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,203,275.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,716,360.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,839,020.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 20,062,211.300 (278,864,737)	

ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,257,596.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,502,638.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,900,000.000	2,740,413.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	1,811,250.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	2,000,000.000	1,836,980.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,211,688.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	697,086.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	662,300.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	570,210.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,477,494.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	2,230,000.000	2,028,742.500		
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 16,796,398.000 (515,849,296)	
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,788,512.000	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	998,580.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,943,077.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,345,316.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,473,960.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,152,196.500		

	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	494,280.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,449,720.600	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,700,000.000	2,723,544.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	497,740.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,044,120.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,685,600.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,498,065.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,177,356.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,237,002.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,400,000.000	1,283,464.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,288,798.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 23,081,331.600 (710,667,275)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	21,643,512.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	10,115,731.500	
	8% Mexican Bonos 20240905	27,900,000.000	26,953,632.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,560,513.800	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	6,317,366.200	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,433,440.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,917,090.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,273,215.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,684,050.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	20,782,985.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	12,115,736.500	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,211,805.000	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 147,009,077.000	

			(1,061,728,956)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	166,128.400	
0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	774,168.000	
0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	170,524.800	
1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	222,903.900	
0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	184,082.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	129,372.000	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	451,545.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	265,506.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	254,807.000	
0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	101,245.500	
0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	109,932.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	164,438.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	367,844.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	275,046.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	540,000.000	527,045.400	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	465,994.900	
1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	222,158.700	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	199,211.600	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	931,100.000	

2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	172,346.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	557,838.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	628,173.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	379,584.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	397,722.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	50,818.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	820,310.000	
Austria Government Bond 20250420	400,000.000	380,120.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	146,230.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	78,567.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	176,230.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,170,000.000	1,134,116.100	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	269,580.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	413,369.800	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	572,663.700	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	470,000.000	422,365.500	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	686,915.400	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	485,450.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	285,029.500	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	340,480.000	

0.8% Belgium Government Bond 20280622	880,000.000	817,801.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	446,160.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	100,000.000	91,820.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	282,789.500	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	765,639.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	407,394.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	269,769.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	324,656.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	270,000.000	135,099.900	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	700,000.000	574,224.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	294,444.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	544,716.900	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	941,600.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	918,064.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	2,096,000.000	2,699,228.800	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,530,300.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	4,225,101.600	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,737,861.400	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,342,656.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	2,548,443.800	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	796,056.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,221,503.040	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	2,300,000.000	2,293,790.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	775,000.000	874,944.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,990,000.000	1,975,512.800	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	1,967,880.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,152,764.900	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,400,000.000	3,315,374.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	1,883,000.000	1,800,449.280	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	3,850,000.000	3,591,588.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,550,000.000	1,449,002.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	2,912,109.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,460,000.000	1,304,232.600	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	979,377.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,800,000.000	1,643,850.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,631,952.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	441,940.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	994,176.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	612,717.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	235,212.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	700,000.000	601,433.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	153,888.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	249,044.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,362,624.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	900,000.000	541,215.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	486,885.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,715,000.000	1,899,396.800	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,375,892.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,485,323.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	1,587,666.080	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,484,338.350	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	2,706,587.570	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,314,040.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,640,000.000	3,797,466.400	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,476,708.800	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,477,135.600	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	1,500,000.000	1,501,470.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,186,000.000	1,212,542.680	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,000,000.000	1,982,700.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	5,400,000.000	5,184,324.000	



1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,250,000.000	2,126,610.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,212,558.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,150,000.000	1,822,340.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,070,000.000	1,922,553.900	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	500,000.000	446,470.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,331,540.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	400,000.000	353,576.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	2,778,150.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,572,012.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,528,240.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,200,000.000	2,139,170.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,150,000.000	1,693,211.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,400,000.000	3,949,616.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,400,000.000	2,059,968.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,100,000.000	695,750.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	704,970.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	2,512,560.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	200,000.000	93,222.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	200,000.000	132,152.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,600,000.000	2,123,056.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	900,000.000	822,141.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	620,210.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	600,000.000	482,046.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	675,937.800	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,400,000.000	1,697,080.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,180,000.000	1,473,218.200	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	400,771.800	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	1,034,715.500	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	980,000.000	979,333.600	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,582,842.700	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	970,000.000	916,514.200	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	390,832.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	839,016.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	621,166.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	190,987.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	641,812.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	230,580.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	585,634.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	264,201.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	300,000.000	256,599.000	

7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,700,000.000	3,131,406.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,309,211.150	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	2,000,000.000	1,995,000.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	826,047.800	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	890,624.400	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,267,950.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	876,096.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	400,000.000	332,564.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,250,000.000	1,044,525.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	700,000.000	546,812.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	200,000.000	174,976.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,638,001.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	893,199.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	1,954,695.500	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	620,760.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,500,000.000	2,355,650.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	875,961.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,285,908.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	660,345.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	500,230.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,100,000.000	1,074,447.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,356,236.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	431,290.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	250,000.000	192,925.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	378,345.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	413,225.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	520,986.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	511,686.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	808,900.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	261,520.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	138,444.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,600,000.000	1,244,368.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	200,000.000	131,380.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	295,614.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	238,287.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	418,355.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	142,408.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	480,900.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	367,200.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,057,543.200	

6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,755,765.600	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,510,145.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,816,287.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,291,145.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,285,179.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,900,000.000	3,044,217.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,714,000.000	1,944,001.660	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	3,403,205.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,236,665.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,025,000.000	1,146,319.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,830,000.000	2,896,222.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,150,090.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,376,808.900	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,168,970.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	934,717.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,170,795.900	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	754,320.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	338,454.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	455,438.100	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	805,728.000	

3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	311,664.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	737,914.400	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	300,000.000	305,244.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	688,840.000	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	455,965.500	
1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	501,904.000	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	509,608.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	746,640.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	134,238.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	1,027,312.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	279,378.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	317,036.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	163,308.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	138,966.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	448,757.200	
4.15% Austria Government Bond 20370315	800,000.000	945,808.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	761,404.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	222,184.900	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	622,710.900	
1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	872,124.000	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	209,932.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	123,030.000	
2.625% Finland Government Bond 20420704	460,000.000	467,521.000	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	349,741.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,701,642.800	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	3,100,000.000	3,055,267.000	

1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	865,519.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,383,396.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	989,000.000	948,777.370	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,480,000.000	1,531,208.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,021,460.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	779,360.800	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,115,583.300	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,650,000.000	1,557,121.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,050,000.000	961,348.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	748,136.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,400,000.000	1,228,486.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	788,328.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	858,010.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	60,345.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,618,470.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	950,000.000	690,232.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	643,768.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	112,402.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	879,050.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,400,000.000	1,151,178.000	

	1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	343,460.000	
	0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	826,690.000	
	0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	400,000.000	355,280.000	
	2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	600,000.000	582,042.000	
	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	853,019.200	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	1,016,469.000	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	991,064.000	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	609,775.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,126,790.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,700,000.000	1,938,391.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	790,000.000	1,037,127.800	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	3,700,000.000	3,779,957.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,084,000.000	1,094,167.920	
	ユーロ 小計		ユーロ 267,980,255.400 (38,476,605,069)	
国債証券 合計			112,059,642,197 [112,059,642,197]	
合計			112,059,642,197 [112,059,642,197]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 91銘柄	100%	49.8%



イギリス・ポンド	国債証券	42銘柄	100%	4.9%
イスラエル・シケル	国債証券	8銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	19銘柄	100%	1.7%
オフショア・人民元	国債証券	32銘柄	100%	3.5%
カナダ・ドル	国債証券	22銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	100%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	6銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	11銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券	17銘柄	100%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券	12銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	258銘柄	100%	34.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	11,653,159	9,568,774
親投資信託受益証券	3,291,001,472	2,428,166,009
未収入金	-	3,147,729
流動資産合計	3,302,654,631	2,440,882,512
<b>資産合計</b>		
3,302,654,631		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	550,773	4,390,286
未払受託者報酬	357,140	272,664
未払委託者報酬	4,107,513	3,136,085
その他未払費用	133,856	102,160
流動負債合計	5,149,282	7,901,195
<b>負債合計</b>		
5,149,282		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,901,476,819	1 2,102,708,293
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	396,028,530	330,273,024
（分配準備積立金）	192,327,925	155,537,125
元本等合計	3,297,505,349	2,432,981,317
<b>純資産合計</b>		
3,297,505,349		
<b>負債純資産合計</b>		
3,302,654,631		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		96,613,317		59,462,639
営業収益合計		96,613,317		59,462,641
営業費用				
支払利息		2,464		2,143
受託者報酬		654,894		608,286
委託者報酬		7,532,281		6,996,226
その他費用		245,446		227,941
営業費用合計		8,435,085		7,834,596
営業利益		88,178,232		51,628,045
経常利益		88,178,232		51,628,045
当期純利益		88,178,232		51,628,045
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		9,822,757		12,226,307
期首剰余金又は期首欠損金( )		224,929,928		396,028,530
剰余金増加額又は欠損金減少額		136,793,749		64,181,141
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		136,793,749		64,181,141
剰余金減少額又は欠損金増加額		44,050,622		169,338,385
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		44,050,622		169,338,385
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		396,028,530		330,273,024

## (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6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,237,982,504円	2,901,476,819円
期中追加設定元本額	1,085,864,243円	442,770,444円
期中一部解約元本額	422,369,928円	1,241,538,970円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,901,476,819口	2,102,708,293口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(78,356,116円)、投資信託約款に規定される収益調整金(203,702,967円)及び分配準備積立金(113,971,809円)より分配対象額は396,030,892円(1万口当たり1,364.93円)であり、分配を行っていません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(39,402,197円)、投資信託約款に規定される収益調整金(174,737,798円)及び分配準備積立金(116,134,928円)より分配対象額は330,274,923円(1万口当たり1,570.71円)であり、分配を行っていません。
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	92,130,794	45,322,123
合計	92,130,794	45,322,123

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1365円	1.1571円
（1万口当たり純資産額）	（11,365円）	（11,571円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	329,482,256	490,928,561	
	外国債券インデックスマザーファンド	612,758,959	1,937,237,448	
親投資信託受益証券 合計			2,428,166,009	
合計			2,428,166,009	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	700,635,449	744,126,868
コール・ローン	1,607,697,128	2,484,935,442



国債証券	230,341,773,353	236,705,030,930
派生商品評価勘定	431,286	191,337
未収入金	2,787,836	30,062
未収利息	1,240,818,660	1,496,086,797
前払費用	21,860,457	72,896,925
流動資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,725,909	25,202,627
未払金	252,029,658	3,816,639
未払解約金	25,134,000	121,960,511
流動負債合計	283,889,567	150,979,777
負債合計	283,889,567	150,979,777
純資産の部		
元本等		
元本	1 74,475,307,643	76,340,507,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	159,156,806,959	165,011,810,967
元本等合計	233,632,114,602	241,352,318,584
純資産合計	233,632,114,602	241,352,318,584
負債純資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	72,688,498,430円	74,475,307,643円
期中追加設定元本額	10,294,827,028円	9,175,662,845円
期中一部解約元本額	8,508,017,815円	7,310,462,871円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス	498,388,691円	447,343,827円
VA		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	10,756,510円	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	79,498,163円	51,739,813円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	22,023,940円	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	312,397,465円	243,846,488円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	211,430,078円	347,889,324円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	505,972,682円	589,471,225円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,311,980,333円	2,679,395,542円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマー ジングプラス(為替 ヘッジなし)	842,742,592円	612,758,959円
D-I's 外国債券インデッ クス	744,003円	992,049円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	7,190,607円	12,619,026円
iFree 外国債券イン デックス	1,686,822,876円	2,022,055,185円
iFree 8資産バランス	1,443,360,479円	1,843,024,587円
iFree 年金バランス	229,923,693円	342,801,665円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,590,694,433円	50,603,926,450円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	964,870,268円	1,059,415,494円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	601,682,079円	676,505,626円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	393,993,399円	451,133,774円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	578,219,728円	638,338,066円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	439,097,748円	501,969,526円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	160,496,213円	192,677,874円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円	31,943,484円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円	13,831,284円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円	1,384,617,622円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,367,466円	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,453,811円	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,909,053円	2,590,775円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	317,987円	159,668,286円
ダイワ世界バランスファンド40VA	163,610,849円	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド60VA	135,308,646円	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,912,241,392円	3,287,759,159円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	231,133,046円	199,611,808円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円	150,551,922円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779円	49,437,293円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,367,106,464円	1,733,569,277円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円	5,720,730,269円
ダイワライフスタイル25	33,014,942円	28,448,488円
ダイワライフスタイル50	65,372,616円	58,536,147円

ダイワライフスタイル75	17,425,714円	14,977,183円
計	74,475,307,643円	76,340,507,617円
2. 期末日における受益権の総数	74,475,307,643口	76,340,507,617口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	9,023,697,557	40,716,680,142
合計	9,023,697,557	40,716,680,142

## (注)

「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	1,712,299,150	-	1,706,004,527	6,294,623	2,152,583,358	-	2,127,572,068	25,011,290
アメリカ・ドル	755,807,619	-	756,096,737	289,118	941,267,656	-	934,036,875	7,230,781
イギリス・ポ ン ド	66,758,721	-	66,834,123	75,402	179,447,652	-	179,112,796	334,856
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	90,011,493	-	88,942,453	1,069,040
オフショア 人民元	-	-	-	-	88,623,078	-	84,987,194	3,635,884
カナダ・ドル	61,806,931	-	59,980,905	1,826,026	176,541,309	-	169,074,798	7,466,511

シンガポ ル・ドル	31,361,148	-	31,422,799	61,651	51,909,276	-	50,075,168	1,834,108
デンマーク クローネ	53,986,987	-	52,312,950	1,674,037	-	-	-	-
メキシコ・ペ ソ	-	-	-	-	32,514,295	-	31,607,270	907,025
ユーロ	742,577,744	-	739,357,013	3,220,731	592,268,599	-	589,735,514	2,533,085
合計	1,712,299,150	-	1,706,004,527	6,294,623	2,152,583,358	-	2,127,572,068	25,011,290

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.1370円	3.1615円
(1万口当たり純資産額)	(31,370円)	(31,615円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,926,655.410	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,106,013.920	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,758,843.840	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	900,246.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	775,107.160	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	786,051.180	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	822,435.180	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,650,208.310	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,274,090.160	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	960,777.510	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	583,811.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	560,436.960	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,002,550.280	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,173,014.400	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,142,499.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,282,382.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,103,364.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,775,105.860	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,080,471.850			



4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,526,232.240	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,386,986.700	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,439,501.700	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,466,028.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,273,839.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,424,864.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,159,656.300	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,281,416.570	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,330,422.300	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,278,448.900	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,909,660.980	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,012,353.640	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,984,941.040	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,090,722.200	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,981,424.510	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,933,513.040	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,656,297.270	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,671,666.690	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,304,910.020	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,451,772.470	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,963,898.750	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,488,413.120	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,536,739.100	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,408,470.250	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,532,844.470	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,518,800.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	551,418.250	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,490,004.180	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,396,887.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,101,250.620	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,146,891.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,914,810.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,007,438.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,894,391.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,430,950.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	817,960.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,427,276.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,434,075.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,385,891.600	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,409,940.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,960,443.450	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,226,860.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,396,255.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,969,472.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,672,960.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,887,590.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,093,671.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,303,472.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,462,515.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,878,800.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,157,665.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,907,640.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,394,375.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,072,870.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,995,975.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,355,345.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,056,096.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,677,276.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,984,367.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,495,688.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,605,068.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,513,760.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,791,569.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,266,062.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,152,380.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,834,754.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,426,566.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,888,430.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,328,820.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,707,923.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,411,900.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,457,800.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,417,075.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,415,325.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	3,934,840.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,537,977.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,727,422.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,887,020.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,964,060.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,432,020.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,444,025.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,127,638.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,898,280.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,383,300.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,969,103.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,371,275.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,205,884.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,352,825.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,836,250.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,560,856.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,381,035.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,641,184.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,802,060.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,346,035.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,591,848.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,245,185.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,309,550.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,092,102.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,326,536.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,534,308.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,775,120.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,283,200.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,839,680.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	945,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,733,150.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,504,437.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,347,730.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,819,800.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,829,480.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,284,700.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,367,275.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,593,750.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,285,500.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,864,170.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,668,814.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	266,226.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,837,820.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,373,700.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,384,624.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,421,096.000	

0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,457,081.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,061,648.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,104,696.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,176,650.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	2,997,190.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,711,580.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,871,775.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	2,990,295.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,059,048.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,344,000.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,238,750.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,838,363.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,151,250.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	2,975,385.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,583,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,371,840.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,136,980.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	2,000,000.000	1,915,780.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,908,502.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,568,800.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,383,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,172,140.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,358,095.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,551,036.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,247,250.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,859,630.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,237,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	890,950.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,797,960.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	5,956,650.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,865,149.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,796,898.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,729,650.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,436,600.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,334,250.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,370,652.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,665,230.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,888,420.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,483,800.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,577,720.000	



0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,827,260.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,378,644.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,781,403.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,013,235.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,215,380.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,730,496.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,899,476.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,470,520.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,913,580.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,868,820.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,328,700.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,458,200.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,136,560.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,792,730.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,410,568.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,659,639.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,562,176.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,287,680.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,257,800.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,281,600.000	

0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,417,350.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	6,964,425.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,305,050.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,100,615.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,861,160.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,184,820.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,384,860.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,312,638.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,892,320.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,843,920.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,193,960.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,250,720.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,583,560.000	
0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,793,200.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,877,208.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,052,094.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,394,800.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,458,880.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,577,320.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	932,810.000	

0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,868,270.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,885,032.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,471,784.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,791,052.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,799,459.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,931,250.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,441,950.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,843,720.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	915,580.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,714,450.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,741,130.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,695,100.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,935,920.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,920,620.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,647,512.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,888,190.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,133,550.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,337,340.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,362,345.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,823,030.000	

2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,845,650.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,356,720.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,602,260.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,887,140.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,931,320.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,847,880.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,905,470.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,902,830.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,855,429.600	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	974,450.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,426,050.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,500,000.000	6,888,225.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	3,700,000.000	3,150,772.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	908,590.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,867,931.300	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,111,796.800	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,802,825.100	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,409,500.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,342,605.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,254,000.000	

	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,481,800.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,499,200.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,509,660.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,398,640.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	997,420.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 864,609,414.840 (120,068,309,439)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	893,416.050	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	1,116,122.020	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,382,388.650	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,200,267.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,170,367.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,272,882.500	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,292,081.700	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,378,710.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	694,865.600	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,745,820.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	869,808.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	574,991.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,291,995.000	

0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,785,183.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	835,106.300	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,051,661.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	737,970.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,367,745.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,368,000.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	564,454.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,226,482.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,253,408.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,955,900.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	297,105.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	448,745.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	800,000.000	492,728.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	93,460.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	643,077.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	594,146.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	236,241.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	195,687.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	2,100,000.000	1,738,002.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	441,676.600	

4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,052,200.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,088,512.490	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,454,345.600	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,528,436.480	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,491,621.540	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,574,567.810	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,035,423.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,541,954.460	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,287,132.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,437,103.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,789,888.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,536,499.440	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,586,999.460	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,751,037.600	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,384,568.640	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,740,266.810	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,666,289.280	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,799,402.460	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,534,509.900	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,081,287.480	

	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,530,385.560	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 67,102,924.230 (11,154,519,095)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,989,162.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,051,456.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,009,520.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,204,182.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,704,636.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,479,608.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,132,044.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,475,895.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,045,232.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,494,176.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,330,913.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,434.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	850,743.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	252,459.000	
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 21,202,460.000 (855,180,022)	
オーストラリ ア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	



4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,104,660.350	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,837.040	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,339,119.540	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,801,056.600	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,354,815.680	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,803,096.960	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,099,810.950	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,176,300.000	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	725,590.800	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,626,772.400	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,111,643.260	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,054,409.360	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,446,240.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,814,614.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,680,924.400	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,163,721.900	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,410,421.600	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,383,511.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,266,632.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,645,320.000	

	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	870,996.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,465,584.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,008,925.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,081,200.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,353,440.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,225,432.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 38,584,074.840 (3,580,216,304)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,313,516.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,155,800.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,171,650.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,132,900.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,285,840.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,191,920.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,116,610.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,405,230.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	37,000,000.000	37,276,760.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,336,240.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,257,760.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	12,986,250.000	

3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,125,090.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,983,426.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,089,530.000	
3.72% China Government Bond 20510412	8,000,000.000	8,618,000.000	
3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,868,440.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,513,005.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,037,450.000	
3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,249,040.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,751,240.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,413,100.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,297,450.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,537,200.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,722,615.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,070,510.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	6,931,449.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,372,790.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,187,320.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,543,890.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,632,440.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,011,220.000	

	2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,825,070.000	
	2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,116,336.000	
	2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,963,900.000	
	2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	14,962,950.000	
	3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,547,355.000	
	2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	4,931,200.000	
	2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	3,977,840.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,924,600.000	
	2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	12,000,000.000	11,715,360.000	
	1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	2,000,000.000	1,988,260.000	
	2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,349,805.000	
	2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	2,200,000.000	2,174,436.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 388,062,793.000 (7,534,316,739)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 605,000.000	カナダ・ドル 563,787.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,140,555.240	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,386,465.080	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,235,014.440	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,026,166.350	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,026,165.410	

2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,374,371.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,265,523.980	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,116,002.400	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,904.550	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,128,015.600	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	616,167.500	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,968,037.100	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,167,613.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,173,072.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,342,768.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,050,386.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	661,199.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,649,031.800	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,648,660.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,887,816.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,141,404.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	274,407.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,020,866.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	944,230.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	1,079,423.500	

0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	966,220.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	183,678.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,884,650.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,852,914.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,636.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	385,896.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,376,610.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,513.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	391,596.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,934.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	980,930.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	736,558.900	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	353,718.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	202,996.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 46,591,902.950 (4,759,828,805)	
シンガポール・ ドル	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	788,212.000	
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	921,837.020	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	797,269.500	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	393,056.000	

	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	585,892.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	617,937.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,873.600	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	679,056.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	437,760.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	687,082.500	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	540,705.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	482,650.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	320,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	443,070.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	699,225.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	535,650.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	165,454.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,460.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	231,993.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	233,637.800	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,817.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 10,365,238.520 (1,047,303,700)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	スウェーデン・クローナ 5,812,000.250	

	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	7,951,170.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,612,316.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,867,741.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,728,365.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,421,044.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,906,880.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,325,150.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 46,624,668.150 (612,648,139)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	18,287,679.960	デンマーク・クローネ
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,821,236.940	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,954,673.900	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,729,944.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,706,948.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,239,580.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	414,205.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	957,480.000	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 45,111,747.800 (871,107,850)	
ニュージーラン ド・ドル		ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	



	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	603,438.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	400,000.000	380,456.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	412,756.400	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	560,268.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	430,943.000	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,994.500	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20240515	700,000.000	658,973.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	322,600.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	436,920.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	368,222.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	284,996.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,177.600	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 5,308,745.500 (457,242,250)	
ノルウェー・ク ローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,072,559.400	ノルウェー・クローネ
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,200,294.450	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,099,824.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,188,384.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,299,030.000	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,530,142.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	5,992,908.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,003,630.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,563,167.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 34,949,939.750 (485,804,163)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,742,991.550	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,624,443.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,712,063.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,811,500.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,122,866.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,742,300.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,019,480.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,703,988.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	891,930.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,192,140.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	436,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	785,939.450	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	2,996,029.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,176,662.250	

ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 31,959,193.650 (981,527,559)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,325,397.620	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,197,083.600	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,535,862.160	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,298,154.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	728,404.950	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,371,261.380	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,853,259.040	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,368,237.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,067,379.740	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,740,317.670	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,206,043.200	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	949,464.900	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,546,016.500	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,516.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,184,621.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,036,034.000		
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,201,416.000		
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,231,488.000		

	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	632,100.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	649,161.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,266,410.300	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,254,516.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	400,008.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,237,002.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,604,330.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,439,510.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,596,672.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	478,590.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	412,068.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	510,995.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 38,885,320.260 (1,197,267,345)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,350,684.400	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,817,911.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	22,992,704.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,065,780.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	898,140.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	3,000,000.000	2,636,250.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	28,033,000.000	27,286,481.210	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,833,609.170	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,130,502.400	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,413,184.240	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,513,209.840	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,700,088.140	

	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	29,769,108.250	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	18,672,893.820	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,104,716.400	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 273,185,262.870 (1,972,998,605)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	318,267.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	269,991.090	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	768,308.960	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	297,205.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	736,328.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	405,365.600	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	451,545.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	442,510.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,866.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	225,686.200	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	269,988.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	416,505.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	219,864.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	493,314.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	183,922.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	308,920.500	

1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	275,046.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	259,831.800	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,340,061.730	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,070,837.260	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	645,083.040	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	170,752.800	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,191,808.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	465,334.200	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,115,676.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,148,659.200	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,232.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	826,649.600	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	464,009.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	255,452.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	177,863.000	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	984,372.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	456,144.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,690.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	157,134.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	262,503.000	

0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	434,875.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	264,345.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	298,617.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,646,891.670	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,594,116.400	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	950,750.540	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,408,078.980	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	999,019.080	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	665,001.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,035,078.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,019,445.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	533,281.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	510,720.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,384,686.800	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	580,008.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,377,300.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	565,579.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,037,866.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	583,931.400	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,079,076.000	

Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,298,624.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	265,196.100	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	328,128.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	588,888.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	400,868.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,020,089.680	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,397,109.060	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,544,674.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,090,201.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,512,497.800	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,856,177.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,978,244.400	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	4,089,600.460	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,744,137.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,448,477.220	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,395,449.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,123,843.840	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,556,785.300	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,024,483.840	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,582,395.680	



1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,977,085.480	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,125,349.740	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,080,884.740	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,264,186.880	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,257,569.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,926,328.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,099,987.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,474,468.700	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,772,206.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,744,325.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	1,994,608.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,651,640.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,770,876.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,531,792.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,646,484.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,825,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,562,634.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,041,732.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	773,271.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,077,216.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,791,900.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	684,871.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,065,904.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	596,309.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,800,000.000	1,515,600.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	348,012.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,650,212.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,197,684.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	202,778.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	721,620.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,116,504.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	97,489.000	
0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,266.000	
0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	515,027.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,869,638.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,637,321.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,291,472.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,177,433.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,965.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,065,096.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,207,050.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	92,064.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,915,670.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	418,291.100	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,350,248.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,967,927.840	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,190,001.340	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,264,028.860	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,273,249.160	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,785,627.860	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,996,100.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,599,186.680	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,803,725.960	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	6,062,284.320	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,404,025.920	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,091,964.280	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,200,847.060	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,856,623.650	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,352,529.520	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,934,095.280	

1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,839,219.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,145,144.690	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,533,644.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,113,677.780	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,761,518.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,294,855.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,233,740.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,254,047.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,000,670.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,449,693.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,550,832.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,305,990.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,244,489.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,904,734.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,116,444.400	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,604,944.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,752,025.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,798,460.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,550,934.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,350,080.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	689,842.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	97,407.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	991,140.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,756,176.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,831,819.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,500,000.000	930,315.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,687,161.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,999,410.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	164,956.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	278,616.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,300,000.000	1,256,125.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	973,260.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,327,401.990	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,127,411.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,158,639.210	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,508,546.160	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,193,369.450	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,512,970.480	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,711,175.130	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,836,855.780	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,078,692.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,367,912.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,258,524.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,064,856.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	687,555.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,198,050.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	736,584.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	720,562.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,087,606.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	646,416.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	792,603.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,827.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	513,198.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	298,677.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	958,955.700	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,287,355.800	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,759,148.080	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,809,465.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,377,354.840	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,407,590.090	

1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,745,544.500	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,814,215.040	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,338,570.100	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,275,313.460	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,941,980.880	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	997,917.840	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	756,162.880	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,312,320.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,454,930.300	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,285,674.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,250,000.000	1,175,262.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,574,477.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,566,608.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,152,840.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,978,746.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,260,298.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,481,889.500	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,533,198.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,198,054.500	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,650,759.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,855,863.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,170,696.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,034,354.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,119,050.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,638,902.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,236,612.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,152,247.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,196,135.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,135,035.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,460,430.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,652,900.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,823,451.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,987,480.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,571,990.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,096,470.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,536,910.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,069,321.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	784,560.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	484,554.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,620,453.000	



0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,399,914.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	459,830.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	993,938.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,448,520.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	302,183.200	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	684,856.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,509,151.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	956,800.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,165,620.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,776,887.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,331,967.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	753,039.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	285,222.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	569,632.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	195,222.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,676.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	477,475.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	769,440.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	3,300,000.000	2,950,794.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	275,400.000	

1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	98,605.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	194,210.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	504,835.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	303,447.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,638,720.420	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,361,677.550	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,096,778.250	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,529,592.440	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,785,621.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,304,303.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,223,328.140	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,543,988.170	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,167,579.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,591,521.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,027,586.680	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,245,339.600	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,242,819.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,329,520.460	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,994,262.820	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,372,936.160	

4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,946,069.040	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,078,677.600	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	879,980.400	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	750,888.970	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,515,775.800	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	776,043.360	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,105,799.050	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	617,610.360	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	973,493.000	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	832,360.550	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,035,659.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	491,727.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	746,640.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	671,190.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	700,440.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	884,697.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	475,554.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	270,788.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	458,680.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	681,512.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	653,232.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	277,932.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	82,526.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	974,275.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,623,242.980	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	951,755.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	441,755.860	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	800,216.400	

2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	762,079.530	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	923,658.600	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	700,123.220	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	398,822.250	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	413,654.450	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	528,608.540	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,177,997.680	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,015,490.650	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,951,698.240	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,187,681.760	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,700,586.620	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,872,612.160	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,603,630.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,530,401.900	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,828,940.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,663,270.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,954,654.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,264,904.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,098,684.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,728,697.000	

1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,496,272.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,974,352.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,226,929.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,452,576.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,166,893.600	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,383,275.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	844,830.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,226,408.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,157,960.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	944,528.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	464,440.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,770,362.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	289,917.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	365,306.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	439,525.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,384,454.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,562,313.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	412,152.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	813,447.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,736,049.000	

1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	444,180.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,363.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	88,820.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,000,000.000	970,070.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,022,650.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,733,424.760	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,980,985.140	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,158,000.000	1,434,565.140	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,732,830.040	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,406,172.150	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,961,834.330	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,214,142.350	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	1,937,023.950	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,018,207.100	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,705,353.180	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,012,571.700	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,116,669.860	
ユーロ 小計		ユーロ 565,028,283.290 (81,126,760,915)	
国債証券 合計		236,705,030,930 [236,705,030,930]	
合計		236,705,030,930 [236,705,030,930]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 264銘柄	100%	50.7%
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 44銘柄	100%	3.2%
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券 12銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 361銘柄	100%	34.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	100,004,542	157,336,403

コール・ローン		542,091,267	440,930,695
国債証券		21,276,625,965	27,182,896,716
派生商品評価勘定		292,081	105,019
未収入金		-	56,265
未収利息		319,491,159	445,277,014
前払費用		24,660,391	32,504,577
流動資産合計		22,263,165,405	28,259,106,689
資産合計		22,263,165,405	28,259,106,689
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,207,740	511,975
未払金		83,348,434	725,856
未払解約金		972,694	7,463,241
流動負債合計		93,528,868	8,701,072
負債合計		93,528,868	8,701,072
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,940,538,445	18,960,433,420
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		6,229,098,092	9,289,972,197
元本等合計		22,169,636,537	28,250,405,617
純資産合計		22,169,636,537	28,250,405,617
負債純資産合計		22,263,165,405	28,259,106,689

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券



	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	12,662,214,054円	15,940,538,445円
期中追加設定元本額	3,908,197,223円	3,884,670,408円
期中一部解約元本額	629,872,832円	864,775,433円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投 資家専用)	189,176,823円	295,163,560円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	282,000,485円	316,592,694円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	465,428,503円	329,482,256円
D-I's 新興国債券イン デックス	59,229,933円	58,283,042円
iFree 新興国債券イン デックス	4,401,328,904円	5,713,460,800円
iFree 8資産バランス	3,170,229,988円	3,953,405,236円
ダイワ新興国債券インデック ス(為替ヘッジなし)(投資 一任専用)	- 円	1,668,817円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	7,189,020,897円	8,118,153,342円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	151,785,240円	142,960,716円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	32,337,672円	31,262,957円
計	15,940,538,445円	18,960,433,420円
2. 期末日における受益権の総数	15,940,538,445口	18,960,433,420口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	777,592,418	279,698,300
合計	777,592,418	279,698,300

(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7月6日から2021年11月30日まで、及び2022年7月6日から2022年11月30日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	53,468,010	-	53,472,000	3,990	-	-	-	-
オフショア・ 人民元	53,468,010	-	53,472,000	3,990	-	-	-	-
買 建	293,497,596	-	284,585,927	8,911,669	104,961,810	-	104,554,854	406,956
オフショア・ 人民元	-	-	-	-	22,151,396	-	21,989,150	162,246
チェコ・コルナ	46,486,583	-	45,731,287	755,296	13,042,655	-	12,966,917	75,738
トルコ・リラ	8,349,837	-	6,336,230	2,013,607	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	6,737,757	-	6,547,433	190,324	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	-	-	-	-	18,887,461	-	18,840,402	47,059
メキシコ・ペ ソ	86,404,119	-	83,264,226	3,139,893	26,421,739	-	26,526,758	105,019
ルーマニア・ レイ	87,664,659	-	85,758,115	1,906,544	24,458,559	-	24,231,627	226,932
ロシア・ルー ブル	18,168,000	-	18,236,400	68,400	-	-	-	-
南アフリカ・ ランド	39,686,641	-	38,712,236	974,405	-	-	-	-

合計	346,965,606	-	338,057,927	8,915,659	104,961,810	-	104,554,854	406,956
----	-------------	---	-------------	-----------	-------------	---	-------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3908円	1.4900円
(1万口当たり純資産額)	(13,908円)	(14,900円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	8,966,347,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	8,000,000,000.000	8,888,640,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,682,050,000.000	

7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,483,303,000.000	
8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,263,900,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	4,700,000,000.000	5,172,538,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	12,797,160,000.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20300915	17,300,000,000.000	17,348,613,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	13,700,000,000.000	13,726,441,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	9,300,000,000.000	9,573,513,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	11,500,000,000.000	11,743,915,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	14,400,000,000.000	13,994,496,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	15,800,000,000.000	15,328,212,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	4,300,000,000.000	4,006,353,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	16,100,000,000.000	15,475,159,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	12,000,000,000.000	11,409,240,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	11,700,000,000.000	11,712,285,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,525,688,000.000	
7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	4,000,000,000.000	3,985,640,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	3,400,000,000.000	3,324,384,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	3,999,420,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,176,939,600.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,395,660,400.000	

	8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	13,614,984,320.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,121,640,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	12,530,000,000.000	12,659,434,900.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,084,172,500.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	6,846,336,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	13,692,122,400.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	15,150,000,000.000	15,569,806,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	10,620,000,000.000	11,727,135,000.000	
	インドネシア・ルビア 小計		インドネシア・ルビア 295,295,529,120.000 (2,628,130,209)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,539,320.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	6,037,500.000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 8,576,820.000 (30,233,291)	
エジプト・ポンド	16.1% ARAB REP EGYPT 20290507	1,500,000.000	1,329,825.000	
	14.35% ARAB REP EGYPT 20240910	1,000,000.000	929,880.000	
	14.4% ARAB REP EGYPT 20290910	4,000,000.000	3,281,800.000	
	13.536% ARAB REP EGYPT 20250114	1,500,000.000	1,351,065.000	
	14.664% ARAB REP EGYPT 20301006	4,500,000.000	3,675,465.000	
	14.556% ARAB REP EGYPT 20271013	2,000,000.000	1,710,420.000	

	14.369% ARAB REP EGYPT 20251020	9,000,000.000	8,061,480.000	
	14.292% ARAB REP EGYPT 20280105	6,000,000.000	5,049,480.000	
	14.06% ARAB REP EGYPT 20260112	10,000,000.000	8,816,200.000	
	14.483% ARAB REP EGYPT 20260406	9,000,000.000	7,972,650.000	
	14.563% ARAB REP EGYPT 20260706	1,000,000.000	886,000.000	
	14.531% ARAB REP EGYPT 20240914	8,300,000.000	7,740,165.000	
	エジプト・ポンド 小計		エジプト・ポンド 50,804,430.000 (287,039,949)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.29% China Government Bond 20231018	1,700,000.000	1,721,709.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,780,771.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,949,568.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	4,000,000.000	4,060,080.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,102,547.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,927,584.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,300,044.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	5,836,743.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,548,015.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,843,056.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	8,000,000.000	7,883,360.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,426,485.000	



2.36% China Government Bond 20230702	4,650,000.000	4,661,625.000	
2.88% China Government Bond 20231105	4,900,000.000	4,936,652.000	
3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,130,760.000	
3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,143,200.000	
3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,545,070.000	
3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,969,693.000	
3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,342,996.000	
2.84% China Government Bond 20240408	4,000,000.000	4,037,760.000	
3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,063,950.000	
3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,154,500.000	
3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,082,600.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	2,500,000.000	2,507,225.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,814,364.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	1,000,000.000	1,037,840.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	1,000,000.000	1,001,870.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,491,355.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,180,332.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	1,000,000.000	1,008,610.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,465,600.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,562,048.000	
オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元	

			133,518,012.000 (2,592,278,906)	
コロンビア・ペソ		コロンビア・ペソ	コロンビア・ペソ	
	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	79,100,100.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,850,000,000.000	3,746,974,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	5,570,000,000.000	4,131,826,000.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	4,710,000,000.000	4,015,463,400.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	3,600,000,000.000	2,700,180,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	4,650,000,000.000	3,165,208,500.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	3,700,000,000.000	3,157,913,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,900,000,000.000	3,239,733,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,200,000,000.000	2,407,872,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	3,610,000,000.000	2,062,212,500.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	1,900,000,000.000	1,098,713,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	3,798,846,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	3,400,000,000.000	2,469,352,000.000	
コロンビア・ペソ	小計		コロンビア・ペソ 36,073,393,500.000 (1,040,789,549)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	36,050,000.000	41,560,603.000	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	23,589,852.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,610,000.000	33,417,143.700	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	32,700,000.000	35,411,157.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	29,600,000.000	30,200,584.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	35,400,000.000	35,377,344.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	37,500,000.000	41,122,125.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	29,071,700.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	37,500,000.000	37,845,000.000	

2.875% Thailand Government Bond 20281217	34,500,000.000	35,578,815.000	
3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,500,000.000	39,507,750.000	
1.45% Thailand Government Bond 20241217	42,000,000.000	41,719,860.000	
1.6% Thailand Government Bond 20291217	36,500,000.000	34,593,970.000	
1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	13,275,285.000	
0.95% Thailand Government Bond 20250617	34,000,000.000	33,268,320.000	
0.75% Thailand Government Bond 20240617	39,900,000.000	39,352,572.000	
1.585% Thailand Government Bond 20351217	32,900,000.000	27,671,861.000	
2% Thailand Government Bond 20311217	51,000,000.000	48,864,630.000	
2% Thailand Government Bond 20420617	23,000,000.000	17,816,950.000	
1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	48,000,000.000	45,539,040.000	
0.75% THAILAND GOVERNMENT BOND 20240917	43,000,000.000	42,279,320.000	
2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	8,000,000.000	8,171,440.000	
タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 735,235,321.700 (2,889,474,815)	
チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	19,600,000.000	17,426,556.000	
5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	12,100,000.000	12,115,730.000	
2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	21,100,000.000	19,590,506.000	
1% Czech Republic Government Bond 20260626	23,900,000.000	20,852,272.000	
0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	22,000,000.000	16,898,860.000	

	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	11,900,000.000	11,301,311.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	22,500,000.000	18,582,300.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	24,500,000.000	21,727,090.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	22,000,000.000	17,114,020.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	16,200,000.000	12,382,308.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	10,000,000.000	7,270,000.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	9,500,000.000	9,060,530.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	14,500,000.000	11,298,400.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	17,500,000.000	16,043,125.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	10,000,000.000	6,267,500.000	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20241212	5,000,000.000	4,498,750.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	6,000,000.000	5,376,000.000	
	6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	15,500,000.000	15,937,100.000	
	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	10,500,000.000	10,698,345.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	7,500,000.000	7,792,500.000	
	チェコ・コロナ 小計		チェコ・コロナ 262,233,203.000 (1,546,100,742)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	479,455,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	720,000,000.000	702,784,800.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	590,000,000.000	641,347,700.000	

	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	595,000,000.000	567,534,800.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	850,000,000.000	783,020,000.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	250,000,000.000	210,615,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	195,182,000.000	
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 3,579,939,300.000 (549,921,636)	
トルコ・リラ	10.4% Turkey Government Bond 20240320	トルコ・リラ 3,380,000.000	トルコ・リラ 3,382,602.600	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,596,927.300	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,660,625.200	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,684,956.100	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	3,121,915.500	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	2,500,000.000	2,575,350.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	2,247,840.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	2,800,000.000	2,887,276.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	6,100,000.000	6,896,721.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	8,400,000.000	9,509,472.000	
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 37,563,685.700 (279,838,189)	
ドミニカ・ペソ	9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 10,499,500.000	
ドミニカ・ペソ 小計			ドミニカ・ペソ 10,499,500.000 (26,697,078)	

ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	88,641,135.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	210,802,500.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	103,396,800.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	81,308,480.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	161,228,250.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	220,000,000.000	192,255,800.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	191,610,400.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	37,312,000.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	200,000,000.000	159,080,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	115,372,300.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	169,000,000.000	133,307,200.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	93,629,250.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	215,000,000.000	130,214,750.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	77,022,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	70,000,000.000	37,807,000.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	43,987,500.000	
	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	82,776,000.000	
	4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	100,000,000.000	77,583,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	124,663,030.000	

	5.5% Hungary Government Bond 20250624	282,500,000.000	256,001,500.000	
ハンガリー・フォリント 小計			ハンガリー・フォリント 2,397,998,895.000 (847,908,430)	
フィリピン・ペソ	6.25% Philippine Government International Bond 20360114	フィリピン・ペソ 10,000,000.000	フィリピン・ペソ 9,153,500.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 9,153,500.000 (22,457,197)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	ブラジル・リアル 10,890,000.000	ブラジル・リアル 10,291,812.300	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	12,350,000.000	11,267,152.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	8,100,000.000	7,143,147.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	4,600,000.000	3,956,046.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	1,800,000.000	1,517,472.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	18,000,000.000	16,678,800.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	28,500,000.000	24,746,550.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	10,200,000.000	8,340,846.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	11,200,000.000	8,154,272.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	5,300,000.000	3,624,193.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 95,720,290.300 (2,514,753,895)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 1,230,000.000	ペルー・ソル 1,217,773.800	

	6.35% Peru Government Bond 20280812	2,870,000.000	2,760,452.100	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	2,550,000.000	2,279,011.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,700,000.000	2,521,098.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,671,918.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,500,000.000	1,135,605.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	2,075,000.000	2,173,728.500	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,765,000.000	2,518,804.400	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	2,570,000.000	2,471,774.600	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 18,750,166.400 (675,922,874)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	8,190,000.000	7,003,678.500	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	5,240,000.000	4,338,196.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	5,600,000.000	5,291,832.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	8,250,000.000	6,496,875.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	5,600,000.000	5,143,544.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	5,400,000.000	4,704,210.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,600,000.000	3,769,696.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	5,700,000.000	4,414,878.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,150,000.000	3,410,845.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	5,500,000.000	4,805,460.000	



	4% Poland Government Bond 20231025	4,530,000.000	4,422,050.100	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	5,704,768.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	6,150,000.000	5,594,962.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 65,100,995.600 (1,999,375,266)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,819,620.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,016,280.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	3,500,000.000	3,555,825.000	
	4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,913,699.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	2,900,000.000	2,898,231.000	
	3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	2,700,000.000	2,697,732.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,173,918.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	4,860,504.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,500,000.000	3,407,285.000	
	3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,100,000.000	2,783,955.000	
	4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,279,276.000	
	3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	2,300,000.000	2,305,474.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,450,000.000	2,400,853.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,250,000.000	3,193,580.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,757,086.800	

3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	3,350,000.000	3,356,398.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	2,300,000.000	2,273,688.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,407,308.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,800,000.000	3,790,234.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,720,000.000	1,734,998.400	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,508,609.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,489,716.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	2,800,000.000	2,803,304.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	1,997,420.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	2,894,333.500	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	3,300,000.000	3,300,066.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	1,903,080.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	3,500,000.000	3,208,660.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	3,600,000.000	3,314,052.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	2,900,000.000	2,572,416.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,000,000.000	957,180.000	
4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	2,900,000.000	2,891,271.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,100,000.000	1,133,187.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 89,599,240.800 (2,758,733,745)	
メキシコ・ペソ 5.75% Mexican Bonos 20260305	メキシコ・ペソ 52,400,000.000	メキシコ・ペソ 46,864,464.000	

	8% Mexican Bonos 20471107	29,300,000.000	25,885,671.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	39,000,000.000	37,677,120.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	13,000,000.000	11,265,020.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	10,700,000.000	9,610,098.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	5,500,000.000	4,833,125.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	22,450,000.000	21,852,156.500	
	10% Mexican Bonos 20241205	30,550,000.000	30,440,936.500	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	40,030,000.000	37,400,029.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	9,390,000.000	9,960,536.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	35,230,000.000	34,000,825.300	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	29,100,000.000	27,261,171.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,350,000.000	40,604,642.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,120,000.000	25,111,049.600	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	9,328,070.500	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 372,094,915.300 (2,687,343,898)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	2,450,000.000	2,316,695.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	1,954,470.000	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,515,312.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,474,095.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,267,746.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,600,000.000	1,471,184.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,150,930.000	
	4.5% Romania Government Bond 20240617	2,500,000.000	2,399,575.000	
	4.4% Romania Government Bond 20230925	1,900,000.000	1,861,278.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,098,543.000	

	4% Romania Government Bond 20231025	1,600,000.000	1,559,616.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	1,600,000.000	1,370,336.000	
	3.7% Romania Government Bond 20241125	1,300,000.000	1,216,267.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,100,000.000	1,826,538.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	1,983,225.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	800,000.000	603,328.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	1,300,000.000	1,037,621.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	1,300,000.000	1,110,382.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	2,000,000.000	1,846,480.000	
	ルーマニア・レイ 小計		ルーマニア・レイ 32,063,621.500 (936,145,525)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	46,760,000.000	0.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	24,400,000.000	0.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	0.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	33,800,000.000	0.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	43,000,000.000	0.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	45,600,000.000	0.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	54,000,000.000	0.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	0.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	0.000	

	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	48,000,000.000	0.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	55,000,000.000	0.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	49,000,000.000	0.000	
	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	46,000,000.000	0.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	0.000	
	7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	0.000	
	7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	0.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	0.000	
	6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	68,000,000.000	0.000	
	4.5% Russian Federal Bond - OFZ 20250716	71,000,000.000	0.000	
	6.1% Russian Federal Bond - OFZ 20350718	63,000,000.000	0.000	
	5.7% Russian Federal Bond - OFZ 20280517	65,000,000.000	0.000	
	6.9% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20310723	74,000,000.000	0.000	
	6.7% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20290314	50,000,000.000	0.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 0.000 ( - )	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	58,950,000.000	62,478,157.500	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	11,748,360.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	13,280,000.000	8,416,864.000	

	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	25,540,000.000	20,567,362.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	58,020,000.000	45,914,127.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	41,400,000.000	33,163,470.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	53,500,000.000	47,521,375.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	35,900,000.000	28,438,185.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	42,900,000.000	36,666,630.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	38,800,000.000	32,956,720.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	29,100,000.000	23,813,985.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 351,685,235.500 (2,869,751,522)	
国債証券 合計			27,182,896,716 [27,182,896,716]	
合計			27,182,896,716 [27,182,896,716]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 31銘柄	100%	9.7%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.1%
エジプト・ポンド	国債証券 12銘柄	100%	1.1%
オフショア・人民元	国債証券 32銘柄	100%	9.5%
コロンビア・ペソ	国債証券 13銘柄	100%	3.8%
タイ・バーツ	国債証券 22銘柄	100%	10.6%
チェコ・コルナ	国債証券 20銘柄	100%	5.7%
チリ・ペソ	国債証券 7銘柄	100%	2.0%
トルコ・リラ	国債証券 10銘柄	100%	1.0%
ドミニカ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ハンガリー・フォリント	国債証券 20銘柄	100%	3.1%

フィリピン・ペソ	国債証券	1銘柄	100%	0.1%
ブラジル・レアル	国債証券	10銘柄	100%	9.3%
ペルー・ソル	国債証券	9銘柄	100%	2.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	100%	7.4%
マレーシア・リングgit	国債証券	33銘柄	100%	10.1%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	9.9%
ルーマニア・レイ	国債証券	19銘柄	100%	3.4%
ロシア・ルーブル	国債証券	23銘柄	-%	-%
南アフリカ・ランド	国債証券	11銘柄	100%	10.6%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップオンライン J - REITインデックス】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

## ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,401,115	4,700,261
親投資信託受益証券	1,678,496,673	1,672,821,341
未収入金	-	1,150,000
流動資産合計	1,681,897,788	1,678,671,602
資産合計	1,681,897,788	1,678,671,602
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	545,692	3,038,808
未払受託者報酬	186,684	183,583
未払委託者報酬	1,774,023	1,744,422
その他未払費用	46,584	45,815
流動負債合計	2,552,983	5,012,628
負債合計	2,552,983	5,012,628
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,291,974,799	1,264,409,915
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	387,370,006	409,249,059
（分配準備積立金）	250,151,187	215,722,930
元本等合計	1,679,344,805	1,673,658,974
純資産合計	1,679,344,805	1,673,658,974
負債純資産合計	1,681,897,788	1,678,671,602

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		270,479,669		35,454,668
営業収益合計		270,479,669		35,454,669
営業費用				
支払利息		747		752
受託者報酬		338,786		369,295
委託者報酬		3,219,399		3,509,091
その他費用		84,534		92,162
営業費用合計		3,643,466		3,971,300
営業利益		266,836,203		31,483,369
経常利益		266,836,203		31,483,369
当期純利益		266,836,203		31,483,369
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		48,522,453		3,608,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		66,249,412		387,370,006
剰余金増加額又は欠損金減少額		125,956,141		104,178,156
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		125,956,141		104,178,156
剰余金減少額又は欠損金増加額		23,149,297		110,173,725
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		23,149,297		110,173,725
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		387,370,006		409,249,059

## (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6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,110,904,033円	1,291,974,799円
期中追加設定元本額	469,805,021円	340,231,260円
期中一部解約元本額	288,734,255円	367,796,144円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,291,974,799口	1,264,409,915口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(82,237,949円)、投資信託約款に規定される収益調整金(274,612,886円)及び分配準備積立金(167,913,238円)より分配対象額は524,764,073円(1万口当たり4,061.72円)であり、分配を行っておりません。	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(27,874,779円)、投資信託約款に規定される収益調整金(325,720,069円)及び分配準備積立金(187,848,151円)より分配対象額は541,442,999円(1万口当たり4,282.18円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	243,096,765	32,348,737
合計	243,096,765	32,348,737

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.2998円	1.3237円
（1万口当たり純資産額）	（12,998円）	（13,237円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワJ-REITマザーファンド	494,464,054	1,672,821,341	
親投資信託受益証券 合計			1,672,821,341	
合計			1,672,821,341	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「ダイワJ-REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 「ダイワJ-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,111,247,907	9,055,372,204
投資証券	435,527,511,600	487,800,240,150
未収入金	530,183,103	-

未収配当金		2,669,289,420	2,956,270,650
前払金		574,899,100	192,080,000
流動資産合計		448,413,131,130	500,003,963,004
資産合計		448,413,131,130	500,003,963,004
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		681,915,100	234,696,000
未払金		-	904,805,446
未払解約金		996,864,000	29,504,000
流動負債合計		1,678,779,100	1,169,005,446
負債合計		1,678,779,100	1,169,005,446
純資産の部			
元本等			
元本	1	134,790,265,060	147,448,613,818
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		311,944,086,970	351,386,343,740
元本等合計		446,734,352,030	498,834,957,558
純資産合計		446,734,352,030	498,834,957,558
負債純資産合計		448,413,131,130	500,003,963,004

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	134,869,045,089円	134,790,265,060円
期中追加設定元本額	27,504,343,656円	36,009,575,147円
期中一部解約元本額	27,583,123,685円	23,351,226,389円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	4,900,112,506円	4,497,393,687円
ダイワJ - REITオープン (毎月分配型)	118,635,086,252円	130,545,826,153円
ダイワJ - REITオープン (年1回決算型)	335,161,418円	366,899,770円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	9,251,429円	13,968,525円
iFree J - REITイン デックス	565,753,538円	621,776,393円
iFree 8資産バランス	1,335,042,888円	1,746,605,518円
DC・ダイワJ - REIT オープン	5,312,636,720円	5,531,994,353円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,737,602円	6,597,914円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,869,632円	6,124,152円
ダイワ国内REITインデ ックス(投資一任専用)	- 円	913,341円
ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	98,265,717円	95,808,049円
ダイワファンドラップ J - REITインデックス	1,870,565,573円	2,225,386,851円



	ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	245,517,154円	366,075,847円
	ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス	506,440,779円	494,464,054円
	ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	965,823,852円	928,779,211円
計		134,790,265,060円	147,448,613,818円
2.	期末日における受益権の総数	134,790,265,060口	147,448,613,818口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,601,750,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,268,450,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	24,298,061,388	10,162,455,508
合計	24,298,061,388	10,162,455,508

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2021年9月16日から2021年11月30日まで、及び2022年9月16日から2022年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年 超				うち 1年 超		

市場取引								
不動産投信 指数先物取 引								
買 建	11,895,299,100	-	11,214,000,000	681,299,100	11,266,080,000	-	11,032,000,000	234,080,000
合計	11,895,299,100	-	11,214,000,000	681,299,100	11,266,080,000	-	11,032,000,000	234,080,000

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.3143円	3.3831円
(1万口当たり純資産額)	(33,143円)	(33,831円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	9,009	1,069,368,300	
	サンケイリアルエステート	14,197	1,321,740,700	
	SOSILA物流リート投	20,717	2,846,515,800	
	東海道リート投資法	5,374	655,090,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	15,303	9,594,981,000	
	森ヒルズリート	52,114	8,416,411,000	
	産業ファンド	66,228	10,536,874,800	
	アドバンス・レジデンス	44,312	15,243,328,000	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	31,785	6,639,886,500	
A P I 投資法人	23,397	9,990,519,000	
G L P 投資法人	143,041	22,028,314,000	
コンフォリア・レジデンシャル	20,616	6,504,348,000	
日本プロロジスリート	72,619	24,508,912,500	
星野リゾート・リート	7,751	5,340,439,000	
ONE リート投資法人	7,730	1,954,917,000	
イオンリート投資	49,058	7,829,656,800	
ヒューリックリート投資法	41,464	7,148,393,600	
日本リート投資法人	14,395	5,268,570,000	
積水ハウス・リート投資	134,416	10,820,488,000	
トーセイ・リート投資法人	9,831	1,315,387,800	
ケネディクス商業リート	19,266	5,117,049,600	
ヘルスケア&メディカル投資	10,926	2,066,106,600	
サムティ・レジデンシャル	11,520	1,381,248,000	
野村不動産マスターF	143,315	24,721,837,500	
いちごホテルリート投資	7,341	752,452,500	
ラサールロジポート投資	54,253	8,751,008,900	
スターアジア不動産投	55,334	3,093,170,600	
マリモ地方創生リート	5,535	754,974,000	
三井不動産ロジパーク	17,507	8,744,746,500	
大江戸温泉リート	7,154	457,856,000	
投資法人みらい	53,842	2,525,189,800	
森トラスト・ホテルリート投	10,398	1,405,809,600	
三菱地所物流REIT	15,226	6,707,053,000	
CREロジスティクスファンド	17,163	3,523,563,900	
ザイマックス・リート	7,189	871,306,800	
タカラレーベン不動産投	19,409	2,014,654,200	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	19,317	2,837,667,300	
日本ビルファンド	51,700	33,088,000,000	
ジャパンリアルエステイト	44,318	26,989,662,000	
日本都市ファンド投資法人	223,609	24,619,350,900	
オリックス不動産投資	88,303	17,086,630,500	
日本プライムリアルティ	30,309	11,911,437,000	
NTT都市開発リート投資法人	42,601	6,283,647,500	
東急リアル・エステート	29,714	6,406,338,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	30,362	3,254,806,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	99,572	15,354,002,400	
森トラスト総合リート	31,674	4,649,743,200	

インヴィンシブル投資法人	195,061	9,294,656,650	
フロンティア不動産投資	16,443	8,698,347,000	
平和不動産リート	30,288	4,879,396,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29,883	9,577,501,500	
福岡リート投資法人	22,920	3,994,956,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	25,787	8,703,112,500	
いちごオフィスリート投資法人	36,314	3,112,109,800	
大和証券オフィス投資法人	9,263	6,271,051,000	
阪急阪神リート投資法人	20,018	3,056,748,600	
スタートプロシード投資法人	7,682	1,799,124,400	
大和ハウスリート投資法人	66,803	20,541,922,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	142,917	10,675,899,900	
大和証券リビング投資法人	61,412	7,246,616,000	
ジャパンエクセレント投資法人	40,655	5,545,342,000	
投資証券 合計		487,800,240,150	
合計		487,800,240,150	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,908,735	1,979,502
親投資信託受益証券	1,052,306,701	855,348,711
派生商品評価勘定	10,138,600	-
未収入金	49,399	1,000,000
流動資産合計	1,064,403,435	858,328,213
資産合計	1,064,403,435	858,328,213
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	454	-
未払金	36,953	-
未払解約金	233,713	1,386,426
未払受託者報酬	110,607	92,511
未払委託者報酬	1,521,415	1,272,571
その他未払費用	27,569	23,052
流動負債合計	1,930,711	2,774,560
負債合計	1,930,711	2,774,560
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,788,413,204	1,796,904,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	274,059,520	58,648,768
（分配準備積立金）	241,597,576	171,939,411
元本等合計	1,062,472,724	855,553,653
純資産合計	1,062,472,724	855,553,653
負債純資産合計	1,064,403,435	858,328,213

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年12月1日 至 2021年11月30日	自	2021年12月1日 至 2022年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		328,899,730		165,834,929
為替差損益		80,165,331		13,716,717
営業収益合計		248,734,399		179,551,646
<b>営業費用</b>				
支払利息		293		245
受託者報酬		203,989		200,908
委託者報酬		2,806,029		2,763,562
その他費用		73,181		125,187
営業費用合計		3,083,492		3,089,902
営業利益又は営業損失（ ）		245,650,907		182,641,548
経常利益又は経常損失（ ）		245,650,907		182,641,548
当期純利益又は当期純損失（ ）		245,650,907		182,641,548
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		24,376,239		3,209,200
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,421,440		274,059,520
剰余金増加額又は欠損金減少額		36,952,702		48,980,697
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		36,952,702		48,980,697
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,589,290		84,959,101
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,589,290		84,959,101
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		274,059,520		58,648,768



## (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6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	797,988,165円	788,413,204円
期中追加設定元本額	216,237,612円	256,539,172円
期中一部解約元本額	225,812,573円	248,047,491円
2. 計算期間末日における受益権の総数	788,413,204口	796,904,885口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(186,626,873円)、投資信託約款に規定される収益調整金(72,637,864円)及び分配準備積立金(54,970,703円)より分配対象額は314,235,440円(1万口当たり3,985.67円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(145,679,432円)及び分配準備積立金(171,939,411円)より分配対象額は317,618,843円(1万口当たり3,985.66円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	289,455,736	145,419,297
合計	289,455,736	145,419,297

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	第5期				第6期			
	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	1,063,029,517	-	1,052,891,371	10,138,146	-	-	-	-

アメリカ・ドル	808,201,480	-	806,140,283	2,061,197	-	-	-	-
イギリス・ポンド	60,177,464	-	58,517,316	1,660,148	-	-	-	-
イスラエル・シケル	590,182	-	590,636	454	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	74,944,909	-	71,151,386	3,793,523	-	-	-	-
カナダ・ドル	20,811,723	-	20,180,781	630,942	-	-	-	-
シンガポール・ドル	34,044,123	-	33,505,847	538,276	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	4,362,726	-	4,139,728	222,998	-	-	-	-
ユーロ	44,810,535	-	43,648,937	1,161,598	-	-	-	-
香港・ドル	15,086,375	-	15,016,457	69,918	-	-	-	-
合計	1,063,029,517	-	1,052,891,371	10,138,146	-	-	-	-

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3476円 (13,476円)	1.0736円 (10,736円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	991,363,829	855,348,711	
親投資信託受益証券 合計			855,348,711	
合計			855,348,711	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年11月30日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		60,833,776
コール・ローン		116,470,295
投資信託受益証券		102,480,880
投資証券		19,017,277,787
派生商品評価勘定		1,133,434,291
未収入金		74,026,934
未収配当金		31,724,288
差入委託証拠金		187,384,471
流動資産合計		20,723,632,722
資産合計		20,723,632,722
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		26,944,946
未払金		17,662,528
未払解約金		1,000,000
流動負債合計		45,607,474
負債合計		45,607,474
純資産の部		
元本等		
元本	1	23,966,027,015
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	3,288,001,767
元本等合計		20,678,025,248
純資産合計		20,678,025,248
負債純資産合計		20,723,632,722

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
-----	-------------------------------

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2021年12月1日
期首元本額	1,492,500,000円
期中追加設定元本額	27,642,446,925円
期中一部解約元本額	5,168,919,910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	20,552,487,276円
REITインデックス(為替	
ヘッジあり)	
ダイワファンドラップオンラ	991,363,829円
イン 外国REITインデッ	
クス(為替ヘッジあり)	
ダイワ海外REITインデッ	958,821円
クス(為替ヘッジあり)(投	
資一任専用)	
ダイワ・マクロ・ナビゲー	469,852,089円
ター・ファンド2021-10(為	
替ヘッジあり/適格機関投資	
家専用)	
ダイワ外国REITインデッ	1,951,365,000円
クス(為替ヘッジあり)(ダ	
イワSMA専用)	
計	23,966,027,015円
2. 期末日における受益権の総数	23,966,027,015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3,288,001,767円であります。
------------	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2022年11月30 日現在
	当期間の損益 に 含まれた評価 差額（円）
投資信託受益証券	641,371
投資証券	2,917,948,907
合計	2,917,307,536

（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8月16日から2022年11月30日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2022年11月30日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	428,351,068	-	408,018,993	20,332,075
合計	428,351,068	-	408,018,993	20,332,075

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2022年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	19,904,527,917	-	18,777,706,497	1,126,821,420
アメリカ・ドル	15,608,081,589	-	14,614,118,039	993,963,550
イギリス・ポンド	957,966,273	-	934,520,202	23,446,071
イスラエル・シケル	36,062,888	-	34,583,917	1,478,971
オーストラリア・ドル	1,261,413,638	-	1,231,982,933	29,430,705
カナダ・ドル	388,729,493	-	364,552,232	24,177,261
シンガポール・ドル	670,040,810	-	645,680,120	24,360,690
ニュージーランド・ドル	81,269,838	-	80,926,404	343,434
ユーロ	644,282,492	-	629,971,912	14,310,580
香港・ドル	256,680,896	-	241,370,738	15,310,158
合計	19,904,527,917	-	18,777,706,497	1,126,821,420

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	0.8628円
(1万口当たり純資産額)	(8,628円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	8,570.000	737,962.700	
		アメリカ・ドル 小計		737,962.700	
投資信託受益証券 合計				102,480,880	
				[102,480,880]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	13,991	226,654.200	
		URBAN EDGE PROPERTIES	12,730	199,097.200	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	12,171	183,416.970	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,883	2,541,867.570	
SIMON PROPERTY GROUP INC	34,842	4,092,541.320	
BOSTON PROPERTIES INC	15,181	1,073,144.890	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	17,065	137,714.550	
VORNADO REALTY TRUST	17,146	433,965.260	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,666	154,945.980	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,083	349,967.990	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,430	113,553.900	
EQUITY RESIDENTIAL	36,029	2,290,723.820	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	22,656	381,073.920	
EPR PROPERTIES	7,984	325,507.680	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	45,017.340	
GLOBAL NET LEASE INC	11,036	145,675.200	
EQUINIX INC	9,694	6,504,286.240	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,670	231,315.600	
CHATHAM LODGING TRUST	5,195	68,054.500	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,870	526,949.900	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13,256	200,695.840	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,634	90,873.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	25,013.690	
HOST HOTELS & RESORTS INC	76,090	1,419,839.400	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	32,200	1,046,822.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,272	160,417.280	
RLJ LODGING TRUST	17,322	206,131.800	
FARMLAND PARTNERS INC	5,344	70,327.040	
PHYSICIANS REALTY TRUST	24,089	347,845.160	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,567	89,971.630	
KIMCO REALTY CORP	65,829	1,495,634.880	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,555	64,435.650	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	40,504	807,244.720	
WHITESTONE REIT	5,635	53,983.300	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27,192	1,402,291.440	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	13,784	141,699.520	
PARK HOTELS & RESORTS INC	23,931	296,026.470	
INVITATION HOMES INC	61,716	1,969,974.720	
JBG SMITH PROPERTIES	10,593	212,919.300	
ALEXANDER & BALDWIN INC	7,738	150,504.100	
CLIPPER REALTY INC	1,647	12,072.510	

GLADSTONE LAND CORP	3,386	68,329.480	
AMERICOLD REALTY TRUST	28,670	846,051.700	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	29,166.900	
VICI PROPERTIES INC	102,508	3,451,444.360	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	28,334.420	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,977	350,839.450	
SAFEHOLD INC	1,928	55,237.200	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15,076	99,350.840	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15,031	340,752.770	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,043	81,506.880	
STORE CAPITAL CORP	28,283	899,682.230	
BROADSTONE NET LEASE INC	18,426	305,687.340	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	11,966	101,232.360	
LIFE STORAGE INC	8,982	929,367.540	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,763	164,014.980	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	23,610	414,591.600	
PARAMOUNT GROUP INC	18,985	121,314.150	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	14,193	108,434.520	
NETSTREIT CORP	5,478	106,711.440	
APARTMENT INCOME REIT CO	16,411	609,668.650	
CTO REALTY GROWTH INC	1,785	37,752.750	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,208	984,688.640	
STAG INDUSTRIAL INC	19,075	608,683.250	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	25,144.980	
INDUS REALTY TRUST INC	564	36,005.760	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,085	31,921.350	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	12,421	396,478.320	
ORION OFFICE REIT INC	6,028	55,156.200	
DIGITAL CORE REIT UNITS	38,700	22,833.000	
VENTAS INC	42,544	1,931,497.600	
CARETRUST REIT INC	10,327	202,202.660	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7,177	178,133.140	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,896	735,202.800	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,412	82,533.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	24,583	317,120.700	

UMH PROPERTIES INC	5,632	98,785.280	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,712	79,054.800	
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	392	9,796.080	
IRON MOUNTAIN INC	30,939	1,666,374.540	
TERRENO REALTY CORP	7,076	406,870.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,512	590,638.400	
SUN COMMUNITIES INC	13,126	1,900,776.060	
ACADIA REALTY TRUST	10,104	153,580.800	
ALEXANDER'S INC	228	55,761.960	
PROLOGIS INC	98,267	11,183,767.270	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,804	2,410,426.080	
BRANDYWINE REALTY TRUST	18,261	123,809.580	
SAUL CENTERS INC	1,373	58,215.200	
VERIS RESIDENTIAL INC	8,434	133,341.540	
CAMDEN PROPERTY TRUST	11,338	1,335,049.500	
COUSINS PROPERTIES INC	16,118	418,745.640	
SITE CENTERS CORP	20,314	273,223.300	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,637	704,870.370	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,932	1,486,844.680	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14,057	693,431.810	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,750	852,965.000	
GETTY REALTY CORP	4,527	147,851.820	
WELLTOWER INC	49,319	3,412,874.800	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	57,431	1,472,530.840	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	11,195	327,901.550	
SERVICE PROPERTIES TRUST	17,577	134,112.510	
EQUITY COMMONWEALTH	11,840	316,246.400	
KILROY REALTY CORP	11,195	469,294.400	
LTC PROPERTIES INC	4,311	168,258.330	
LXP INDUSTRIAL TRUST	29,791	311,613.860	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,287	1,989,511.040	
MACERICH CO/THE	22,860	296,494.200	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,617	1,218,110.310	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,753	260,987.230	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	18,851	853,950.300	
REALTY INCOME CORP	65,732	4,095,103.600	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,966	327,509.420	
PUBLIC STORAGE	16,816	4,886,729.600	

	REGENCY CENTERS CORP	16,392	1,078,921.440	
	RPT REALTY	9,513	105,784.560	
	ISTAR INC	9,453	93,584.700	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	11,109	216,403.320	
	SL GREEN REALTY CORP	6,844	284,847.280	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29,173	29,464.730	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,210	60,123.300	
	UDR INC	32,508	1,324,701.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,406	72,830.800	
	WP CAREY INC	22,091	1,727,958.020	
	ELME	9,303	178,896.690	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,132	26,155.560	
	AGREE REALTY CORP	8,497	586,632.880	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,918	749,533.440	
	CUBESMART	23,890	945,566.200	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22,598	243,606.440	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	30,591	3,326,771.250	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,253	2,188,120.560	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,032	38,263.680	
	CENTERSPACE	1,717	109,201.200	
	KITE REALTY GROUP TRUST	23,322	524,511.780	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	46,590.150	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,549	84,429.440	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	22,450	205,866.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	63,755	827,539.900	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	34,234.750	
	DOUGLAS EMMETT INC	18,710	316,011.900	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	76,275.000	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	44,853.500	
	PRIME US REIT	68,400	32,148.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 105,952,506.510 (14,713,624,579)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	WAREHOUSE REIT PLC	49,358	56,070.680	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	24,551	16,105.450	
	ASSURA PLC	315,686	174,100.820	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	64,349	56,434.070	



STANDARD LIFE INV PROP INC	51,354	27,833.860	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	100,969	60,177.520	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	64,471	55,509.530	
REGIONAL REIT LTD	54,681	32,808.600	
NEWRIVER REIT PLC	39,166	30,040.320	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	90,813	94,173.080	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73,284	44,629.950	
CUSTODIAN REIT PLC	51,902	47,697.930	
PRS REIT PLC/THE	64,664	54,964.400	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	45,413	46,866.210	
LXI REIT PLC	182,899	212,894.430	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46,825	32,028.300	
AEW UK REIT PLC	20,041	19,339.560	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	85,276	77,601.160	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	132,180	142,093.500	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	50,350	70,238.250	
HOME REIT PLC	84,338	47,060.600	
LAND SECURITIES GROUP PLC	80,150	497,410.900	
SEGREO PLC	128,986	1,042,722.820	
HAMMERSON PLC	390,041	96,730.160	
UNITE GROUP PLC/THE	42,683	403,994.590	
BRITISH LAND CO PLC	100,062	404,950.910	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	27,083	137,175.390	
DERWENT LONDON PLC	11,979	286,777.260	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	142,192	161,387.920	
WORKSPACE GROUP PLC	14,720	62,383.360	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	22,491	204,555.640	
SHAFTESBURY PLC	30,753	112,002.420	
BIG YELLOW GROUP PLC	18,654	204,820.920	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	104,620	189,676.060	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71,398	32,022.000	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	199,366	291,672.450	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 5,526,951.020 (918,745,068)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	82,303	145,594.000	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	233,544.900	

	REIT 1 LTD	22,083	413,614.590	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 792,753.490 (31,974,919)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	116,973	919,407.780	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33,012	52,489.080	
	HMC CAPITAL LTD	21,693	112,369.740	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46,291	34,255.340	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	36,250	121,437.500	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	167,757	118,268.680	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	60,847	194,101.930	
	RURAL FUNDS GROUP	45,313	116,001.280	
	WAYPOINT REIT	77,414	212,888.500	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	70,763	311,357.200	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	83,250.810	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	75,353	141,663.640	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	174,841	228,167.500	
	REGION GROUP	121,402	332,641.480	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34,802	112,062.440	
	NATIONAL STORAGE REIT	121,306	291,134.400	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	22,773	65,813.970	
	GDI PROPERTY GROUP	64,299	48,867.240	
	SCENTRE GROUP	564,480	1,659,571.200	
	ARENA REIT	37,770	146,169.900	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22,847	75,852.040	
	BWP TRUST	54,318	222,703.800	
	GPT GROUP	208,329	910,397.730	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	56,258	228,407.480	
	MIRVAC GROUP	429,132	952,673.040	
	STOCKLAND	259,617	986,544.600	
ABACUS PROPERTY GROUP	46,283	124,964.100		
GOODMAN GROUP	184,893	3,455,650.170		
VICINITY CENTRES	420,821	854,266.630		
CHARTER HALL GROUP	51,441	699,083.190		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,894	170,347.380		

オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 13,982,809.770 (1,297,464,919)
カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,000	カナダ・ドル 8,940.000
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,600	17,480.000
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5,600	18,200.000
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3,600	37,728.000
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5,725	87,306.250
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	3,500	22,225.000
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,026	38,635.820
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	66,172.000
	SLATE GROCERY REIT	3,600	56,412.000
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,700	112,091.000
	SLATE OFFICE REIT	4,900	22,197.000
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	36,350.000
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,200	133,716.000
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10,500	236,250.000
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,500	33,110.000
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,400	27,312.000
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,600	288,576.000
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,600	164,424.000
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,100	100,278.000
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	11,400	195,738.000
	CHOICE PROPERTIES REIT	17,500	255,325.000
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	39,480.000
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6,200	97,216.000
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,700	212,597.000
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,200	398,360.000
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	14,700	183,456.000
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,200	344,574.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,000	46,350.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,500	125,175.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,100	99,552.000	

	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,100	188,292.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 3,693,518.070 (377,329,806)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	66,100	42,304.000	
	KEPPEL DC REIT	149,200	277,512.000	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153,800	37,681.000	
	AIMS APAC REIT	57,800	71,094.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	313,500	351,120.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,400	50,464.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	210,500	152,612.500	
	EC WORLD REIT	32,900	14,640.500	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	365,500	1,008,780.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	547,600	1,139,008.000	
	SUNTEC REIT	243,700	336,306.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	350,000	563,500.000	
	KEPPEL REIT	215,100	193,590.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	222,600	210,357.000	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	631,900	221,165.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,700	113,640.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	120,900	246,636.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	166,800	92,574.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	133,900	140,595.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	42,100	162,506.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	216,400	489,064.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	250,400	433,192.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	124,300	76,444.500	
	SPH REIT	115,900	104,310.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	284,100	99,435.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,628,530.500 (669,746,722)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	64,452	95,388.960	

	ARGOSY PROPERTY LTD	95,463	110,737.080	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	177,139	161,196.490	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	54,226	125,262.060	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	118,656	238,498.560	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	151,969	183,882.490	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 914,965.640 (78,805,991)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,505	105,507.100	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	914	6,672.200	
	HAMBORNER REIT AG	7,351	54,764.950	
	WERELDHAVE NV	4,183	56,763.310	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,704	556,393.920	
	NSI NV	1,842	44,852.700	
	VASTNED RETAIL NV	1,879	40,680.350	
	ICADE	3,326	134,636.480	
	CARMILA	6,067	84,452.640	
	ALTAREA	443	61,754.200	
	GECINA SA	5,446	516,008.500	
	KLEPIERRE	19,541	435,373.480	
	COVIVIO	4,764	268,451.400	
	MERCIALYS	8,126	77,237.630	
	AEDIFICA	3,993	302,869.050	
	COFINIMMO	3,079	259,097.850	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,459	51,393.100	
	RETAIL ESTATES	1,182	73,165.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,204	365,326.880	
	CARE PROPERTY INVEST	2,797	42,514.400	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,164	61,674.000	
	MONTEA NV	1,300	84,370.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	21,818.260	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,263	32,247.720	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	29,732	177,648.700	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	33,413	302,721.780	
	CROMWELL REIT EUR	38,000	59,280.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	44,558	51,330.810	
ユーロ 小計			ユーロ 4,329,007.210 (621,558,856)	

韓国・ウォン	SK REITS LTD	7,476	韓国・ウォン	34,352,220.000
	D&D PLATFORM REIT LTD	6,865		23,478,300.000
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,286		12,404,650.000
	NH ALL ONE REIT LTD	3,459		10,861,260.000
	E KOCREF CR	2,796		15,126,360.000
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7,432		50,983,520.000
	LOTTE REIT CO LTD	15,417		60,588,810.000
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11,781		48,655,530.000
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3,918		17,807,310.000
	JR REIT XXVII	16,902		72,678,600.000
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,393		26,695,350.000
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18,659		74,636,000.000
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン	448,267,910.000 (46,978,478)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	267,000	香港・ドル	493,950.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	108,000		322,920.000
	FORTUNE REIT	163,000		904,650.000
	PROSPERITY REIT	156,000		274,560.000
	LINK REIT	229,700		12,082,220.000
	CHAMPION REIT	222,000		603,840.000
香港・ドル 小計			香港・ドル	14,682,140.000 (261,048,449)
投資証券 合計				19,017,277,787 [19,017,277,787]
合計				19,119,758,667 [19,119,758,667]

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	----------------------------	--------------------	----------------

アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券	1銘柄  144銘柄	0.7%	99.3%	77.4%
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	-%	100%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	-%	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	-%	100%	6.8%
カナダ・ドル	投資証券	31銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券	28銘柄	-%	100%	3.3%
韓国・ウォン	投資証券	12銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	-%	100%	1.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年11月30日現在	第6期 2022年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,680,433	1,769,994
親投資信託受益証券	912,545,370	792,157,613
未収入金	-	868,000
流動資産合計	914,225,803	794,795,607
資産合計	914,225,803	794,795,607
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	186,371	1,209,148
未払受託者報酬	93,995	87,912
未払委託者報酬	1,293,242	1,209,395
その他未払費用	23,425	21,903
流動負債合計	1,597,033	2,528,358
負債合計	1,597,033	2,528,358
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,642,622,346	1,563,974,089
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	270,006,424	228,293,160
（分配準備積立金）	244,719,821	172,152,878
元本等合計	912,628,770	792,267,249
純資産合計	912,628,770	792,267,249
負債純資産合計	914,225,803	794,795,607

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	264,037,562	12,007,243
<b>営業収益合計</b>	<b>264,037,562</b>	<b>12,007,243</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	146	184
受託者報酬	166,518	184,181
委託者報酬	2,291,056	2,533,807
その他費用	41,472	45,886
<b>営業費用合計</b>	<b>2,499,192</b>	<b>2,764,058</b>
<b>営業利益</b>	<b>261,538,370</b>	<b>9,243,185</b>
<b>経常利益</b>	<b>261,538,370</b>	<b>9,243,185</b>
<b>当期純利益</b>	<b>261,538,370</b>	<b>9,243,185</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	25,013,507	20,932,738
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,871,190	270,006,424
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>37,091,730</b>	<b>55,945,479</b>
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,091,730	55,945,479
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>1,738,979</b>	<b>85,969,190</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,738,979	85,969,190
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>270,006,424</b>	<b>228,293,160</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第6期	
	自 2021年12月1日	至 2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首元本額	604,694,831円	642,622,346円
期中追加設定元本額	194,621,133円	125,371,635円
期中一部解約元本額	156,693,618円	204,019,892円
2. 計算期間末日における受益権の総数	642,622,346口	563,974,089口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(198,866,305円)、投資信託約款に規定される収益調整金(75,898,156円)及び分配準備積立金(45,853,516円)より分配対象額は320,617,977円(1万口当たり4,989.21円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(109,226,807円)及び分配準備積立金(172,152,878円)より分配対象額は281,379,685円(1万口当たり4,989.23円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	249,248,237	7,959,763
合計	249,248,237	7,959,763

## （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5期	第6期
2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4202円	1.4048円
（1万口当たり純資産額）	（14,202円）	（14,048円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	253,344,510	792,157,613	
親投資信託受益証券 合計			792,157,613	
合計			792,157,613	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	140,807,004	187,139,978
コール・ローン	610,755,443	387,557,310
投資信託受益証券	420,239,075	1,305,824,050

投資証券		47,151,826,564	26,349,822,166
派生商品評価勘定		11,879,108	3,646,932
未収入金		2,778,989	1,343,078
未収配当金		56,716,807	43,173,851
差入委託証拠金		385,353,829	262,269,683
流動資産合計		48,780,356,819	28,540,777,048
資産合計		48,780,356,819	28,540,777,048
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,711,901	90,559,147
未払金		145,487,910	85,790,342
未払株式払込金		2,215,073	-
未払解約金		1,000	16,076,000
流動負債合計		151,415,884	192,425,489
負債合計		151,415,884	192,425,489
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,433,680,362	9,066,118,780
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		33,195,260,573	19,282,232,779
元本等合計		48,628,940,935	28,348,351,559
純資産合計		48,628,940,935	28,348,351,559
負債純資産合計		48,780,356,819	28,540,777,048

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

### 受取配当金

原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。



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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1. 1 期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	13,110,290,968円	15,433,680,362円
期中追加設定元本額	5,480,584,788円	3,053,614,153円
期中一部解約元本額	3,157,195,394円	9,421,175,735円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	6,291,808,323円	- 円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	1,162,934,430円	1,224,238,742円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	333,980,799円	- 円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	289,623,388円	253,344,510円
D-I's グローバルREI Tインデックス	2,223,608円	1,829,770円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,326,903円	12,799,703円
iFree 外国REITイ ンデックス	632,249,938円	751,541,670円
iFree 8資産バランス	1,462,352,614円	1,876,522,826円

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	236,948,723円	328,188,529円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	113,742,003円	179,838,342円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	3,300,676,766円	3,948,646,182円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,106,352円	7,043,305円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,186,807円	6,531,985円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	- 円	820,015円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	183,749,014円	- 円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	184,925,099円	149,216,410円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	243,151,995円	250,077,120円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	59,517,654円	71,541,533円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	912,182,345円	- 円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,993,601円	3,938,138円
計	15,433,680,362円	9,066,118,780円
2. 期末日における受益権の総数	15,433,680,362口	9,066,118,780口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
種 類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

投資信託受益証券	885,131	31,225,322
投資証券	9,295,917,870	6,117,792,031
合計	9,295,032,739	6,086,566,709

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	1,092,285,247	-	1,103,599,867	11,314,620	770,558,679	-	702,427,931	68,130,748
合計	1,092,285,247	-	1,103,599,867	11,314,620	770,558,679	-	702,427,931	68,130,748

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								

為替予約取引								
買 建	657,817,200	-	654,669,787	3,147,413	374,096,313	-	355,314,846	18,781,467
アメリカ・ドル	593,203,105	-	591,740,900	1,462,205	264,153,329	-	247,372,171	16,781,158
カナダ・ドル	-	-	-	-	9,193,563	-	9,193,347	216
ユーロ	64,614,095	-	62,928,887	1,685,208	100,749,421	-	98,749,328	2,000,093
合計	657,817,200	-	654,669,787	3,147,413	374,096,313	-	355,314,846	18,781,467

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.1508円	3.1268円
(1万口当たり純資産額)	(31,508円)	(31,268円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	109,200.000	9,403,212.000	
		アメリカ・ドル 小計		9,403,212.000 (1,305,824,050)	
投資信託受益証券 合計				1,305,824,050 [1,305,824,050]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,596	317,455.200	
		URBAN EDGE PROPERTIES	17,277	270,212.280	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,400	247,148.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,571	3,513,321.090	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,158	5,656,638.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	20,983	1,483,288.270	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	22,688	183,092.160	
		VORNADO REALTY TRUST	23,721	600,378.510	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	13,078	209,640.340	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,500	481,625.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,326	155,423.980	
		EQUITY RESIDENTIAL	49,799	3,166,220.420	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,700	533,194.000	
		EPR PROPERTIES	11,184	455,971.680	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	58,680.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	14,833	195,795.600	
		EQUINIX INC	13,398	8,989,522.080	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,929	318,265.720	
		CHATHAM LODGING TRUST	6,665	87,311.500	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,114	728,393.780	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,500	280,090.000	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	120,750.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	28,158.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	105,170	1,962,472.200	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44,506	1,446,890.060			
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	18,964	213,155.360			
RLJ LODGING TRUST	23,943	284,921.700			
FARMLAND PARTNERS INC	7,101	93,449.160			
PHYSICIANS REALTY TRUST	33,500	483,740.000			
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,961	118,436.290			

KIMCO REALTY CORP	90,987	2,067,224.640	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,060	89,059.800	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56,003	1,116,139.790	
WHITESTONE REIT	6,400	61,312.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	37,584	1,938,206.880	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,700	181,956.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	33,077	409,162.490	
INVITATION HOMES INC	85,302	2,722,839.840	
JBG SMITH PROPERTIES	14,641	294,284.100	
ALEXANDER & BALDWIN INC	10,400	202,280.000	
CLIPPER REALTY INC	1,890	13,853.700	
GLADSTONE LAND CORP	4,680	94,442.400	
AMERICOLD REALTY TRUST	39,627	1,169,392.770	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,000	35,910.000	
VICI PROPERTIES INC	141,684	4,770,500.280	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	32,336.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,189	493,673.650	
SAFEHOLD INC	2,562	73,401.300	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	19,143	126,152.370	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,776	470,991.920	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,372	108,299.520	
STORE CAPITAL CORP	39,092	1,243,516.520	
BROADSTONE NET LEASE INC	25,200	418,068.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,726	133,041.960	
LIFE STORAGE INC	12,414	1,284,476.580	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,574	215,556.040	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,919	578,057.640	
PARAMOUNT GROUP INC	24,493	156,510.270	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,500	148,980.000	
NETSTREIT CORP	7,406	144,268.880	
APARTMENT INCOME REIT CO	22,683	842,673.450	
CTO REALTY GROWTH INC	2,580	54,567.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	25,166	1,360,977.280	
STAG INDUSTRIAL INC	26,365	841,307.150	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,500	28,770.000	
INDUS REALTY TRUST INC	861	54,966.240	

POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,300	35,213.000	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	16,969	541,650.480	
ORION OFFICE REIT INC	7,823	71,580.450	
DIGITAL CORE REIT UNITS	49,400	29,146.000	
VENTAS INC	58,803	2,669,656.200	
CARETRUST REIT INC	14,404	282,030.320	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,920	246,214.400	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,085	1,016,159.250	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,128	108,702.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,343	443,024.700	
UMH PROPERTIES INC	7,244	127,059.760	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,600	104,940.000	
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	487	12,170.130	
IRON MOUNTAIN INC	42,755	2,302,784.300	
TERRENO REALTY CORP	9,780	562,350.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,993	813,715.100	
SUN COMMUNITIES INC	18,143	2,627,287.830	
ACADIA REALTY TRUST	13,611	206,887.200	
ALEXANDER'S INC	300	73,371.000	
PROLOGIS INC	135,822	15,457,901.820	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,844	3,331,646.880	
BRANDYWINE REALTY TRUST	24,642	167,072.760	
SAUL CENTERS INC	1,800	76,320.000	
VERIS RESIDENTIAL INC	11,900	188,139.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,672	1,845,378.000	
COUSINS PROPERTIES INC	22,155	575,586.900	
SITE CENTERS CORP	27,078	364,199.100	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,409	974,232.090	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,581	2,055,028.690	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,429	958,432.570	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,710	1,178,742.600	
GETTY REALTY CORP	6,256	204,320.960	
WELLTOWER INC	68,168	4,717,225.600	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79,379	2,035,277.560	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,700	459,853.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	24,600	187,698.000	



EQUITY COMMONWEALTH	16,365	437,109.150	
KILROY REALTY CORP	15,609	654,329.280	
LTC PROPERTIES INC	5,959	232,579.770	
LXP INDUSTRIAL TRUST	41,176	430,700.960	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,983	2,749,887.360	
MACERICH CO/THE	31,979	414,767.630	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,715	1,682,532.450	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,569	360,703.790	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,056	1,180,336.800	
REALTY INCOME CORP	90,854	5,660,204.200	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,710	457,352.700	
PUBLIC STORAGE	23,242	6,754,125.200	
REGENCY CENTERS CORP	22,656	1,491,217.920	
RPT REALTY	12,530	139,333.600	
ISTAR INC	12,560	124,344.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,016	292,511.680	
SL GREEN REALTY CORP	9,538	396,971.560	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32,900	33,229.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,100	76,793.000	
UDR INC	44,932	1,830,979.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,800	93,240.000	
WP CAREY INC	30,533	2,388,291.260	
ELME	12,600	242,298.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	29,751.000	
AGREE REALTY CORP	11,744	810,805.760	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,441	1,035,985.280	
CUBESMART	33,020	1,306,931.600	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31,234	336,702.520	
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,282	4,598,167.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,700	3,024,344.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	43,416.750	
CENTERSPACE	2,261	143,799.600	
KITE REALTY GROUP TRUST	32,569	732,476.810	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	52,162.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,521	102,469.760	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,030	284,545.100	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88,121	1,143,810.580	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	38,659.750	
DOUGLAS EMMETT INC	26,186	442,281.540	

	MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	99,735.750	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110,200	60,059.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	92,200	43,334.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 146,165,071.780 (20,297,943,518)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	WAREHOUSE REIT PLC	63,302	71,911.070	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31,488	20,656.120	
	ASSURA PLC	456,627	251,829.790	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83,320	73,071.640	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,200	30,460.400	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118,460	70,602.160	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	75,640	65,126.040	
	REGIONAL REIT LTD	59,840	35,904.000	
	NEWRIVER REIT PLC	42,860	32,873.620	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	132,590	137,495.830	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85,980	52,361.820	
	CUSTODIAN REIT PLC	60,900	55,967.100	
	PRS REIT PLC/THE	75,872	64,491.200	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,280	54,984.960	
	LXI REIT PLC	255,448	297,341.470	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,240	35,048.160	
	AEW UK REIT PLC	21,930	21,162.450	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	128,420	116,862.200	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	194,253	208,821.970	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	70,322	98,099.190	
	HOME REIT PLC	117,587	65,613.540	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	115,934	719,486.400	
	SEGRE PLC	186,572	1,508,248.040	
	HAMMERSON PLC	545,564	135,299.870	
	UNITE GROUP PLC/THE	61,739	584,359.630	
	BRITISH LAND CO PLC	144,736	585,746.590	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,781	186,295.760	
	DERWENT LONDON PLC	17,327	414,808.380	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205,675	233,441.120	

	WORKSPACE GROUP PLC	20,759	87,976.640	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,544	295,987.680	
	SHAFTESBURY PLC	41,750	152,053.500	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,760	293,824.800	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	149,787	271,563.830	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78,138	35,044.890	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	280,618	410,544.130	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 7,775,365.990 (1,292,499,089)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105,526	186,675.490	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31,070	271,769.290	
	REIT 1 LTD	26,100	488,853.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 947,297.780 (38,208,309)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	171,638	1,349,074.680	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38,400	61,056.000	
	HMC CAPITAL LTD	31,078	160,984.040	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	39,886.000	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46,820	156,847.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	199,444	140,608.020	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	88,000	280,720.000	
	RURAL FUNDS GROUP	53,875	137,920.000	
	WAYPOINT REIT	113,781	312,897.750	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	99,512	437,852.800	
	CENTURIA OFFICE REIT	62,250	98,977.500	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	105,967	199,217.960	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	234,898	306,541.890	
	REGION GROUP	178,136	488,092.640	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41,377	133,233.940	
	NATIONAL STORAGE REIT	167,575	402,180.000	
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31,510	91,063.900		

	GDI PROPERTY GROUP	71,460	54,309.600	
	SCENTRE GROUP	828,278	2,435,137.320	
	ARENA REIT	56,810	219,854.700	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27,160	90,171.200	
	BWP TRUST	77,951	319,599.100	
	GPT GROUP	305,687	1,335,852.190	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	83,410	338,644.600	
	MIRVAC GROUP	629,679	1,397,887.380	
	STOCKLAND	380,944	1,447,587.200	
	ABACUS PROPERTY GROUP	65,960	178,092.000	
	GOODMAN GROUP	271,299	5,070,578.310	
	VICINITY CENTRES	617,483	1,253,490.490	
	CHARTER HALL GROUP	73,759	1,002,384.810	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,590	254,449.300	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 20,195,192.320 (1,873,911,895)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	10,281.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	19,380.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	20,150.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,300	45,064.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7,841	119,575.250	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	27,940.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	52,595.060	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,400	78,288.000	
	SLATE GROCERY REIT	4,000	62,680.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9,100	152,243.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	23,103.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,800	40,712.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18,700	189,431.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15,000	337,500.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	36,722.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,700	30,726.000	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,100	408,816.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,900	240,591.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	136,180.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,700	286,739.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,300	369,127.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,700	44,415.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,400	131,712.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,300	311,993.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,500	584,550.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,866	260,407.680	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,700	504,099.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	50,985.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,600	180,252.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,200	133,824.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,100	267,852.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 5,157,932.990 (526,934,434)	
シンガポール・ ドル			シンガポール・ドル	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84,700	54,208.000	
	KEPPEL DC REIT	204,483	380,338.380	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170,976	41,889.120	
	AIMS APAC REIT	81,100	99,753.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	460,090	515,300.800	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73,800	56,088.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	291,140	211,076.500	
	EC WORLD REIT	36,500	16,242.500	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	536,277	1,480,124.520	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	803,522	1,671,325.760	
	SUNTEC REIT	357,600	493,488.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	501,800	807,898.000	
	KEPPEL REIT	317,600	285,840.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	312,656	295,459.920	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	894,402	313,040.700	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	127,700	153,240.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,176	338,999.040	
	STARHILL GLOBAL REIT	198,400	110,112.000	

	CAPITALAND CHINA TRUST	178,942	187,889.100	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62,600	241,636.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	310,269	701,207.940	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	367,484	635,747.320	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147,800	90,897.000	
	SPH REIT	163,000	146,700.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337,763	118,217.050	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 9,446,718.650 (954,496,452)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	82,638	122,304.240	
	ARGOSY PROPERTY LTD	119,250	138,330.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	261,440	237,910.400	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	71,483	165,125.730	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	172,800	347,328.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	213,350	258,153.500	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,269,151.870 (109,312,051)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,854	137,100.680	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	13,286.000	
	HAMBORNER REIT AG	9,070	67,571.500	
	WERELDHAVE NV	5,160	70,021.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,478	752,566.440	
	NSI NV	2,271	55,298.850	
	VASTNED RETAIL NV	2,320	50,228.000	
	ICADE	4,098	165,887.040	
	CARMILA	7,789	108,422.880	
	ALTAREA	550	76,670.000	
	GECINA SA	7,453	706,171.750	
	KLEPIERRE	26,957	600,601.960	
	COVIVIO	6,222	350,609.700	
	MERCIALYS	10,432	99,156.160	
	AEDIFICA	5,376	407,769.600	
COFINIMMO	4,064	341,985.600		
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,030	63,327.000		

	RETAIL ESTATES	1,457	90,188.300	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,268	495,572.960	
	CARE PROPERTY INVEST	3,450	52,440.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,670	76,095.000	
	MONTEA NV	1,669	108,318.100	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	22,557.150	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,500	33,300.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,217	240,296.570	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	45,751	414,504.060	
	CROMWELL REIT EUR	43,520	67,891.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54,940	63,290.880	
ユーロ 小計			ユーロ 5,731,128.580 (822,875,442)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	11,423	52,488,685.000	韓国・ウォン
	D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	27,360,000.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,930	14,835,750.000	
	NH ALL ONE REIT LTD	6,454	20,265,560.000	
	E KOCREF CR	3,584	19,389,440.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,260	56,663,600.000	
	LOTTE REIT CO LTD	17,135	67,340,550.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13,090	54,061,700.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	25,452,000.000	
	JR REIT XXVII	22,640	97,352,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	29,650,500.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,442	97,768,000.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 562,627,785.000 (58,963,392)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321,000	593,850.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142,000	424,580.000	
	FORTUNE REIT	233,000	1,293,150.000	
	PROSPERITY REIT	174,000	306,240.000	
	LINK REIT	337,000	17,726,200.000	
	CHAMPION REIT	268,000	728,960.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 21,072,980.000 (374,677,584)	

投資証券 合計		26,349,822,166	
		[26,349,822,166]	
合計		27,655,646,216	
		[27,655,646,216]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 145銘柄	6.0%	94.0%	78.0%
イギリス・ポンド	投資証券 36銘柄	-%	100%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	6.8%
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	100%	3.0%
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



## 2【ファンドの現況】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## 【純資産額計算書】

2022年11月30日

資産総額	4,463,286,595円
負債総額	7,528,789円
純資産総額（ - ）	4,455,757,806円
発行済数量	3,053,556,404口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4592円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	213,840,797,534円
負債総額	8,550,063,296円
純資産総額（ - ）	205,290,734,238円
発行済数量	147,745,976,638口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3895円

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	4,534,037,065円
負債総額	15,328,460円
純資産総額（ - ）	4,518,708,605円
発行済数量	2,885,499,363口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5660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

資産総額	79,724,988,849円
------	-----------------

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

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

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	3,481,374,291円
負債総額	10,152,429円
純資産総額( - )	3,471,221,862円
発行済数量	1,850,387,371口
1単位当たり純資産額( / )	1.8759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

資産総額	299,342,893,917円
負債総額	969,629,529円
純資産総額( - )	298,373,264,388円
発行済数量	69,133,888,947口
1単位当たり純資産額( / )	4.3159円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	24,102,773,981円
負債総額	542,162,723円
純資産総額( - )	23,560,611,258円
発行済数量	11,961,794,690口
1単位当たり純資産額( / )	1.9697円

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	2,876,667,467円
負債総額	2,506,778円
純資産総額( - )	2,874,160,689円
発行済数量	2,959,305,050口
1単位当たり純資産額( / )	0.9712円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	113,175,837,692円
負債総額	99,099,215円
純資産総額( - )	113,076,738,477円
発行済数量	83,142,525,531口
1単位当たり純資産額( / )	1.3600円

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	3,804,440,745円
負債総額	15,098,804円
純資産総額( - )	3,789,341,941円
発行済数量	4,165,956,248口
1単位当たり純資産額( / )	0.9096円

(参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	121,353,693,837円
負債総額	13,207,904円
純資産総額( - )	121,340,485,933円
発行済数量	136,999,425,944口
1単位当たり純資産額( / )	0.8857円

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

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	2,440,882,512円
負債総額	7,901,195円
純資産総額( - )	2,432,981,317円
発行済数量	2,102,708,293口
1単位当たり純資産額( / )	1.1571円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	241,503,298,361円
負債総額	150,979,777円
純資産総額( - )	241,352,318,584円
発行済数量	76,340,507,617口
1単位当たり純資産額( / )	3.1615円

## (参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	28,259,106,689円
負債総額	8,701,072円
純資産総額( - )	28,250,405,617円
発行済数量	18,960,433,420口
1単位当たり純資産額( / )	1.4900円

ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	1,678,671,602円
負債総額	5,012,628円

純資産総額( - )	1,673,658,974円
発行済数量	1,264,409,915口
1単位当たり純資産額( / )	1.3237円

## (参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	500,003,963,004円
負債総額	1,169,005,446円
純資産総額( - )	498,834,957,558円
発行済数量	147,448,613,818口
1単位当たり純資産額( / )	3.3831円

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	858,328,213円
負債総額	2,774,560円
純資産総額( - )	855,553,653円
発行済数量	796,904,885口
1単位当たり純資産額( / )	1.0736円

## (参考) 先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	20,723,632,722円
負債総額	45,607,474円
純資産総額( - )	20,678,025,248円
発行済数量	23,966,027,015口
1単位当たり純資産額( / )	0.8628円

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	794,795,607円
負債総額	2,528,358円
純資産総額( - )	792,267,249円
発行済数量	563,974,089口
1単位当たり純資産額( / )	1.4048円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年11月30日

資産総額	28,540,777,048円
負債総額	192,425,489円
純資産総額( - )	28,348,351,559円
発行済数量	9,066,118,780口
1単位当たり純資産額( / )	3.1268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

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

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年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

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	1
建物	224	203
	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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	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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		

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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 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)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	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。

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

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。

剰余金の配当の総額	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日
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係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(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 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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付  利息の受取(注)	19,000  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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売  本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	株大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	527	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注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	(株)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いません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 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		
ソフトウェア		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 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	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ェアについては、社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

#### 3．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

#### (3) 役員退職慰労引当金

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

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

当社は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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 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。

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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】

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

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2022年2月21日	有価証券報告書、有価証券届出書
2022年8月24日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

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27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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



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27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックスの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックスの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン J-REITインデックスの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックスの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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

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

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



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記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。