

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2023年3月8日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス ダイワファンドラップ 日経225インデックス 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） 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） 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） ダイワファンドラップ 日本債券インデックス 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） 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） 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） ダイワファンドラップ J-REITインデックス 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） 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）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

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）

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）

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）

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

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）

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）

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）

ダイワファンドラップ J-REITインデックス

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）

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）

（注1）上記の総称を「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」とします。

（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとします。

（注3）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワファンドラップ TOPIXインデック：FW TOPIXインデックス  
ス

ダイワファンドラップ 日経225インデック：FW 日経225インデックス  
ス

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス：FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）  
（為替ヘッジなし）

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

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス：FW 日本債券インデックス

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス：FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）  
（為替ヘッジなし）

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

ダイワファンドラップ J-REITインデッ：FW J-REITインデックス  
クス

ダイワファンドラップ 外国REITインデッ：FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあ  
クス（為替ヘッジあり） り）

ダイワファンドラップ 外国REITインデッ：FW 外国REITインデックス（為替ヘッジな  
クス（為替ヘッジなし） し）

## (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

## (3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。

## (4) 【発行（売出）価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

**(5)【申込手数料】**

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

**(6)【申込単位】**

販売会社にお問合わせ下さい。

**(7)【申込期間】**

2023年3月9日から2023年9月8日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

**(8)【申込取扱場所】**

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

**(9)【払込期日】**

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

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

**(10)【払込取扱場所】**

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

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

**(12)【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日経225インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 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	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
債券	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
一般	年12回 (毎月)	アジア			
公債	日々	オセアニア			
社債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース))
その他債券 クレジット属性 ( )		アフリカ			
不動産投信		中近東 (中東)			
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)		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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 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。

<FW 日本債券インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 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	日々	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債 インデックス(除く日本、 円ヘッジ・円ベース))
資産複合 ( )		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。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式					
一般	年1回	グローバル (除く日本)			
大型株					
中小型株	年2回	日本			日経225
債券					
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
公債		欧州			
社債	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
その他債券 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) (債券・公債)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債 インデックス(除く日本、 ヘッジなし・円ベース))
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)			
資産配分固定型		エマージング			
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。

<FW 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル (除く日本)		
一般 大型株 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) (債券 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。

<FW J - REIT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 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	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		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本	ファミリー ファンド	
	年4回	北米		TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
不動産投信		オセアニア		
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数) (配当込み)
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。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	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	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経 225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
	年12回 (毎月)	アジア			
不動産投信		オセアニア			
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)	日々	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) (円ヘッジ・円ベース))
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。

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

・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 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 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 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ないます。

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	FW 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
	FW 日経225インデックス	日経平均株価(日経225)	ストックインデックス225・ マザーファンド
海外の 株式	FW 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
	FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数(円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
	FW 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	FW 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	FW 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
	FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
	FW 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	FW 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	FW 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
	FW 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(FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)、FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)およびFW 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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

## ●各ファンドの運用方針

## FW 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)</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。

## FW 日経225インデックス

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

◆わが国の株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。

投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

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

(b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆日経平均株価に採用されている銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします(ただし、財務リスクが高いと判断される銘柄については除く場合があります。)

日経平均株価への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。

**FW 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ないます。

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

※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。

**FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)**

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用います。  
MSCIコクサイ指数(円ベース)への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

(注)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。



## FW 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。

## FW 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1)</sup>を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注1) 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。

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注2)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、同インデックスに連動させるため為替ヘッジを行ないます。

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

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、債券先物取引を利用することがあります。このため、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。

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注2)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

## FW 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2)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。

**FW 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。

**FW 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。

**FW 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2.の運用が行なわれないことがあります。

## ●特定の指数について

## ◆東証株価指数(TOPIX)

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

## ◆日経平均株価(日経225)

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所に上場する市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

## ◆MSCIコクサイ指数

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

## ◆FTSE RAFI エマージング インデックス

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

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数

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

## ◆FTSE世界国債インデックス

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

## ◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

## -エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

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

## ◆東証REIT指数(配当込み)

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

## ◆S&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・運営されると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

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

**●FW 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。

**●FW 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。

**●FW 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。

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

### FW TOPIXインデックス

### FW 日経225インデックス

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

\*[FW TOPIXインデックス]および[FW 日経225インデックス]を除きます。

### FW 日本債券インデックス

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

\*[FW 日本債券インデックス]を除きます。

### FW 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リート<sup>®</sup>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リエートの銘柄数、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リート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リート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。

### FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- 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JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ②JPX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。
- ③JPX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。
- ④JPX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、JPX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、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥JPX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。
- ⑦JPX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、JPX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負いません。

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

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

「FW 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「ライセンサ各社」)によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にもFTSE RAFI®エマージング インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行なうことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については(過失の有無に関わらず)何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE®はLSEGの商標です。Fundamental Index®およびRAFI®はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

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

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



FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、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.

- 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JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ②JPX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。
- ③JPX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。
- ④JPXは、同指数の指数値およびこ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、JPX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、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥JPX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。
- ⑦JPX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、JPX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負いません。

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®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®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。「FW 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®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S&P」）の商標です。Dow Jones®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。「FW 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】

2016年9月26日

2022年3月9日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

<FW 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>&lt;FW 日経 2 2 5 インデックス&gt; みずほ信託銀行株式会社</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>
	<p>&lt;上記以外の各ファンド&gt; 三井住友信託銀行株式会社</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

ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

<FW TOPIXインデックス>  
東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。） など

<FW 日経225インデックス>  
わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄 など

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
外国の株式（DR（預託証券）を含みます。） など

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>  
外国の株式（DR（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DR（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ETF（上場投資信託証券） など

<FW 日本債券インデックス>  
わが国の公社債 など

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
外国の公社債 など

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>  
外国の公社債、新興国通貨建ての債券 など

<FW J-REITインデックス>  
わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 など

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券 など

（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12月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FW 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
FW 日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
FW 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
FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
FW 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
FW 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
FW 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
FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
FW 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
FW 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
FW 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
FW 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(「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 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

##### <FW 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。

#### <FW 日経225インデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株価(日経225)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)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。

#### <FW 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。

#### <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### <FW 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%程度

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%程度

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。

#### <FW 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。

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

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

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

二．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。

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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%程度

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。

二．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。

<FW J - R E I Tインデックス>

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

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

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

<FW 外国R E I T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ないます。

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

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

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

二．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。

<FW 外国R E I T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】

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」および「FW 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、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、「FW 日経225インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「FW 日経225インデックス」以外の各ファ



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

<FW T O P I Xインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 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

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 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

<FW T O P I Xインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 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

<FW 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。

#### <FW 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。

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。

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

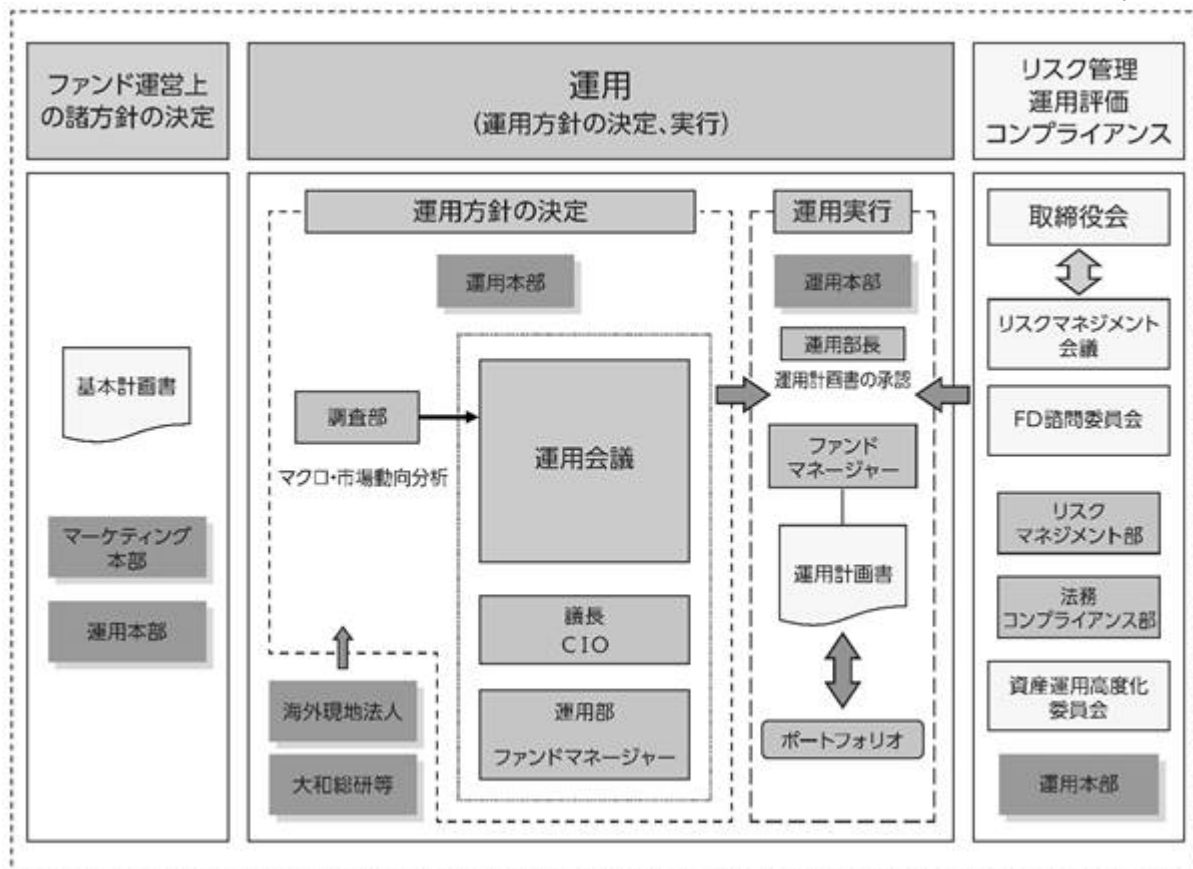
4．手形割引市場において売買される手形

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】

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12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

## (4)【分配方針】

### <各ファンド共通>

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

原則として、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）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（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、）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く、）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。

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

<FW 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、）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30を超えることとなる投資の指図をしません。

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

<FW 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）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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。

<FW 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)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>



<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

<FW 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)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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。

## &lt;上記以外の各ファンド&gt;

(規定なし)

信用取引(信託約款)

&lt;FW TOPIXインデックス&gt;

&lt;FW 日経225インデックス&gt;

&lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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、

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

## &lt;上記以外の各ファンド&gt;

(規定なし)

先物取引等(信託約款)

&lt;FW TOPIXインデックス&gt;

&lt;FW 日経225インデックス&gt;

&lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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、(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。

&lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

&lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

<FW 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）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 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。

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

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

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

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

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

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

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

- <FW J-REITインデックス>
- (規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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）

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

デリバティブ取引等（信託約款）

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け（信託約款）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

<FW J-REITインデックス>

（規定なし）

外貨建資産（信託約款）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW 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)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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。

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

< 上記以外の各ファンド >

（規定なし）

信用リスク集中回避（信託約款）

< 各ファンド共通 >

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

資金の借入れ（信託約款）

< 各ファンド共通 >

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

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 参 考 > マザーファンドの概要

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式(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せん。 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。

主な投資制限	<p>株式 株式への投資には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</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>
--------	---

#### ストックインデックス225・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、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ. 投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。</p> <p>1. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。</p> <p>2. 株式の組入比率は、高位を保ちます。</p> <p>ロ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均株価が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

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

#### 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

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

	<p>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	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 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

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。)</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 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 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>
---------------	--

## 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。

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



	<p>イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
--	---

#### 外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ. 主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>ロ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。</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、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、)の行使等により取得したものに限り、</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号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。
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号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

## 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	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&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース))の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。 ロ. 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。 ハ. 保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 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。

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。          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。          外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。          先物取引          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	S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	<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。          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。          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。          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. 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。          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。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225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。

<FW 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）

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 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）。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

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW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）

(FW 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

(FW 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

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

(FW 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

(FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の と同内容)

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)



## &lt;FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）&gt;

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW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

（FW 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

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

## &lt;FW 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

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

## &lt;FW 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

（FW 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

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

<FW 外国R E I T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

（FW 外国R E I T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

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の と同内容）

その他

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受け付けを中止すること、すでに受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（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等\*）があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

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

## (3)その他の留意点

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

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

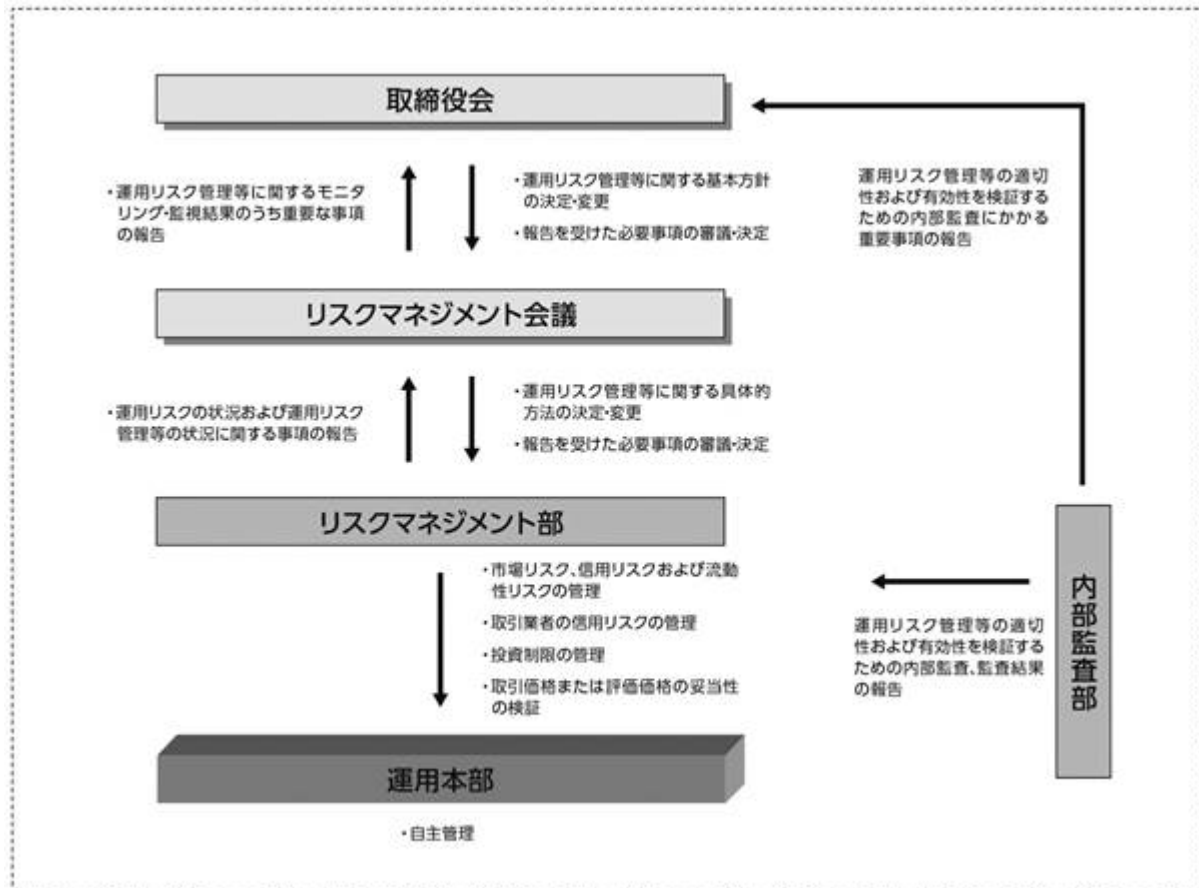
### 流動性リスクに関する事項

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

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

## (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

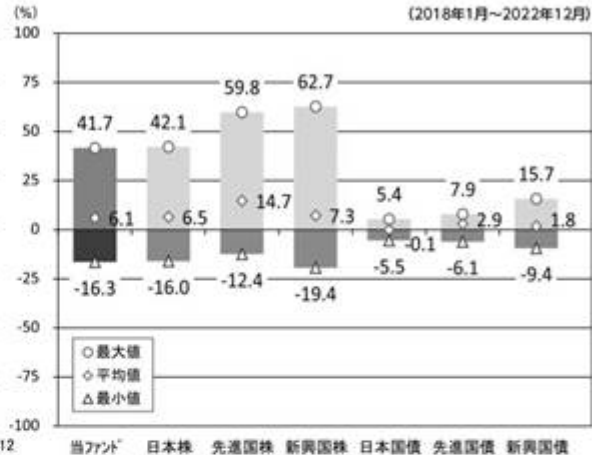
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

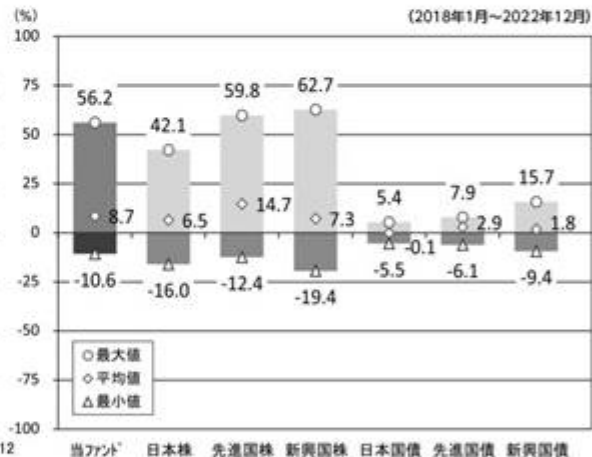
#### [FW TOPIXインデックス]



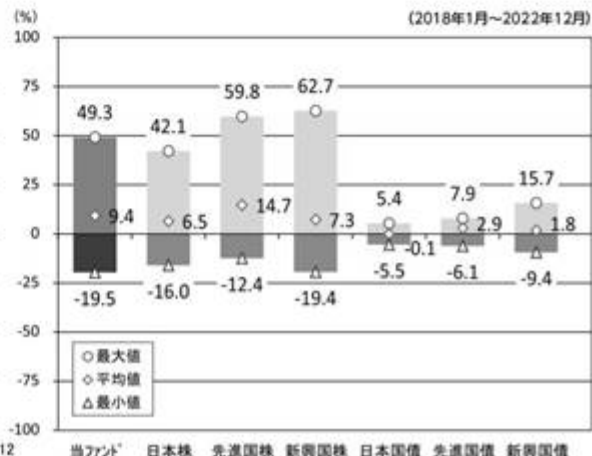
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [FW 日経225インデックス]



#### [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



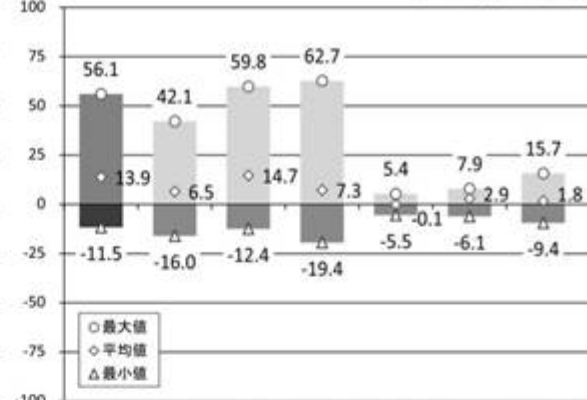
## [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]

(円) (2018年1月～2022年12月)



2018.1 2019.1 2020.1 2021.1 2022.1 2022.12

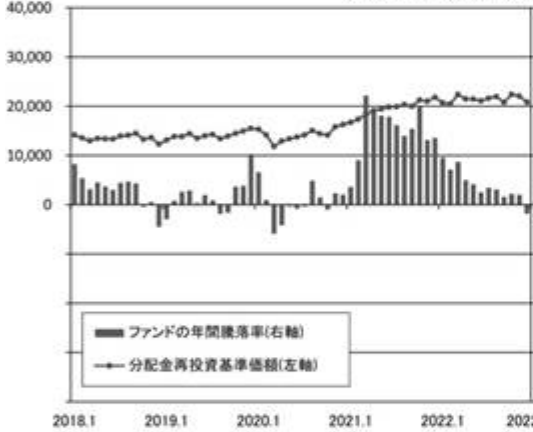
(%)(2018年1月～2022年12月)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

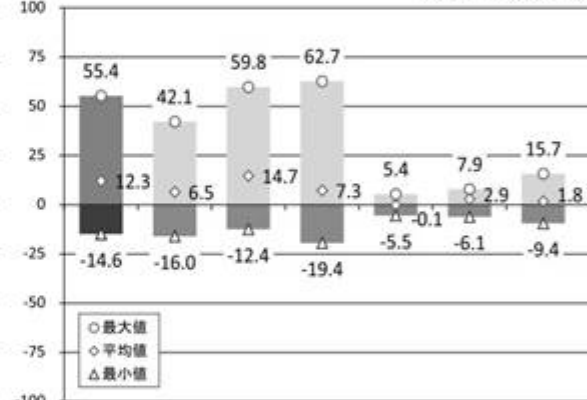
## [FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]

(円) (2018年1月～2022年12月)



2018.1 2019.1 2020.1 2021.1 2022.1 2022.12

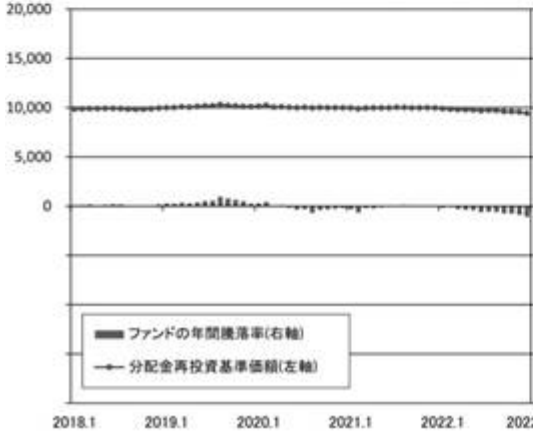
(%)(2018年1月～2022年12月)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

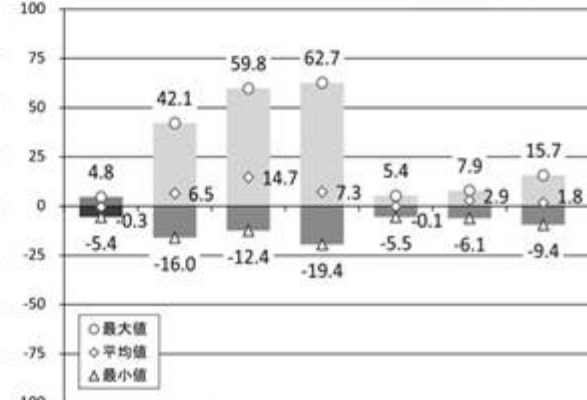
## [FW 日本債券インデックス]

(円) (2018年1月～2022年12月)



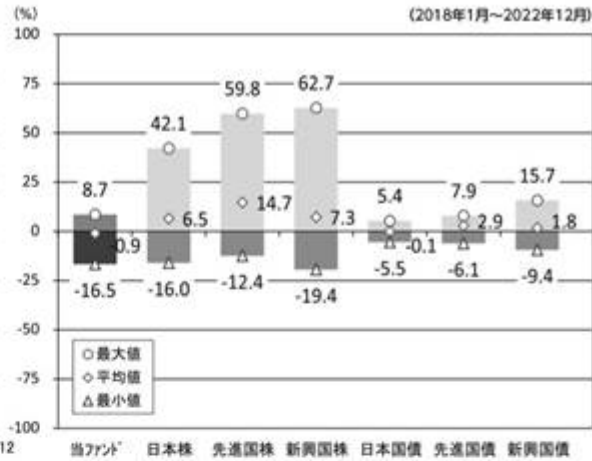
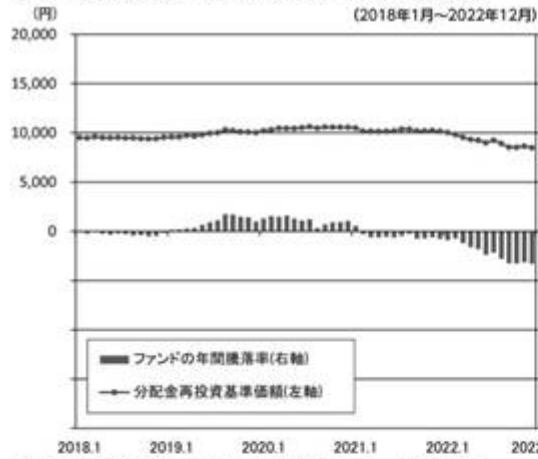
2018.1 2019.1 2020.1 2021.1 2022.1 2022.12

(%)(2018年1月～2022年12月)

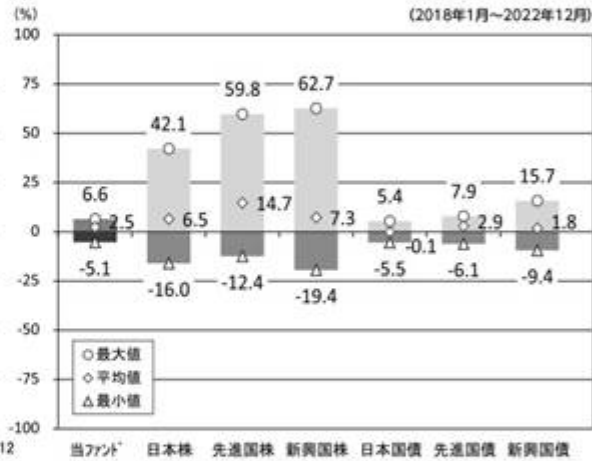
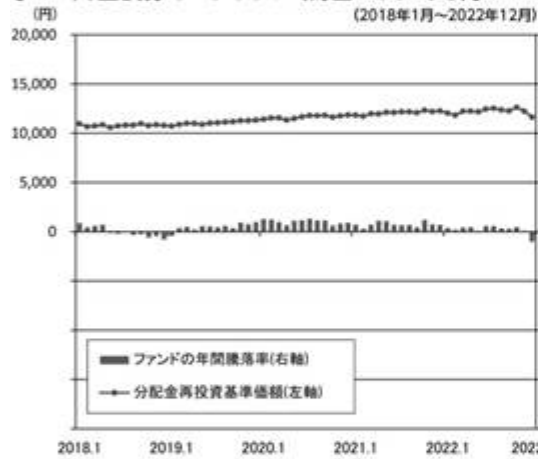


当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

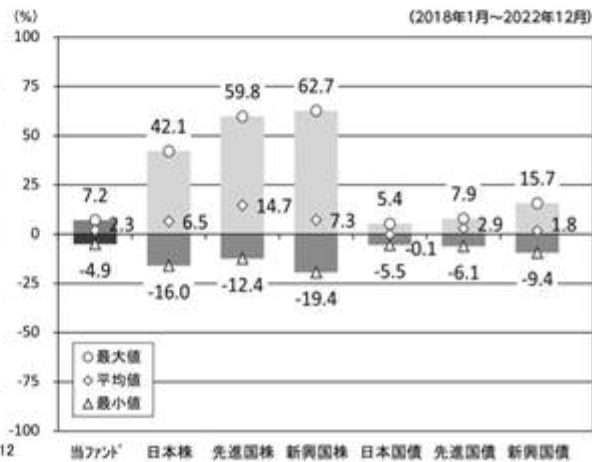
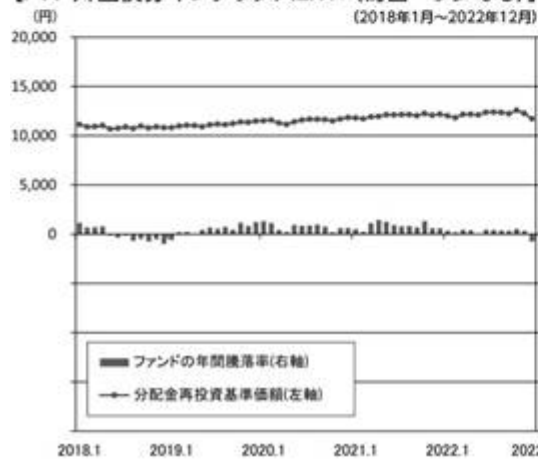
## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



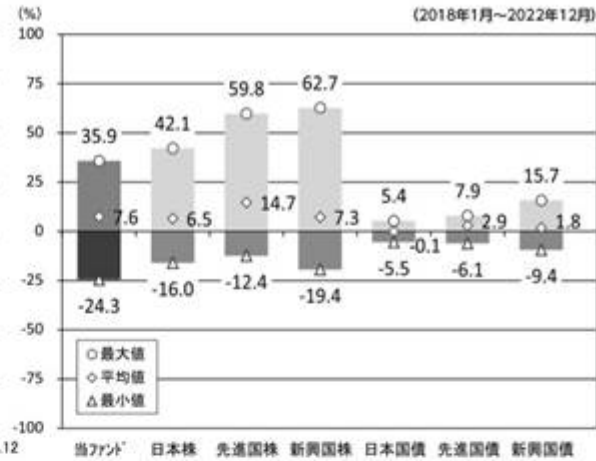
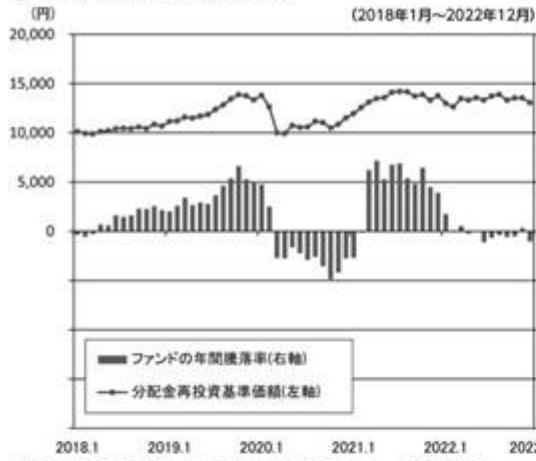
## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]



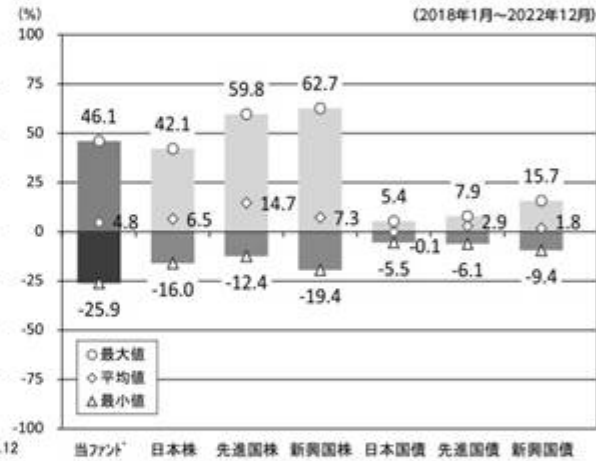
## [FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



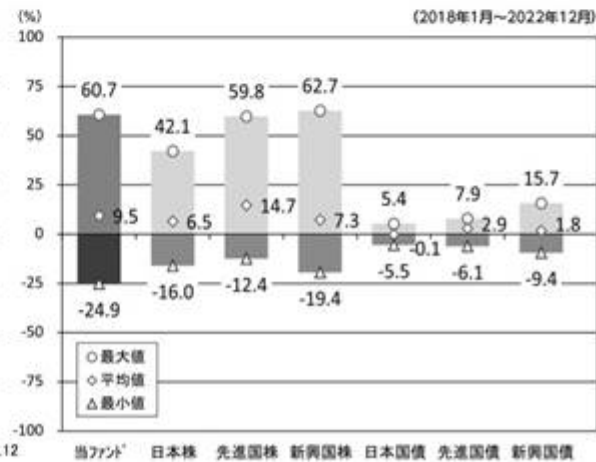
## [FW J-REITインデックス]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]





※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数(TOPIX) (配当込み)  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. (「MSCI」)が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。  
 ( <https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html> ) ●NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— エマージング・マーケット 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
-------	-------

FW TOPIXインデックス	年率0.341% (税抜0.31%)
FW 日経225インデックス	
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.4455% (税抜0.405%)
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	
FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	年率0.4565% (税抜0.415%)
FW 日本債券インデックス	年率0.3355% (税抜0.305%) 以内( )
FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	年率0.418% (税抜0.38%)
FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	
FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)	年率0.429% (税抜0.39%)
FW J-REITインデックス	年率0.341% (税抜0.31%)
FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	年率0.4345% (税抜0.395%)
FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	

( ) 毎月10日(休業日の場合翌営業日)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0.1485% (税抜0.135%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.3355% (税抜0.305%)

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

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

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<FW 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0.295% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<FW 日本債券インデックス>

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

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）&gt;

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

## &lt;FW 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0.27% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

## &lt;FW J - R E I Tインデックス&gt;

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

## &lt;FW 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0.275% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

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

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託および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(「FW T O P I X インデックス」および「FW 日経 2 2 5 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12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- （ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

## (1)【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,415,441,202	99.99
内 日本	15,415,441,202	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,123,510	0.01
純資産総額	15,416,564,712	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファン ド	日本	親投資信 託受益証 券	11,624,644,599	1.2872 14,963,246,161	1.3261 15,415,441,202	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,839,299,537	8,839,299,537	1.2045	1.2045
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,171,069,655	11,171,069,655	1.2246	1.2246
第5計算期間末 (2021年6月15日)	13,378,185,785	13,378,185,785	1.6103	1.6103
2021年12月末日	14,005,633,310	-	1.6398	-
2022年1月末日	13,723,314,493	-	1.5607	-
2月末日	13,690,732,210	-	1.5536	-
3月末日	14,819,571,750	-	1.6196	-
4月末日	14,622,096,007	-	1.5805	-
5月末日	14,869,847,308	-	1.5919	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,582,062,122	14,582,062,122	1.5446	1.5446
6月末日	14,817,762,073	-	1.5590	-
7月末日	15,460,920,841	-	1.6166	-
8月末日	15,708,159,680	-	1.6356	-
9月末日	14,865,749,418	-	1.5455	-
10月末日	15,776,683,049	-	1.6236	-
11月末日	16,229,587,530	-	1.6710	-
12月末日	15,416,564,712	-	1.5943	-

## 【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
2022年6月16日～ 2022年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.6
第2計算期間	14.7
第3計算期間	12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
第6計算期間	4.1
2022年6月16日～ 2022年12月15日	7.5

## (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	4,454,641,067	310,563,294
第2計算期間	4,087,459,929	1,994,650,943
第3計算期間	2,901,918,904	1,801,264,876
第4計算期間	4,061,789,160	2,278,428,042
第5計算期間	2,257,267,174	3,071,269,514
第6計算期間	2,926,939,275	1,794,346,768
2022年6月16日～ 2022年12月15日	1,156,365,075	985,468,981

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	192,859,392,760	97.31
内 日本	192,859,392,760	97.31



コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,336,638,517	2.69
純資産総額	198,196,031,277	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)	5,258,370,000	2.65
内 日本	5,258,370,000	2.65

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3,886,700	2,044.19 7,945,187,504	1,812.50 7,044,643,750	3.55
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	500,700	10,346.54 5,180,512,871	10,035.00 5,024,524,500	2.54
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,435,700	733.00 3,251,393,806	889.00 3,943,337,300	1.99
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	70,800	51,254.39 3,628,811,492	51,420.00 3,640,536,000	1.84
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	909,700	3,916.42 3,562,770,419	3,762.00 3,422,291,400	1.73
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	509,400	4,352.82 2,217,330,630	5,296.00 2,697,782,400	1.36
7	第一三共	日本	株式	医薬品	618,400	4,226.50 2,613,670,615	4,250.00 2,628,200,000	1.33
8	武田薬品	日本	株式	医薬品	628,100	3,841.33 2,412,743,827	4,111.00 2,582,119,100	1.30
9	任天堂	日本	株式	その他製品	446,900	6,170.60 2,757,642,207	5,532.00 2,472,250,800	1.25
10	日立	日本	株式	電気機器	358,900	6,726.92 2,414,292,813	6,691.00 2,401,399,900	1.21

11	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	410,500	5,517.82 2,265,065,990	5,644.00 2,316,862,000	1.17
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	538,800	4,397.87 2,369,575,350	4,177.00 2,250,567,600	1.14
13	KDDI	日本	株式	情報・通信業	548,600	4,362.91 2,393,495,037	3,982.00 2,184,525,200	1.10
14	三井物産	日本	株式	卸売業	548,000	3,325.82 1,822,553,353	3,853.00 2,111,444,000	1.07
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	468,300	4,367.04 2,045,086,631	4,283.00 2,005,728,900	1.01
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	702,000	2,634.82 1,849,643,657	2,827.50 1,984,905,000	1.00
17	信越化学	日本	株式	化学	121,300	15,884.38 1,926,776,470	16,225.00 1,968,092,500	0.99
18	HOYA	日本	株式	精密機器	152,900	14,472.95 2,212,915,556	12,705.00 1,942,594,500	0.98
19	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	49,900	41,087.09 2,050,246,090	38,880.00 1,940,112,000	0.98
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	461,600	3,807.27 1,757,438,596	4,146.00 1,913,793,600	0.97
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,008,200	1,664.04 1,677,693,872	1,856.00 1,871,219,200	0.94
22	本田技研	日本	株式	輸送用機器	575,400	3,536.33 2,034,808,024	3,032.00 1,744,612,800	0.88
23	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,400	24,044.59 2,053,408,300	20,200.00 1,725,080,000	0.87
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,140,300	1,501.74 1,712,440,730	1,488.00 1,696,766,400	0.86
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	77,000	20,293.82 1,562,624,174	19,160.00 1,475,320,000	0.74
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	258,100	5,976.72 1,542,593,012	5,660.00 1,460,846,000	0.74
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	214,700	7,387.73 1,586,146,848	6,588.00 1,414,443,600	0.71
28	ファナック	日本	株式	電気機器	69,400	21,745.81 1,509,159,452	19,835.00 1,376,549,000	0.69
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	680,200	1,979.74 1,346,620,890	2,006.50 1,364,821,300	0.69
30	S M C	日本	株式	機械	23,100	63,076.11 1,457,058,258	55,580.00 1,283,898,000	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.31%
合計	97.31%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.30%
建設業	1.92%
食料品	3.44%
繊維製品	0.45%
パルプ・紙	0.18%
化学	5.98%
医薬品	5.64%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.68%
鉄鋼	0.75%
非鉄金属	0.72%
金属製品	0.54%
機械	4.89%
電気機器	16.09%
輸送用機器	7.11%
精密機器	2.52%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.24%
陸運業	3.03%
海運業	0.62%
空運業	0.51%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.70%
卸売業	5.89%
小売業	4.64%
銀行業	6.30%
証券、商品先物取引業	0.73%

保険業	2.48%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.90%
サービス業	5.24%
合計	97.31%

(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 050 3月	買建	278	5,360,340,500	5,258,370,000	2.65%

(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

## ●FW TOPIXインデックス

2022年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	15,943円
純資産総額	154億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.6%
3カ月間	3.2%
6カ月間	2.3%
1年間	-2.8%
3年間	17.1%
5年間	15.4%
設定来	59.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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

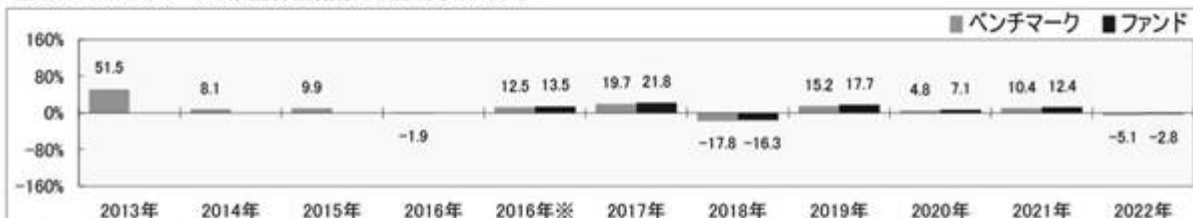
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	2,147	97.3%	電気機器	16.1%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.6%
国内株式先物	1	2.7%	情報・通信業	8.7%	TOPIX先物 0503月	-	2.7%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.1%	ソニーグループ	電気機器	2.5%
コール・ローン、その他		2.7%	銀行業	6.3%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.0%
合計	2,148	-	化学	6.0%	キーエンス	電気機器	1.8%
株式市場・上場別構成			卸売業	5.9%	日本電信電話	情報・通信業	1.7%
東証プライム市場		96.8%	医薬品	5.6%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.4%
東証スタンダード市場		0.5%	サービス業	5.2%	第一三共	医薬品	1.3%
東証グロース市場		-	機械	4.9%	武田薬品	医薬品	1.3%
地方市場・その他		-	その他	31.5%	任天堂	その他製品	1.2%
合計		97.3%	合計	97.3%	合計		19.5%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(※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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	14,906,518,330	99.98
内 日本	14,906,518,330	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,369,817	0.02
純資産総額	14,908,888,147	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ストックインデックス225・マザーファン ド	日本	親投資信 託受益証 券	4,264,000,209	3.5005 14,926,428,963	3.4959 14,906,518,330	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,152,341,843	8,152,341,843	1.3227	1.3227
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,210,563,802	11,210,563,802	1.3749	1.3749
第5計算期間末 (2021年6月15日)	14,516,397,552	14,516,397,552	1.9054	1.9054
2021年12月末日	14,628,745,384	-	1.8764	-
2022年1月末日	13,978,432,350	-	1.7590	-
2月末日	13,799,826,900	-	1.7286	-
3月末日	15,095,417,137	-	1.8278	-
4月末日	14,356,749,458	-	1.7636	-
5月末日	14,883,999,115	-	1.7927	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,452,677,600	14,452,677,600	1.7300	1.7300
6月末日	14,567,342,079	-	1.7361	-
7月末日	15,472,969,694	-	1.8281	-
8月末日	15,741,662,278	-	1.8474	-
9月末日	14,802,963,938	-	1.7199	-
10月末日	15,638,529,140	-	1.8285	-
11月末日	15,843,791,594	-	1.8536	-
12月末日	14,908,888,147	-	1.7316	-

## 【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

2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	20.1
第2計算期間	17.1
第3計算期間	5.9
第4計算期間	3.9
第5計算期間	38.6
第6計算期間	9.2
2022年6月16日～ 2022年12月15日	7.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,867,193,216	117,139,415
第2計算期間	2,980,382,583	1,019,368,476
第3計算期間	2,731,635,338	1,280,509,751
第4計算期間	3,775,885,438	1,785,574,418
第5計算期間	2,128,271,246	2,663,324,439
第6計算期間	2,488,303,056	1,752,829,196
2022年6月16日～ 2022年12月15日	1,071,796,232	856,694,437

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2022年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	220,229,204,530	97.34
内 日本	220,229,204,530	97.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,027,976,982	2.66
純資産総額	226,257,181,512	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)	6,050,560,000	2.67
内 日本	6,050,560,000	2.67

(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) 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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	289,000	81,772.42 23,632,230,000	80,530.00 23,273,170,000	10.29
2	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	289,000	40,901.52 11,820,540,000	38,880.00 11,236,320,000	4.97
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	1,734,000	5,522.02 9,575,190,000	5,644.00 9,786,696,000	4.33
4	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	1,734,000	4,352.73 7,547,640,000	3,982.00 6,904,788,000	3.05
5	ダイキン工業	日本	株式	機械	289,000	23,923.68 6,913,945,000	20,200.00 5,837,800,000	2.58
6	ファナック	日本	株式	電気機器	289,000	21,689.77 6,268,345,000	19,835.00 5,732,315,000	2.53
7	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	578,000	7,469.93 4,317,620,000	8,480.00 4,901,440,000	2.17
8	信越化学	日本	株式	化学	289,000	15,904.41 4,596,375,000	16,225.00 4,689,025,000	2.07
9	テルモ	日本	株式	精密機器	1,156,000	4,291.50 4,960,976,000	3,746.00 4,330,376,000	1.91
10	京セラ	日本	株式	電気機器	578,000	8,000.79 4,624,462,000	6,552.00 3,787,056,000	1.67
11	T D K	日本	株式	電気機器	867,000	5,055.15 4,382,820,000	4,335.00 3,758,445,000	1.66
12	第一三共	日本	株式	医薬品	867,000	4,203.99 3,644,865,000	4,250.00 3,684,750,000	1.63

13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	867,000	4,390.62 3,806,673,000	4,177.00 3,621,459,000	1.60
14	中外製薬	日本	株式	医薬品	867,000	3,503.13 3,037,215,000	3,368.00 2,920,056,000	1.29
15	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	289,000	10,328.56 2,984,955,000	10,035.00 2,900,115,000	1.28
16	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,445,000	1,981.79 2,863,690,000	2,006.50 2,899,392,500	1.28
17	NTTデータ	日本	株式	情報・通信業	1,445,000	1,947.54 2,814,200,000	1,932.00 2,791,740,000	1.23
18	オリンパス	日本	株式	精密機器	1,156,000	2,947.15 3,406,914,000	2,352.00 2,718,912,000	1.20
19	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,445,000	2,035.72 2,941,617,500	1,812.50 2,619,062,500	1.16
20	エーザイ	日本	株式	医薬品	289,000	6,217.33 1,796,810,000	8,704.00 2,515,456,000	1.11
21	エムスリー	日本	株式	サービス業	693,600	4,291.11 2,976,316,800	3,578.00 2,481,700,800	1.10
22	バンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	289,000	9,846.02 2,845,502,000	8,314.00 2,402,746,000	1.06
23	日東電工	日本	株式	化学	289,000	8,584.29 2,480,860,000	7,650.00 2,210,850,000	0.98
24	セコム	日本	株式	サービス業	289,000	8,427.59 2,435,574,000	7,543.00 2,179,927,000	0.96
25	キッコーマン	日本	株式	食料品	289,000	8,213.46 2,373,690,000	6,940.00 2,005,660,000	0.89
26	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	289,000	6,847.23 1,978,851,000	6,625.00 1,914,625,000	0.85
27	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	289,000	6,956.45 2,010,416,000	6,586.00 1,903,354,000	0.84
28	デンソー	日本	株式	輸送用機器	289,000	7,379.34 2,132,631,000	6,536.00 1,888,904,000	0.83
29	資生堂	日本	株式	化学	289,000	5,223.33 1,509,543,000	6,471.00 1,870,119,000	0.83
30	オムロン	日本	株式	電気機器	289,000	6,972.39 2,015,022,000	6,405.00 1,851,045,000	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
-----------	------

株式	97.34%
合計	97.34%

(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	0.07%
鉱業	0.07%
建設業	1.66%
食料品	3.54%
繊維製品	0.14%
パルプ・紙	0.08%
化学	6.87%
医薬品	7.74%
石油・石炭製品	0.21%
ゴム製品	0.73%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	0.08%
非鉄金属	0.87%
金属製品	0.02%
機械	5.16%
電気機器	21.52%
輸送用機器	4.24%
精密機器	4.15%
その他製品	2.69%
電気・ガス業	0.16%
陸運業	1.40%
海運業	0.35%
空運業	0.04%
倉庫・運輸関連業	0.19%
情報・通信業	11.38%
卸売業	2.70%
小売業	12.02%
銀行業	0.71%
証券、商品先物取引業	0.24%
保険業	0.94%
その他金融業	0.73%
不動産業	1.11%
サービス業	4.60%

合計	97.34%
----	--------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	NK225先物 050 3月	買建	232	6,189,277,600	6,050,560,000	2.67%

(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) 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

## ●FW 日経225インデックス

2022年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	17,316円
純資産総額	149億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-6.6%
3カ月間	0.7%
6カ月間	-0.3%
1年間	-7.7%
3年間	15.8%
5年間	24.6%
設定来	73.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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

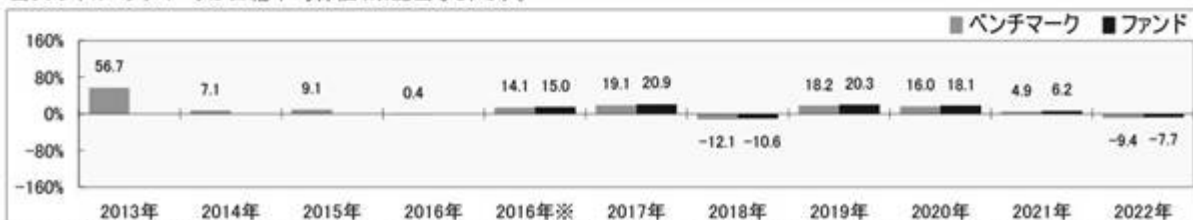
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	225	97.3%	電気機器	21.5%	ファーストリテイリング	小売業	10.3%
国内株式先物	1	2.7%	小売業	12.0%	東京エレクトロン	電気機器	5.0%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	11.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.3%
コール・ローン、その他		2.7%	医薬品	7.7%	KDDI	情報・通信業	3.1%
合計	226	-	化学	6.9%	NK225先物 0503月	-	2.7%
株式市場・上場別構成			機械	5.2%	ダイキン工業	機械	2.6%
東証プライム市場		97.3%	サービス業	4.6%	ファナック	電気機器	2.5%
東証スタンダード市場		-	輸送用機器	4.2%	アドバンテスト	電気機器	2.2%
東証グロース市場		-	精密機器	4.2%	信越化学	化学	2.1%
地方市場・その他		-	その他	19.6%	テルモ	精密機器	1.9%
合計		97.3%	合計	97.3%	合計		36.6%

※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日経平均株価(※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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	60,979,925,380	99.98
内 日本	60,979,925,380	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,373,036	0.02
純資産総額	60,989,298,416	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	24,741,317,556	2.4242 59,978,563,924	2.4647 60,979,925,380	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
第3計算期間末 (2019年6月17日)	36,065,457,483	36,065,457,483	1.2648	1.2648
第4計算期間末 (2020年6月15日)	42,369,088,321	42,369,088,321	1.2825	1.2825
第5計算期間末 (2021年6月15日)	56,165,645,906	56,165,645,906	1.7819	1.7819
2021年12月末日	64,331,769,001	-	1.9636	-
2022年1月末日	60,065,334,249	-	1.8263	-
2月末日	59,805,480,979	-	1.8099	-
3月末日	63,308,178,534	-	1.8915	-
4月末日	57,698,208,939	-	1.7307	-
5月末日	59,090,669,960	-	1.7253	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	53,716,109,956	53,716,109,956	1.5540	1.5540
6月末日	55,314,000,217	-	1.5812	-
7月末日	60,094,309,085	-	1.6669	-
8月末日	59,724,686,424	-	1.6336	-
9月末日	55,598,457,598	-	1.4891	-
10月末日	60,780,775,376	-	1.5876	-
11月末日	62,530,352,264	-	1.6244	-
12月末日	60,989,298,416	-	1.5815	-

## 【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

2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.9
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
第6計算期間	12.8
2022年6月16日～ 2022年12月15日	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	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
第3計算期間	9,938,067,643	7,085,414,359
第4計算期間	12,720,408,945	8,198,873,384
第5計算期間	7,978,557,364	9,493,197,837
第6計算期間	10,317,685,523	7,272,108,784
2022年6月16日～ 2022年12月15日	6,769,495,233	3,130,587,367

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	69,041,294,308	88.36
内 香港	642,183,454	0.82
内 シンガポール	296,776,243	0.38
内 イスラエル	159,127,378	0.20
内 ノルウェー	176,706,194	0.23
内 スウェーデン	751,080,680	0.96



内 デンマーク	664,477,395	0.85
内 イギリス	3,298,333,122	4.22
内 アイルランド	155,241,743	0.20
内 オランダ	928,115,430	1.19
内 ベルギー	215,546,449	0.28
内 フランス	2,517,049,902	3.22
内 ドイツ	1,746,776,287	2.24
内 スイス	2,201,589,106	2.82
内 ポルトガル	49,660,597	0.06
内 スペイン	523,074,947	0.67
内 イタリア	520,321,327	0.67
内 フィンランド	232,580,910	0.30
内 オーストリア	43,501,256	0.06
内 カナダ	2,669,045,524	3.42
内 アメリカ	49,653,406,308	63.55
内 オーストラリア	1,550,862,486	1.98
内 ニュージーランド	45,837,570	0.06
投資証券	1,702,733,795	2.18
内 香港	32,937,955	0.04
内 シンガポール	34,874,406	0.04
内 イギリス	35,280,341	0.05
内 ベルギー	7,072,040	0.01
内 フランス	28,710,257	0.04
内 カナダ	5,381,888	0.01
内 アメリカ	1,407,904,760	1.80
内 オーストラリア	150,572,148	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,388,211,216	9.46
純資産総額	78,132,239,319	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4,143,990,677	5.30
内 イギリス	180,048,000	0.23
内 ドイツ	592,676,043	0.76
内 カナダ	92,298,523	0.12
内 アメリカ	3,185,443,595	4.08
内 オーストラリア	93,524,516	0.12
為替予約取引(売建)	75,000,836,463	95.99

内 日本	75,000,836,463	95.99
------	----------------	-------

(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12月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	181,801	22,555.15 4,100,567,067	17,199.24 3,126,840,304	4.00
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	80,166	40,799.27 3,270,715,131	31,982.02 2,563,871,176	3.28
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	103,768	20,569.16 2,134,433,756	11,170.68 1,159,159,745	1.48
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	67,792	17,783.25 1,205,564,484	11,737.31 795,696,058	1.02
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,590	62,984.99 667,012,163	70,315.07 744,636,655	0.95
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	62,677	17,980.05 1,126,937,154	11,803.66 739,818,311	0.95
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	29,559	23,003.27 679,956,509	23,562.21 696,475,425	0.89
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	47,107	9,552.94 450,011,189	14,490.84 682,620,000	0.87
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	14,559	42,139.28 613,507,434	41,012.26 597,097,522	0.76
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	32,976	21,467.80 707,926,349	17,678.29 582,959,423	0.75

11	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	28,037	34,631.11 970,954,672	19,378.18 543,306,061	0.70
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	26,803	21,123.45 566,174,838	20,248.69 542,725,718	0.69
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	18,432	28,120.72 518,321,931	27,609.56 508,899,447	0.65
14	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	21,036	17,422.44 366,501,200	23,663.06 497,776,214	0.64
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,522	49,988.48 575,968,007	42,518.40 489,897,085	0.63
16	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	30,041	44,232.49 1,328,792,031	16,165.51 485,628,206	0.62
17	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	31,121	17,398.43 541,458,429	15,561.29 484,282,981	0.62
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	9,720	48,081.32 467,351,527	46,207.46 449,136,579	0.57
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	9,115	35,723.76 325,622,766	48,703.55 443,932,895	0.57
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	19,992	18,402.96 367,914,070	21,571.71 431,261,666	0.55
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	63,308	7,368.30 466,478,769	6,811.49 431,221,872	0.55
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	28,552	11,201.33 319,822,745	14,705.81 419,880,401	0.54
23	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	25,747	40,791.58 1,050,263,208	15,958.50 410,883,551	0.53
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	46,192	8,069.35 372,742,697	8,486.16 391,992,934	0.50
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	15,470	23,137.70 357,940,747	24,148.74 373,581,101	0.48
26	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	81,348	6,243.00 507,864,615	4,397.67 357,742,310	0.46
27	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	19,790	13,164.27 260,521,214	17,895.91 354,160,217	0.45
28	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	4,528	81,223.01 367,778,157	74,021.38 335,168,840	0.43

29	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	7,895	52,267.60 412,653,534	42,094.25 332,334,175	0.43
30	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,408	81,920.22 361,104,619	73,915.22 325,818,321	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	88.36%
投資証券	2.18%
合計	90.54%

(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。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.40%
素材	4.06%
資本財・サービス	8.96%
一般消費財・サービス	8.57%
生活必需品	7.22%
ヘルスケア	13.44%
金融	13.16%
情報技術	18.62%
コミュニケーション・サービス	5.59%
公益事業	3.03%
不動産	0.31%
合計	88.36%

(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 MAR 23	買建	124	3,288,765,872	3,185,443,595	4.08%

	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 23	買建	15	178,753,000	180,048,000	0.23%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 23	買建	6	96,113,268	93,524,516	0.12%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 23	買建	4	94,097,546	92,298,523	0.12%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 23	買建	8	125,479,558	123,903,880	0.16%
		EURO STOXX 50 MAR 23	買建	86	476,663,501	468,772,163	0.60%
為替予約取引	日本	英ポンド売/円買 2023年1月	売建	21,585,700	3,564,736,625	3,448,531,432	4.41%
		スイス・フラン売/円買 2023年1月	売建	16,062,300	2,334,955,766	2,307,861,781	2.95%
		ユーロ売/円買 2023年1月	売建	52,086,800	7,434,307,670	7,362,068,110	9.42%
		カナダ・ドル売/円買 2023年1月	売建	29,238,700	2,971,621,781	2,857,196,991	3.66%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2023年1月	売建	13,792,500	191,619,202	184,551,925	0.24%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2023年1月	売建	548,600	47,272,313	45,971,802	0.06%
		デンマーク・クローネ売/円買 2023年1月	売建	34,985,100	671,346,336	664,874,332	0.85%
		豪ドル売/円買 2023年1月	売建	20,363,400	1,891,293,653	1,821,742,344	2.33%
		シンガポール・ドル売/円買 2023年1月	売建	3,289,500	330,450,012	324,323,318	0.42%
		米ドル売/円買 2023年1月	売建	411,146,000	56,055,906,525	54,462,002,628	69.70%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2023年1月	売建	62,773,600	819,379,389	795,485,891	1.02%
		イスラエル・シケル売/円買 2023年1月	売建	3,087,000	123,276,258	116,349,030	0.15%
		香港ドル売/円買 2023年1月	売建	35,890,100	628,743,022	609,876,879	0.78%

(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

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	15,815円
純資産総額	609億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.6%
3カ月間	6.2%
6カ月間	0.0%
1年間	-19.5%
3年間	13.4%
5年間	31.1%
設定来	58.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期					
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6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	1,214	93.7%	日本円	102.9%	情報技術	18.6%	S&P500 EMINI MAR 23	アメリカ	4.1%
外国リート	58	2.1%	香港ドル	0.1%	ヘルスケア	13.4%	APPLE INC	アメリカ	4.0%
外国投資証券	5	0.1%	デンマーク・クローネ	0.0%	金融	13.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.3%
			ニュージーランド・ドル	0.0%	資本財・サービス	9.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.5%
コール・ローン、その他		9.5%	イスラエル・シケル	-0.0%	一般消費財・サービス	8.6%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.0%
合計	1,277	-	ノルウェー・クローネ	-0.0%	生活必需品	7.2%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	-0.0%	コミュニケーション・サービス	5.6%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.9%
アメリカ		69.4%	スウェーデン・クローネ	-0.0%	エネルギー	5.4%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
イギリス		4.5%	英ポンド	-0.0%	素材	4.1%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
その他		21.9%	その他	-3.0%	公益事業、他	3.3%	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	0.8%
合計		95.8%	合計	100.0%	合計	88.4%	合計		18.3%

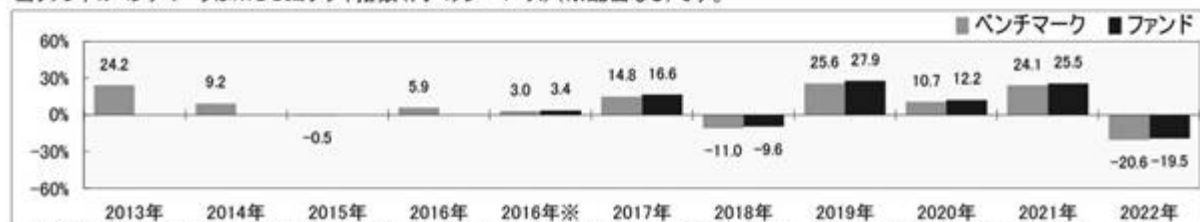
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)(※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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	12,834,855,764	99.99
内 日本	12,834,855,764	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,279,365	0.01
純資産総額	12,836,135,129	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	3,168,317,888	3.9968 12,663,206,926	4.0510 12,834,855,764	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
第3計算期間末 (2019年6月17日)	4,523,386,578	4,523,386,578	1.4011	1.4011
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,717,881,883	5,717,881,883	1.4231	1.4231
第5計算期間末 (2021年6月15日)	9,292,062,179	9,292,062,179	2.0848	2.0848
2021年12月末日	10,663,658,109	-	2.3658	-
2022年1月末日	10,154,967,987	-	2.1995	-
2月末日	10,195,031,876	-	2.1839	-
3月末日	11,567,472,437	-	2.4156	-
4月末日	10,945,046,464	-	2.3115	-
5月末日	11,256,054,768	-	2.3044	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	10,844,781,442	10,844,781,442	2.1770	2.1770
6月末日	11,343,076,650	-	2.2496	-
7月末日	12,294,972,330	-	2.3374	-
8月末日	12,549,975,990	-	2.3526	-
9月末日	12,246,906,105	-	2.2365	-
10月末日	13,564,010,366	-	2.4498	-
11月末日	12,940,086,423	-	2.3772	-
12月末日	12,836,135,129	-	2.2305	-

## 【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
2022年6月16日～ 2022年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.3
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
第6計算期間	4.4
2022年6月16日～ 2022年12月15日	8.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,475,674,063	70,680,538
第2計算期間	1,380,206,909	412,026,062
第3計算期間	1,523,438,524	669,208,679
第4計算期間	1,946,108,703	1,156,513,875
第5計算期間	1,622,654,198	1,183,681,857
第6計算期間	1,798,628,403	1,274,027,097
2022年6月16日～ 2022年12月15日	1,244,095,129	675,403,283

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2022年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	260,388,313,712	91.31
内 香港	2,453,969,153	0.86
内 シンガポール	1,182,601,623	0.41
内 イスラエル	628,095,849	0.22
内 ノルウェー	677,726,543	0.24

内 スウェーデン	2,889,981,227	1.01
内 デンマーク	2,547,429,906	0.89
内 イギリス	12,136,018,031	4.26
内 アイルランド	554,065,729	0.19
内 オランダ	3,424,990,248	1.20
内 ベルギー	788,564,694	0.28
内 フランス	9,349,898,275	3.28
内 ドイツ	6,477,281,652	2.27
内 スイス	7,985,712,870	2.80
内 ポルトガル	181,185,179	0.06
内 スペイン	1,951,244,193	0.68
内 イタリア	1,869,548,195	0.66
内 フィンランド	811,004,451	0.28
内 オーストリア	151,347,424	0.05
内 カナダ	9,544,568,958	3.35
内 アメリカ	189,110,132,665	66.32
内 オーストラリア	5,503,700,434	1.93
内 ニュージーランド	169,246,413	0.06
投資証券	6,397,667,240	2.24
内 香港	130,356,521	0.05
内 シンガポール	131,265,975	0.05
内 イギリス	114,126,586	0.04
内 ベルギー	25,886,118	0.01
内 フランス	101,749,064	0.04
内 カナダ	26,170,695	0.01
内 アメリカ	5,350,404,922	1.88
内 オーストラリア	517,707,359	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18,376,932,395	6.44
純資産総額	285,162,913,347	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)	18,342,514,703	6.43
内 イギリス	1,068,284,800	0.37
内 ドイツ	3,362,082,403	1.18
内 カナダ	946,059,863	0.33
内 アメリカ	12,202,304,094	4.28
内 オーストラリア	763,783,543	0.27

為替予約取引(買建)		12,429,100,800	4.36
	内 日本	12,429,100,800	4.36

(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12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	692,000	18,762.18 12,983,471,506	17,199.24 11,901,878,924	4.17
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	305,000	31,961.98 9,748,432,348	31,982.02 9,754,518,235	3.42
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	394,800	12,286.29 4,850,648,919	11,170.68 4,410,186,833	1.55
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	258,100	12,659.44 3,267,415,304	11,737.31 3,029,401,002	1.06
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	40,266	70,163.26 2,825,196,668	70,315.07 2,831,306,850	0.99
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	238,540	12,682.27 3,025,236,424	11,803.66 2,815,646,249	0.99
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	113,200	23,376.69 2,646,256,159	23,562.21 2,667,242,398	0.94
8	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	179,305	14,671.71 2,630,711,906	14,490.84 2,598,280,066	0.91
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	56,150	41,841.50 2,349,405,927	41,012.26 2,302,838,511	0.81
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	126,270	18,129.60 2,289,241,565	17,678.29 2,232,238,183	0.78

11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	102,667	19,321.38 1,983,671,412	20,248.69 2,078,872,564	0.73
12	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,180	20,810.14 2,230,440,205	19,378.18 2,076,953,440	0.73
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	70,450	27,776.63 1,956,868,777	27,609.56 1,945,093,643	0.68
14	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	80,018	24,033.29 1,923,097,761	23,663.06 1,893,471,055	0.66
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	44,150	41,966.50 1,852,823,485	42,518.40 1,877,187,669	0.66
16	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	114,850	24,087.43 2,766,455,487	16,165.51 1,856,609,283	0.65
17	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	113,134	15,993.37 1,809,409,117	15,561.29 1,760,511,254	0.62
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	37,100	45,590.27 1,691,402,029	46,207.46 1,714,297,026	0.60
19	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	34,785	48,334.24 1,681,308,569	48,703.55 1,694,153,126	0.59
20	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	241,613	6,570.64 1,587,570,034	6,811.49 1,645,744,775	0.58
21	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	76,072	21,008.66 1,598,180,465	21,571.71 1,641,003,275	0.58
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	109,121	14,450.10 1,576,812,347	14,705.81 1,604,713,129	0.56
23	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	98,200	14,565.01 1,430,291,291	15,958.50 1,567,124,896	0.55
24	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	176,950	8,296.53 1,468,092,744	8,486.16 1,501,626,897	0.53
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	59,400	24,244.02 1,440,099,148	24,148.74 1,434,435,512	0.50
26	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	311,301	4,914.01 1,529,757,771	4,397.67 1,369,001,559	0.48
27	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	74,105	16,740.16 1,240,531,005	17,895.91 1,326,177,003	0.47
28	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	17,412	69,346.49 1,207,463,532	74,021.38 1,288,860,390	0.45

29	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	16,900	71,737.35 1,212,361,930	73,915.22 1,249,167,336	0.44
30	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	16,921	79,202.26 1,340,181,847	73,097.54 1,236,883,627	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	91.31%
投資証券	2.24%
合計	93.56%

(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

業種	投資比率
エネルギー	5.54%
素材	4.17%
資本財・サービス	9.26%
一般消費財・サービス	8.87%
生活必需品	7.44%
ヘルスケア	13.92%
金融	13.49%
情報技術	19.35%
コミュニケーション・サービス	5.81%
公益事業	3.12%
不動産	0.33%
合計	91.31%

(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 MAR 23	買建	475	12,559,272,070	12,202,304,094	4.28%

	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 23	買建	89	1,061,898,360	1,068,284,800	0.37%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 23	買建	49	787,637,870	763,783,543	0.27%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 23	買建	41	967,919,140	946,059,863	0.33%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 23	買建	58	910,080,395	898,303,130	0.32%
		EURO STOXX 50 MAR 23	買建	452	2,507,905,464	2,463,779,273	0.86%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年1月	買建	62,300,000	8,453,304,600	8,252,500,970	2.89%
		豪ドル買/円売 2023年1月	買建	5,200,000	478,773,020	465,200,320	0.16%
		英ポンド買/円売 2023年1月	買建	4,700,000	773,597,780	750,872,000	0.26%
		スイス・フラン買/円売 2023年1月	買建	5,000,000	726,369,700	718,409,500	0.25%
		ユーロ買/円売 2023年1月	買建	11,300,000	1,614,960,540	1,597,167,990	0.56%
		カナダ・ドル買/円売 2023年1月	買建	6,600,000	668,138,920	644,950,020	0.23%

(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

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2022年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	22,305円
純資産総額	128億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-6.2%
3カ月間	-0.3%
6カ月間	-0.8%
1年間	-5.7%
3年間	41.2%
5年間	60.8%
設定来	123.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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

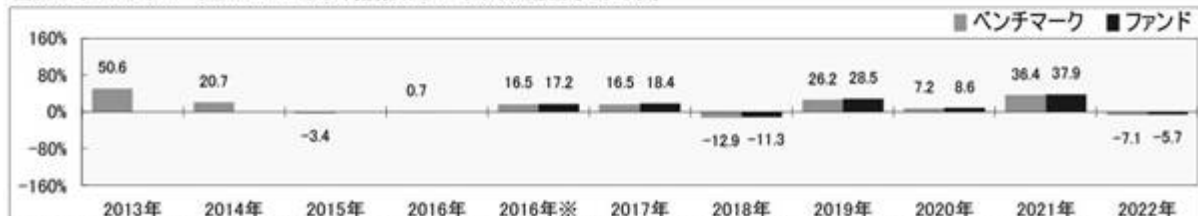
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	1,214	97.7%	米ドル	72.6%	情報技術	19.3%	S&P500 EMINI MAR 23	アメリカ	4.3%
外国リート	58	2.2%	ユーロ	9.8%	ヘルスケア	13.9%	APPLE INC	アメリカ	4.2%
外国投資証券	5	0.1%	英ポンド	4.7%	金融	13.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.4%
			カナダ・ドル	3.7%	資本財・サービス	9.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.5%
コール・ローン、その他		6.5%	スイス・フラン	3.1%	一般消費財・サービス	8.9%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
合計	1,277	-	豪ドル	2.4%	生活必需品	7.4%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	1.0%
			スウェーデン・クローネ	1.0%	コミュニケーション・サービス	5.8%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			デンマーク・クローネ	0.9%	エネルギー	5.5%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
アメリカ		72.5%	香港ドル	0.9%	素材	4.2%	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	0.9%
イギリス		4.7%	その他	0.9%	公益事業、他	3.5%	EURO STOXX 50 MAR 23	ドイツ	0.9%
その他		22.8%							
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	91.3%	合計		19.2%

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

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)(※配当なし)です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。  
・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。  
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 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)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,696,312,539	99.20
内 日本	2,696,312,539	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,769,952	0.80
純資産総額	2,718,082,491	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	529,323,738	3.9680 2,100,357,610	4.0510 2,144,290,462	78.89
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	290,171,403	1.9420 563,532,397	1.9024 552,022,077	20.31

(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
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6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,747,579,023	1,747,579,023	1.3793	1.3793
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,800,845,481	1,800,845,481	1.3573	1.3573
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,402,518,423	2,402,518,423	1.9822	1.9822
2021年12月末日	2,720,844,667	-	2.1814	-
2022年1月末日	2,597,262,711	-	2.0705	-
2月末日	2,610,672,898	-	2.0481	-
3月末日	2,819,881,642	-	2.2376	-
4月末日	2,615,628,486	-	2.1477	-
5月末日	2,686,888,283	-	2.1455	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,605,876,138	2,605,876,138	2.0510	2.0510
6月末日	2,688,832,318	-	2.1097	-
7月末日	2,710,187,340	-	2.1610	-
8月末日	2,780,136,543	-	2.1937	-
9月末日	2,634,431,205	-	2.0799	-
10月末日	2,843,108,853	-	2.2426	-
11月末日	2,784,358,720	-	2.2060	-
12月末日	2,718,082,491	-	2.0827	-

## 【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
2022年6月16日～ 2022年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	21.6
第2計算期間	13.3
第3計算期間	0.1
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.0
第6計算期間	3.5
2022年6月16日～ 2022年12月15日	6.5

## (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	702,644,049	33,190,572
第2計算期間	695,338,362	142,407,106
第3計算期間	339,152,791	304,533,894
第4計算期間	415,919,823	356,157,946
第5計算期間	193,724,602	308,457,694
第6計算期間	295,982,191	237,478,525
2022年6月16日～ 2022年12月15日	156,407,427	135,492,136

(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

前記「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）」の記載と同じ。

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12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	19,373,697,022	83.25
内 中国	7,075,746,355	30.41
内 台湾	2,427,789,408	10.43
内 タイ	896,811,363	3.85
内 シンガポール	25,327,002	0.11
内 マレーシア	99,124,017	0.43
内 インドネシア	328,947,455	1.41
内 インド	2,577,957,378	11.08
内 サウジアラビア	551,983,909	2.37
内 トルコ	858,922,076	3.69
内 カナダ	21,805,529	0.09
内 メキシコ	626,150,610	2.69
内 チリ	149,007,213	0.64
内 ブラジル	2,864,999,123	12.31
内 南アフリカ	869,125,584	3.73
投資証券	2,065,711,175	8.88
内 アメリカ	2,065,711,175	8.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,831,490,296	7.87
純資産総額	23,270,898,493	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)	1,856,067,602	7.98
内 アメリカ	1,856,067,602	7.98
為替予約取引(買建)	818,229,510	3.52
内 日本	818,229,510	3.52

(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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	871,600	2,400.54 2,092,313,279	2,370.02 2,065,711,175	8.88
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	368,000	1,928.82 709,808,017	1,924.80 708,327,210	3.04
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	401,500	1,842.99 739,963,455	1,456.06 584,608,492	2.51
4	VALE SA	ブラジル	株式	素材	215,190	1,874.84 403,452,690	2,229.48 479,762,597	2.06
5	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	73,900	5,736.71 423,943,986	5,705.10 421,607,186	1.81
6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	486,500	879.81 428,034,365	862.91 419,807,661	1.80
7	CHINA CONSTRUCTION BANK- H	中国	株式	金融	4,975,000	87.61 435,935,507	83.05 413,211,560	1.78
8	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	5,397,000	72.36 390,615,538	68.25 368,346,329	1.58
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネル ギー	85,602	3,923.04 335,820,925	4,094.71 350,515,622	1.51
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	ブラジル	株式	金融	488,836	581.65 284,339,049	627.10 306,551,500	1.32
11	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネル ギー	452,000	725.38 327,879,354	614.56 277,782,431	1.19
12	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	5,411,000	52.33 283,236,408	48.33 261,550,425	1.12
13	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネル ギー	3,841,800	60.06 230,786,200	64.50 247,818,382	1.06
14	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	560,359	427.76 239,703,075	380.02 212,950,782	0.92
15	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネル ギー	301,500	789.27 237,972,565	703.36 212,063,332	0.91
16	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	4,184,000	49.08 205,388,562	45.44 190,135,186	0.82
17	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	43,093	3,649.22 157,256,269	4,307.39 185,618,530	0.80

18	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,686,000	62.27 167,278,231	60.59 162,747,963	0.70
19	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	1,295,700	134.18 173,875,426	122.13 158,255,710	0.68
20	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	62,375	2,404.04 149,952,485	2,443.25 152,398,062	0.65
21	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	350,902	434.29 152,396,495	430.27 150,984,460	0.65
22	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション・サービス	77,250	2,476.05 191,275,793	1,872.20 144,627,450	0.62
23	TURK HAVA YOLLARI AO	トルコ	株式	資本財・サービス	143,046	410.88 58,776,891	1,009.59 144,417,817	0.62
24	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,122,200	131.49 147,563,286	125.76 141,127,872	0.61
25	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	153,100	840.06 128,614,837	871.17 133,376,780	0.57
26	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財・サービス	35,795	4,295.67 153,764,188	3,710.36 132,812,336	0.57
27	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	340,000	419.98 142,798,945	342.95 116,604,020	0.50
28	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	154,500	842.55 130,177,677	735.26 113,598,288	0.49
29	CHINA RESOURCES LAND LTD	中国	株式	不動産	192,000	616.46 118,363,817	585.48 112,413,696	0.48
30	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	メキシコ	株式	生活必需品	106,900	966.97 103,369,326	1,048.97 112,135,949	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。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	83.25%
投資証券	8.88%
合計	92.13%

(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	9.90%
素材	9.34%
資本財・サービス	2.98%
一般消費財・サービス	8.13%
生活必需品	3.63%
ヘルスケア	0.87%
金融	27.60%
情報技術	9.17%
コミュニケーション・サービス	5.95%
公益事業	3.42%
不動産	2.27%
合計	83.25%

(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) MAR 23	買建	287	1,853,953,890	1,856,067,602	7.98%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年1 月	買建	6,177,000	833,137,699	818,229,510	3.52%

(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

## ●FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2022年12月30日現在  
基準価額・純資産の推移

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



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,619	95.6%	米ドル	60.9%	情報技術	17.1%	S&P500 EMINI MAR 23	アメリカ	3.4%
外国投資証券	6	1.9%	ユーロ	7.8%	金融	16.2%	APPLE INC	アメリカ	3.3%
外国リート	58	1.7%	香港ドル	5.9%	ヘルスケア	11.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.7%
			英ポンド	3.7%	一般消費財・サービス	8.6%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.8%
コール・ローン、その他		7.5%	カナダ・ドル	2.9%	資本財・サービス	7.9%	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) MAR 23	アメリカ	1.6%
合計	1,683	-	ブラジル・レアル	2.6%	生活必需品	6.8%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.2%
国・地域別構成			スイス・フラン	2.5%	エネルギー	6.4%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.8%
アメリカ		60.6%	インド・ルピー	2.3%	コミュニケーション・サービス	5.8%	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.8%
中国		6.2%	台湾ドル	2.1%	素材	5.2%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.8%
その他		32.4%	その他	9.4%	公益事業、他	3.9%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.7%
合計		99.2%	合計	100.0%	合計	88.9%	合計		17.1%

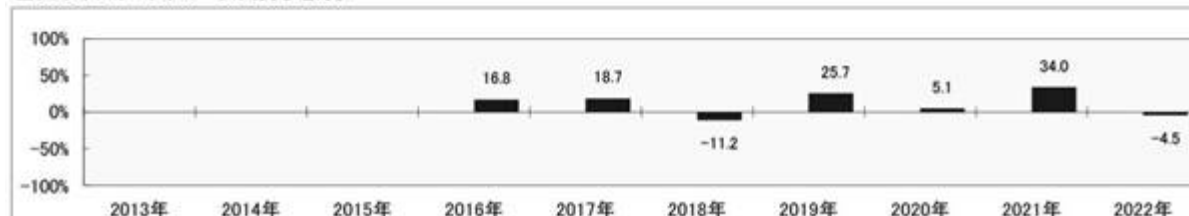
※株式業種別構成は、原則としてS&amp;PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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。

・2016年は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】(2022年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	35,210,769,500	99.90
内 日本	35,210,769,500	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	35,057,802	0.10
純資産総額	35,245,827,302	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12月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本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	26,231,669,150	1.3721 35,993,391,937	1.3423 35,210,769,500	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】



## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
第3計算期間末 (2019年6月17日)	27,372,292,105	27,372,292,105	1.0149	1.0149
第4計算期間末 (2020年6月15日)	33,339,891,042	33,339,891,042	1.0024	1.0024
第5計算期間末 (2021年6月15日)	36,597,337,061	36,597,337,061	0.9987	0.9987
2021年12月末日	36,970,302,873	-	0.9964	-
2022年1月末日	37,325,846,676	-	0.9892	-
2月末日	36,930,665,398	-	0.9841	-
3月末日	37,781,862,499	-	0.9812	-
4月末日	37,270,871,082	-	0.9786	-
5月末日	37,327,410,403	-	0.9770	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	36,841,618,949	36,841,618,949	0.9645	0.9645
6月末日	37,055,705,208	-	0.9676	-
7月末日	37,278,030,864	-	0.9740	-
8月末日	37,113,027,111	-	0.9717	-
9月末日	36,562,618,503	-	0.9612	-
10月末日	36,063,037,322	-	0.9600	-
11月末日	35,849,226,689	-	0.9552	-
12月末日	35,245,827,302	-	0.9427	-

## 【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

2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.4
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	0.4
第6計算期間	3.4
2022年6月16日～ 2022年12月15日	0.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	15,709,737,796	1,257,184,902
第2計算期間	17,894,969,975	7,012,636,355
第3計算期間	9,926,740,515	8,292,385,149
第4計算期間	14,370,293,804	8,081,979,073
第5計算期間	12,736,682,056	9,351,040,686
第6計算期間	10,246,997,124	8,694,888,536
2022年6月16日～ 2022年12月15日	3,400,173,262	4,339,268,100

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	103,978,492,340	92.88
内 日本	103,978,492,340	92.88
地方債証券	2,879,100,900	2.57
内 日本	2,879,100,900	2.57
特殊債券	1,992,225,300	1.78
内 日本	1,992,225,300	1.78

社債券		2,751,140,200	2.46
	内 日本	2,751,140,200	2.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		343,219,670	0.31
純資産総額		111,944,178,410	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12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	143 5年国債	日本	国債証券	2,500,000,000	100.26 2,506,600,000	100.12 2,503,025,000	0.100000 2025/03/20	2.24
2	436 2年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	100.09 2,302,277,000	99.99 2,299,839,000	0.005000 2024/05/01	2.05
3	355 10年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	99.48 1,571,815,600	98.20 1,551,623,200	0.100000 2029/06/20	1.39
4	349 10年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	99.87 1,548,047,000	99.26 1,538,607,500	0.100000 2027/12/20	1.37
5	352 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.74 1,496,115,000	98.76 1,481,490,000	0.100000 2028/09/20	1.32
6	145 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	100.30 1,253,850,000	100.12 1,251,512,500	0.100000 2025/09/20	1.12
7	150 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.81 1,247,725,000	99.40 1,242,612,500	0.005000 2026/12/20	1.11
8	141 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	100.24 1,243,013,200	100.11 1,241,475,600	0.100000 2024/09/20	1.11
9	151 5年国債	日本	国債証券	1,240,000,000	99.72 1,236,540,400	99.24 1,230,675,200	0.005000 2027/03/20	1.10
10	148 5年国債	日本	国債証券	1,230,000,000	99.96 1,229,517,800	99.70 1,226,396,100	0.005000 2026/06/20	1.10
11	147 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.00 1,200,000,000	99.80 1,197,696,000	0.005000 2026/03/20	1.07
12	144 5年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.29 1,183,457,400	100.12 1,181,439,600	0.100000 2025/06/20	1.06
13	364 10年国債	日本	国債証券	1,210,000,000	98.32 1,189,744,600	96.62 1,169,114,100	0.100000 2031/09/20	1.04

14	363 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	98.41 1,180,968,000	96.67 1,160,100,000	0.100000 2031/06/20	1.04
15	359 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	98.88 1,166,878,400	97.29 1,148,128,200	0.100000 2030/06/20	1.03
16	140 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.22 1,122,520,000	100.10 1,121,220,800	0.100000 2024/06/20	1.00
17	347 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.04 1,100,495,000	99.51 1,094,654,000	0.100000 2027/06/20	0.98
18	365 10年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	98.41 1,112,033,000	96.69 1,092,642,200	0.100000 2031/12/20	0.98
19	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.95 1,049,496,000	99.39 1,043,637,000	0.100000 2027/09/20	0.93
20	142 5年国債	日本	国債証券	1,040,000,000	100.25 1,042,662,400	100.12 1,041,320,800	0.100000 2024/12/20	0.93
21	361 10年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	98.62 1,055,244,700	96.90 1,036,840,700	0.100000 2030/12/20	0.93
22	149 5年国債	日本	国債証券	1,020,000,000	99.90 1,019,031,700	99.55 1,015,471,200	0.005000 2026/09/20	0.91
23	360 10年国債	日本	国債証券	1,040,000,000	98.73 1,026,863,600	97.10 1,009,860,800	0.100000 2030/09/20	0.90
24	351 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	99.77 997,790,000	98.92 989,260,000	0.100000 2028/06/20	0.88
25	139 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.20 951,966,500	100.10 951,026,000	0.100000 2024/03/20	0.85
26	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.20 951,919,000	99.78 947,938,500	0.100000 2026/12/20	0.85
27	367 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	99.67 956,860,800	97.95 940,358,400	0.200000 2032/06/20	0.84
28	433 2年国債	日本	国債証券	940,000,000	100.08 940,787,000	100.00 940,000,000	0.005000 2024/02/01	0.84
29	358 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	99.01 940,597,000	97.52 926,468,500	0.100000 2030/03/20	0.83
30	357 10年国債	日本	国債証券	940,000,000	99.20 932,489,400	97.77 919,038,000	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。

#### 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	92.88%
地方債証券	2.57%

特殊債券	1.78%
社債券	2.46%
合計	99.69%

(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

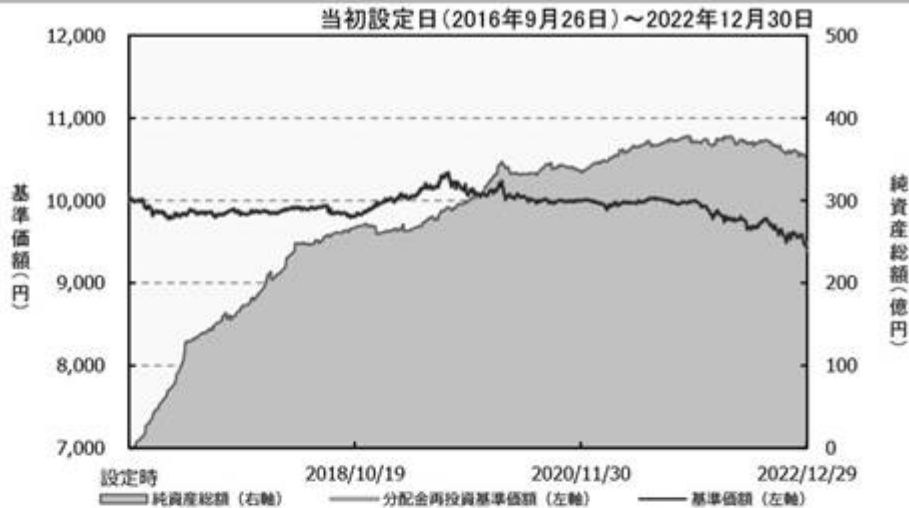
## ●FW 日本債券インデックス

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,427円
純資産総額	352億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.3%
3カ月間	-1.9%
6カ月間	-2.6%
1年間	-5.4%
3年間	-6.5%
5年間	-4.5%
設定来	-5.7%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

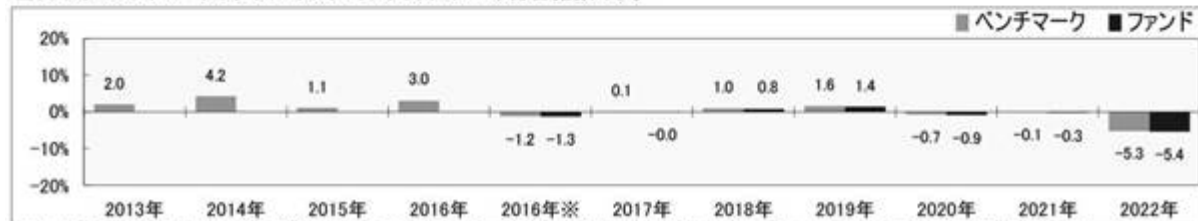
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
国内債券	332	99.6%	直接利回り(%)	143 5年国債	0.100	2025/03/20	2.2%
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	436 2年国債	0.005	2024/05/01	2.1%
コール・ローン、その他		0.4%	修正デュレーション	355 10年国債	0.100	2029/06/20	1.4%
合計	332	100.0%	残存年数	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.4%
債券種別構成			格付別構成	352 10年国債	0.100	2028/09/20	1.3%
国債		92.6%	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	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.1%
合計		99.6%	合計	合計			13.9%

※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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96,273,540,812	99.70
内 日本	96,273,540,812	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	288,600,722	0.30
純資産総額	96,562,141,534	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	110,735,611,701	0.8992 99,576,109,532	0.8694 96,273,540,812	99.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## 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	99.70%
合計	99.70%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
第3計算期間末 (2019年6月17日)	72,847,478,521	72,847,478,521	0.9905	0.9905
第4計算期間末 (2020年6月15日)	87,728,604,640	87,728,604,640	1.0451	1.0451
第5計算期間末 (2021年6月15日)	98,409,882,734	98,409,882,734	1.0198	1.0198
2021年12月末日	107,364,230,559	-	1.0145	-
2022年1月末日	107,642,622,950	-	1.0017	-
2月末日	105,614,713,079	-	0.9804	-
3月末日	103,777,102,394	-	0.9541	-
4月末日	102,665,108,344	-	0.9329	-
5月末日	102,414,549,225	-	0.9233	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	97,518,003,285	97,518,003,285	0.8787	0.8787
6月末日	100,278,779,232	-	0.8975	-
7月末日	103,607,302,147	-	0.9233	-
8月末日	100,247,504,648	-	0.8912	-
9月末日	97,524,517,182	-	0.8535	-
10月末日	97,974,409,700	-	0.8521	-
11月末日	98,986,543,737	-	0.8637	-
12月末日	96,562,141,534	-	0.8476	-

## 【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



2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.9
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	2.4
第6計算期間	13.8
2022年6月16日～ 2022年12月15日	0.9

## (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	37,021,440,339	2,368,454,114
第2計算期間	41,568,085,908	11,780,237,725
第3計算期間	27,255,813,662	18,253,054,308
第4計算期間	32,566,137,503	22,163,944,927
第5計算期間	31,995,491,437	19,438,727,028
第6計算期間	32,610,525,682	18,127,288,357
2022年6月16日～ 2022年12月15日	13,796,216,596	11,398,879,336

(注) 当初設定数量は100,000,000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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	110,597,975,892	93.25
内 ユーロ	37,465,445,755	31.59
内 中国	4,214,300,369	3.55
内 シンガポール	383,050,833	0.32
内 マレーシア	698,292,111	0.59
内 イスラエル	440,065,331	0.37

内 ルウェー	269,612,026	0.23
内 スウェーデン	254,842,825	0.21
内 デンマーク	454,956,718	0.38
内 イギリス	5,335,539,977	4.50
内 ポーランド	510,614,496	0.43
内 カナダ	2,360,748,034	1.99
内 アメリカ	55,173,007,555	46.52
内 メキシコ	1,011,680,801	0.85
内 オーストラリア	1,815,424,512	1.53
内 ニュージーランド	210,394,549	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,001,803,207	6.75
純資産総額	118,599,779,099	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)	1,812,867,772	1.53
内 ドイツ	129,180,502	0.11
内 アメリカ	1,683,687,270	1.42
為替予約取引(買建)	418,209,000	0.35
内 日本	418,209,000	0.35
為替予約取引(売建)	115,987,006,491	97.80
内 日本	115,987,006,491	97.80

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	16,580,000	98.31 2,163,027,197	97.13 2,137,153,245	2.500000 2024/05/15	1.80
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,800,000	97.33 2,040,721,111	96.30 2,019,167,446	2.500000 2025/01/31	1.70

3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000,000	98.99 1,970,435,760	97.91 1,949,077,695	2.750000 2024/02/15	1.64
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,300,000	95.96 1,948,285,476	95.12 1,931,332,387	2.125000 2025/05/15	1.63
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,500,000	95.12 1,956,624,800	92.77 1,908,160,313	2.625000 2029/02/15	1.61
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,700,000	97.29 1,897,865,314	96.25 1,877,675,673	2.125000 2024/07/31	1.58
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,820,000	95.19 1,872,039,532	94.45 1,857,525,921	2.000000 2025/08/15	1.57
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,850,000	93.29 1,838,486,311	92.66 1,825,953,327	2.000000 2026/11/15	1.54
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,000,000	93.53 1,737,618,918	92.70 1,722,236,334	2.250000 2027/08/15	1.45
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,810,000	97.05 1,649,808,328	96.14 1,634,339,357	2.250000 2024/11/15	1.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,800,000	95.60 1,623,976,230	94.79 1,610,098,995	2.250000 2025/11/15	1.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	93.16 1,483,543,536	92.68 1,475,884,092	1.625000 2026/02/15	1.24
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,750,000	91.67 1,429,481,887	91.35 1,424,367,629	1.500000 2026/08/15	1.20
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,950,000	112.09 1,331,289,328	109.35 1,298,771,060	6.125000 2027/11/15	1.10
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	96.00 1,019,136,000	94.46 1,002,851,056	2.875000 2028/08/15	0.85
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,050,000	94.35 1,007,975,863	93.43 998,126,736	2.375000 2027/05/15	0.84
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	93.61 993,816,840	93.75 995,281,848	0.375000 2024/07/15	0.84
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,670,000	95.55 972,608,132	93.25 949,178,139	2.250000 2027/02/15	0.80
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	97.28 942,370,775	95.61 926,212,692	3.125000 2028/11/15	0.78
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	96.07 930,717,193	94.70 917,378,057	2.875000 2028/05/15	0.77
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.57 897,038,730	95.73 889,273,126	1.875000 2024/08/31	0.75
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	93.50 868,586,523	92.93 863,310,371	1.875000 2026/06/30	0.73

23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	92.61 843,727,440	92.18 839,773,763	1.625000 2026/05/15	0.71
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	97.51 744,928,393	94.90 724,992,440	0.500000 2025/05/25	0.61
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	79.63 665,731,483	78.98 660,347,578	0.625000 2030/08/15	0.56
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,300,000	98.28 691,276,599	92.53 650,779,776	2.875000 2032/05/15	0.55
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	87.73 640,326,599	87.20 636,451,095	1.250000 2028/03/31	0.54
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,400,000	88.58 634,782,393	87.60 627,745,577	1.750000 2029/11/15	0.53
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,700,000	82.53 624,286,486	81.44 616,072,091	1.250000 2031/08/15	0.52
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,300,000	85.43 600,886,964	85.28 599,817,933	0.750000 2028/01/31	0.51

(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	93.25%
合計	93.25%

(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	33,872,511	33,307,700	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 23	買建	10	150,535,743	149,204,563	0.13%
		US 5YR NOTE MAR 23	買建	15	215,617,847	215,005,112	0.18%
		US 2YR NOTE MAR 23	買建	40	1,088,156,455	1,089,384,089	0.92%

		US ULTRA T-BOND MAR 23	買建	11	201,329,166	196,785,806	0.17%
	ドイツ	EURO-SCHATZ MAR 23	買建	5	75,366,303	74,660,793	0.06%
		EURO-OAT MAR 23	買建	3	57,771,708	54,519,709	0.05%
為替予約取引	日本	オフショア人民元買/円 売 2023年1月	買建	22,000,000	418,537,460	418,209,000	0.35%
		マレーシア・リンギット 売/円買 2023年1月	売建	23,280,000	701,060,904	696,660,984	0.59%
		ユーロ売/円買 2023年1 月	売建	283,121,000	40,599,381,527	40,019,974,400	33.74%
		カナダ・ドル売/円買 2023年1月	売建	25,399,000	2,601,078,168	2,482,343,325	2.09%
		メキシコ・ペソ売/円買 2023年1月	売建	163,401,000	1,162,598,115	1,108,545,064	0.93%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2023年1月	売建	20,924,000	291,657,543	280,011,245	0.24%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2023年1月	売建	3,033,000	261,700,281	254,193,910	0.21%
		英ポンド売/円買 2023年 1月	売建	36,462,000	6,036,173,188	5,825,898,360	4.91%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2023年1月	売建	26,491,000	510,759,725	503,482,647	0.42%
		豪ドル売/円買 2023年1 月	売建	21,914,000	2,040,541,832	1,960,658,728	1.65%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2023年1月	売建	20,695,000	627,039,874	624,579,239	0.53%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2023年1月	売建	4,217,000	427,214,570	415,827,405	0.35%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2023年1月	売建	25,779,000	336,490,709	326,694,689	0.28%
		イスラエル・シェケル 売/円買 2023年1月	売建	12,430,000	500,840,747	468,545,121	0.40%
オフショア人民元売/円 買 2023年1月	売建	228,363,000	4,488,406,256	4,339,308,053	3.66%		
米ドル売/円買 2023年1 月	売建	427,829,000	59,389,510,464	56,680,283,321	47.79%		

(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

### ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2022年12月30日現在

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

#### 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,476円
純資産総額	965億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.9%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	-5.6%
1年間	-16.5%
3年間	-15.4%
5年間	-11.9%
設定来	-15.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

#### 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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	579	94.5%	日本円	102.6%	直接利回り(%)	2.7	United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	1.8%
			オフショア人民元	0.4%	最終利回り(%)	3.7	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31	1.7%
ユーロ・ローン、その他		7.0%	マレーシア・リンギット	0.0%	修正デュレーション	6.6	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	1.6%
			メキシコ・ペソ	0.0%	残存年数	8.5	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	1.6%
合計	579	-	ノルウェー・クローネ	0.0%	格付別構成	比率	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	1.6%
債券種別構成		93.0%	南アフリカ・ランド	0.0%	AAA	79.3%	United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.6%
			シンガポール・ドル	-0.0%	AA	11.7%	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.6%
			ニュージーランド・ドル	-0.0%	A	9.0%	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.5%
			スウェーデン・クローネ	-0.0%	BBB	-	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.4%
			その他	-3.0%	BB	-	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15	1.4%
合計	93.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		15.9%	

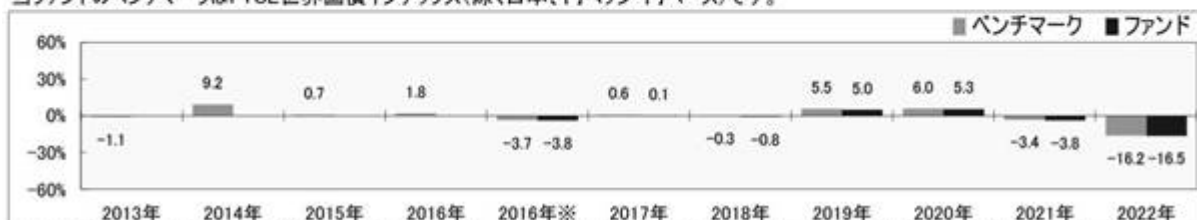
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

※2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	8,271,123,200	99.70
内 日本	8,271,123,200	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,834,909	0.30
純資産総額	8,295,958,109	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,750,897,396	3.1114 8,559,264,011	3.0067 8,271,123,200	99.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## 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	99.70%
合計	99.70%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,676,403,565	3,676,403,565	1.0978	1.0978
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,949,959,877	4,949,959,877	1.1579	1.1579
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,651,390,787	6,651,390,787	1.2187	1.2187
2021年12月末日	7,246,096,905	-	1.2270	-
2022年1月末日	7,450,330,051	-	1.2055	-
2月末日	7,137,752,455	-	1.1835	-
3月末日	7,520,203,066	-	1.2221	-
4月末日	7,572,161,768	-	1.2243	-
5月末日	7,658,827,229	-	1.2167	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,620,837,859	7,620,837,859	1.2025	1.2025
6月末日	7,943,421,743	-	1.2452	-
7月末日	8,205,697,027	-	1.2532	-
8月末日	8,175,713,907	-	1.2379	-
9月末日	8,243,440,944	-	1.2268	-
10月末日	8,547,364,287	-	1.2626	-
11月末日	8,496,237,632	-	1.2241	-
12月末日	8,295,958,109	-	1.1640	-

## 【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
2022年6月16日～ 2022年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.3
第6計算期間	1.3
2022年6月16日～ 2022年12月15日	1.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,394,396,399	72,737,713
第2計算期間	1,454,615,593	530,660,407
第3計算期間	1,649,381,625	547,264,585
第4計算期間	2,078,908,391	1,152,538,780
第5計算期間	1,968,605,898	785,747,124
第6計算期間	2,102,589,183	1,223,247,507
2022年6月16日～ 2022年12月15日	1,216,817,866	512,794,420

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	226,844,085,132	98.09
内 ユーロ	76,583,422,541	33.12

内 中国	8,181,927,271	3.54
内 シンガポール	1,030,468,768	0.45
内 マレーシア	1,202,409,584	0.52
内 イスラエル	787,415,181	0.34
内 ノルウェー	470,060,941	0.20
内 スウェーデン	461,598,754	0.20
内 デンマーク	728,632,050	0.32
内 イギリス	10,374,447,640	4.49
内 ポーランド	971,952,306	0.42
内 カナダ	4,477,614,464	1.94
内 アメリカ	115,767,772,234	50.06
内 メキシコ	1,879,692,562	0.81
内 オーストラリア	3,474,207,421	1.50
内 ニュージーランド	452,463,415	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,414,135,553	1.91
純資産総額	231,258,220,685	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）	2,048,596,288	0.89
内 日本	2,048,596,288	0.89

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

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

(注3) 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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	12,000,000	81.94 1,304,966,699	81.75 1,301,787,000	1.375000 2031/11/15	0.56
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,179,043,746	85.14 1,175,082,916	1.875000 2032/02/15	0.51
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,167,348,364	81.87 1,162,549,136	1.125000 2031/02/15	0.50
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,147,524,842	92.53 1,141,934,324	2.875000 2032/05/15	0.49

5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,116,082,373	81.44 1,113,253,076	1.250000 2031/08/15	0.48
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,049,458,215	80.28 1,044,100,320	0.875000 2030/11/15	0.45
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 979,146,058	84.50 975,647,954	1.625000 2031/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 942,335,957	92.18 945,464,154	1.625000 2026/05/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.85 924,179,197	93.27 928,299,532	0.375000 2024/09/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	91.84 914,067,457	91.40 909,718,215	2.750000 2032/08/15	0.39
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	100.09 861,830,186	99.42 856,009,918	2.250000 2024/05/25	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 839,834,414	94.46 839,887,759	2.875000 2028/08/15	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 841,848,800	78.98 838,536,608	0.625000 2030/08/15	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 857,631,362	100.05 835,023,903	2.750000 2027/10/25	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 829,470,544	89.61 832,452,313	1.125000 2026/10/31	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 816,420,826	94.70 816,843,475	2.875000 2028/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 813,137,562	92.77 812,506,972	2.625000 2029/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 794,125,500	94.27 794,403,573	2.750000 2028/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 792,148,934	93.43 793,541,753	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 790,447,455	85.28 792,212,365	0.750000 2028/01/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	96.29 787,377,180	96.60 789,936,573	2.375000 2024/08/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 779,184,542	90.71 782,453,607	0.250000 2025/06/30	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 778,175,359	90.46 780,331,734	1.500000 2027/01/31	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 752,630,169	96.14 755,419,464	2.250000 2024/11/15	0.33

25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 743,419,902	93.23 742,297,260	2.750000 2029/05/31	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 732,344,760	94.79 734,607,666	2.250000 2025/11/15	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 728,312,421	95.12 730,624,304	2.125000 2025/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.92 723,450,206	95.23 725,805,083	2.000000 2025/02/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	92.58 724,875,740	92.70 725,799,597	2.250000 2027/08/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.17 717,704,002	94.45 719,822,629	2.000000 2025/08/15	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	98.09%
合計	98.09%

(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	オフショア人民元買/円 売 2023年1月	買建	42,872,000	819,180,418	814,937,769	0.35%
		米ドル買/円売 2023年1 月	買建	3,688,000	497,156,435	488,599,147	0.21%
		英ポンド買/円売 2023年 1月	買建	120,000	19,350,840	19,173,600	0.01%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2023年1月	買建	545,000	55,212,696	53,741,033	0.02%

ユーロ買/円売 2023年1月	買建	3,513,000	501,826,865	496,572,733	0.21%
カナダ・ドル買/円売 2023年1月	買建	865,000	88,626,862	84,539,823	0.04%
メキシコ・ペソ買/円売 2023年1月	買建	9,528,000	67,791,720	64,639,857	0.03%
マレーシア・リングgit 買/円売 2023年1月	買建	879,000	26,431,530	26,392,326	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,640円
純資産総額	82億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.9%
3カ月間	-5.1%
6カ月間	-6.5%
1年間	-5.1%
3年間	2.7%
5年間	3.6%
設定来	16.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

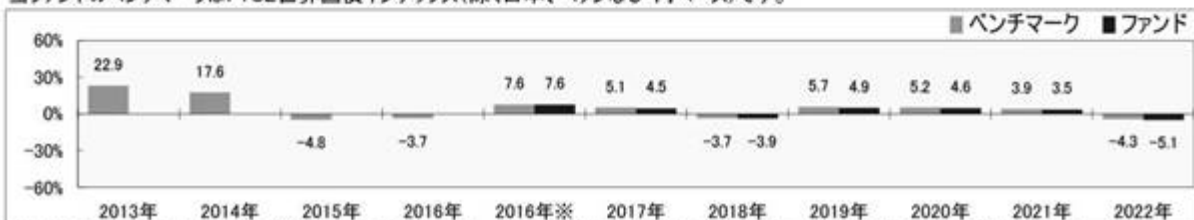
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	927	97.8%	米ドル	50.5%	直接利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.6%
			ユーロ	33.6%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.5%
			英ポンド	4.6%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.5%
コール・ローン、その他		2.2%	オフショア人民元	3.9%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.5%
合計	927	100.0%	カナダ・ドル	2.0%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.5%
債券種別構成			豪ドル	1.6%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.5%
国債		97.8%	メキシコ・ペソ	0.9%	AA	United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.6%	A	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.4%
			シンガポール・ドル	0.5%	BBB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2024/09/15	0.4%
			その他	1.8%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.4%
合計		97.8%	合計	100.0%	合計	合計		4.6%

※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。

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 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)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,270,322,603	99.70
内 日本	2,270,322,603	99.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,812,068	0.30
純資産総額	2,277,134,671	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	602,205,276	3.1056 1,870,243,187	3.0067 1,810,650,603	79.51
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	316,425,966	1.4340 453,778,115	1.4527 459,672,000	20.19

(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	99.70%
合計	99.70%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,344,487,088	1,344,487,088	1.1026	1.1026
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,706,986,677	1,706,986,677	1.1508	1.1508
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,952,886,340	1,952,886,340	1.2204	1.2204
2021年12月末日	2,031,084,695	-	1.2182	-
2022年1月末日	2,082,679,869	-	1.2007	-
2月末日	2,065,949,045	-	1.1810	-
3月末日	2,230,830,036	-	1.2163	-
4月末日	2,269,410,909	-	1.2176	-
5月末日	2,292,535,765	-	1.2102	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,294,610,149	2,294,610,149	1.1993	1.1993
6月末日	2,374,777,795	-	1.2372	-
7月末日	2,328,194,858	-	1.2385	-
8月末日	2,340,660,580	-	1.2350	-
9月末日	2,343,975,173	-	1.2235	-
10月末日	2,390,655,974	-	1.2573	-
11月末日	2,342,273,401	-	1.2260	-
12月末日	2,277,134,671	-	1.1716	-

## 【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
2022年6月16日～ 2022年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.5
第2計算期間	0.0
第3計算期間	2.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	6.0
第6計算期間	1.7
2022年6月16日～ 2022年12月15日	2.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	571,935,222	15,390,972
第2計算期間	683,181,594	128,182,978
第3計算期間	364,448,905	257,568,148
第4計算期間	564,211,268	300,318,547
第5計算期間	288,268,635	171,349,249
第6計算期間	483,164,155	170,071,251
2022年6月16日～ 2022年12月15日	178,790,310	157,793,684

(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

前記「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）」の記載と同じ。

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12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	26,918,920,727	95.70
内 中国	2,744,079,983	9.76
内 タイ	2,795,123,131	9.94
内 マレーシア	2,727,919,829	9.70
内 フィリピン	21,225,268	0.08
内 インドネシア	2,696,757,518	9.59
内 ポーランド	1,952,028,221	6.94
内 ハンガリー	812,490,299	2.89
内 ルーマニア	919,874,824	3.27
内 トルコ	250,512,386	0.89
内 チェコ	1,513,232,391	5.38
内 メキシコ	2,625,551,732	9.33
内 ドミニカ共和国	24,924,304	0.09
内 コロンビア	988,763,436	3.52
内 ペルー	643,331,363	2.29
内 チリ	594,304,103	2.11
内 ブラジル	2,674,958,865	9.51
内 ウルグアイ	28,871,367	0.10
内 エジプト	278,504,254	0.99
内 南アフリカ	2,626,467,453	9.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,209,378,320	4.30
純資産総額	28,128,299,047	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)	13,460,369	0.05
内 日本	13,460,369	0.05

(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) 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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	28,500,000	82.90 592,704,463	88.22 630,684,515	- 2024/01/01	2.24
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	55,650,000	106.03 461,464,293	105.69 459,953,616	10.500000 2026/12/21	1.64
3	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	18,000,000	88.09 397,744,636	93.82 423,616,451	- 2023/07/01	1.51
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	53,500,000	87.28 365,181,104	88.93 372,077,359	8.000000 2030/01/31	1.32
5	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	52,400,000	88.94 317,473,832	90.86 324,337,957	5.750000 2026/03/05	1.15
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	53,020,000	77.60 321,751,908	77.81 322,613,020	8.750000 2048/02/28	1.15
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	49,850,000	92.41 313,823,551	92.78 315,067,445	7.750000 2031/05/29	1.12
8	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	17,800,000	68.84 307,375,821	69.77 311,557,904	- 2026/01/01	1.11
9	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	12,350,000	90.57 280,600,457	92.34 286,072,357	10.000000 2027/01/01	1.02
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	42,900,000	84.20 282,480,188	85.11 285,542,099	8.250000 2032/03/31	1.02
11	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	10,890,000	94.22 257,399,742	95.60 261,153,056	10.000000 2025/01/01	0.93
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,030,000	93.49 254,939,458	94.55 257,831,242	7.500000 2027/06/03	0.92
13	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	39,000,000	97.28 258,461,641	96.83 257,264,921	8.000000 2024/09/05	0.91
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	39,800,000	79.13 246,282,755	79.09 246,172,114	8.500000 2037/01/31	0.88
15	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	37,200,000	83.93 244,172,050	84.06 244,548,447	8.875000 2035/02/28	0.87
16	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	35,230,000	97.20 233,282,017	97.40 233,766,303	8.500000 2029/05/31	0.83
17	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	12,200,000	70.00 214,242,801	74.25 227,228,285	- 2025/07/01	0.81
18	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	83.99 208,220,548	86.28 213,906,384	2.500000 2026/07/25	0.76

19	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	10,200,000	78.40 200,616,357	83.32 213,191,819	- 2024/07/01	0.76
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,550,000	101.11 210,428,176	100.39 208,920,296	10.000000 2024/12/05	0.74
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,250,000	78.61 196,304,950	78.67 196,467,269	2.750000 2029/10/25	0.70
22	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	32,200,000	78.15 196,790,597	77.56 195,311,772	8.750000 2044/01/31	0.69
23	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	51,000,000	94.08 184,263,298	96.09 188,184,614	2.000000 2031/12/17	0.67
24	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,100,000	95.13 188,587,331	94.74 187,814,237	8.500000 2038/11/18	0.67
25	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	29,100,000	81.31 185,039,196	80.75 183,767,693	9.000000 2040/01/31	0.65
26	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	8,100,000	87.43 177,658,294	89.53 181,921,053	10.000000 2029/01/01	0.65
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,300,000	89.44 178,526,702	89.28 178,195,380	8.000000 2047/11/07	0.63
28	THAILAND GOVERNMENT BOND	タイ	国債証券	48,000,000	93.84 172,984,130	96.03 177,013,555	1.000000 2027/06/17	0.63
29	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,120,000	87.50 173,570,537	87.31 173,202,783	7.750000 2042/11/13	0.62
30	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	20,800,000,000	95.83 169,444,066	97.75 172,825,536	6.500000 2031/02/15	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。

#### 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	95.70%
合計	95.70%

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

#### 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	ポーランド・ズロチ買/ 円売 2023年1月	買建	446,000	13,434,858	13,460,369	0.05%

(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) 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

## ●FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,716円
純資産総額	22億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.4%
3カ月間	-4.2%
6カ月間	-5.3%
1年間	-3.8%
3年間	2.1%
5年間	3.1%
設定来	17.2%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

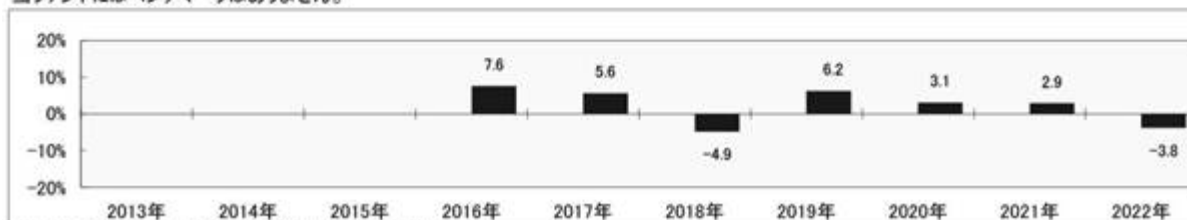
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	1,160	97.3%	米ドル	40.3%	直接利回り(%)	Brazil Letras do Tesouro Nacional	2024/01/01	0.5%
			ユーロ	26.8%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.7%	オフショア人民元	5.1%	修正デュレーション	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.4%
合計	1,160	100.0%	英ポンド	3.7%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	2.6%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.4%
債券種別構成			マレーシア・リンギット	2.4%	AAA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
国債		97.3%	タイ・バーツ	2.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
			インドネシア・ルピア	2.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.3%
			南アフリカ・ランド	2.0%	BBB	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.3%
			その他	13.0%	BB以下・無格付	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.3%
合計		97.3%	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。

※2016年は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ J - REIT インデックス】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,379,378,837	99.95
内 日本	7,379,378,837	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,686,911	0.05
純資産総額	7,383,065,748	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,261,324,070	3.1891 7,211,786,912	3.2633 7,379,378,837	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,254,479,810	3,254,479,810	1.1818	1.1818
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,081,513,165	4,081,513,165	1.0318	1.0318
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,102,975,985	6,102,975,985	1.4075	1.4075
2021年12月末日	6,461,218,256	-	1.3761	-
2022年1月末日	6,268,764,180	-	1.3004	-
2月末日	6,139,154,408	-	1.2620	-
3月末日	7,087,666,580	-	1.3485	-
4月末日	7,055,812,939	-	1.3322	-
5月末日	7,334,038,005	-	1.3556	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,943,298,664	6,943,298,664	1.2709	1.2709
6月末日	7,320,087,867	-	1.3325	-
7月末日	7,674,912,792	-	1.3740	-
8月末日	7,821,154,741	-	1.3898	-
9月末日	7,559,442,662	-	1.3316	-
10月末日	7,689,957,430	-	1.3537	-
11月末日	7,532,489,867	-	1.3535	-
12月末日	7,383,065,748	-	1.3052	-

## 【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



2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	12.7
第5計算期間	36.4
第6計算期間	9.7
2022年6月16日～ 2022年12月15日	5.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,295,129,456	60,344,463
第2計算期間	1,366,263,589	304,124,518
第3計算期間	1,052,662,291	596,816,922
第4計算期間	2,033,327,838	831,339,359
第5計算期間	1,408,443,585	1,028,117,605
第6計算期間	1,972,084,634	844,873,025
2022年6月16日～ 2022年12月15日	814,059,361	650,914,770

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	472,071,728,900	97.82
内 日本	472,071,728,900	97.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,501,063,315	2.18
純資産総額	482,572,792,215	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)	10,500,000,000	2.18
内 日本	10,500,000,000	2.18

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

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

(注3) 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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	51,923	670,165.00 34,796,977,469	588,000.00 30,530,724,000	6.33
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	44,509	642,026.30 28,575,948,731	577,000.00 25,681,693,000	5.32
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	224,571	108,720.38 24,415,445,208	104,700.00 23,512,583,700	4.87
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	143,931	166,998.87 24,036,314,595	163,000.00 23,460,753,000	4.86
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	75,024	332,287.97 24,929,572,708	308,500.00 23,144,904,000	4.80
6	GLP投資法人	日本	投資証券	143,656	162,918.60 23,404,235,611	151,300.00 21,735,152,800	4.50
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	67,091	314,865.51 21,124,642,601	293,400.00 19,684,499,400	4.08
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	88,684	194,305.77 17,231,813,158	186,500.00 16,539,566,000	3.43
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	44,503	357,866.25 15,926,122,168	339,000.00 15,086,517,000	3.13
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	99,562	151,118.49 15,045,659,677	150,600.00 14,994,037,200	3.11
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	30,439	409,010.38 12,449,867,065	370,500.00 11,277,649,500	2.34
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	143,532	71,801.73 10,305,846,609	77,500.00 11,123,730,000	2.31

13	産業ファンド	日本	投資証券	66,513	176,352.68 11,729,746,015	151,800.00 10,096,673,400	2.09
14	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	195,901	45,378.79 8,889,751,906	51,000.00 9,990,951,000	2.07
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	133,745	82,966.50 11,096,354,960	74,600.00 9,977,377,000	2.07
16	API投資法人	日本	投資証券	23,498	440,249.03 10,344,971,783	413,000.00 9,704,674,000	2.01
17	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	30,011	319,867.23 9,599,535,504	313,500.00 9,408,448,500	1.95
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	15,369	671,998.77 10,327,949,210	603,000.00 9,267,507,000	1.92
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	54,487	169,368.30 9,228,370,924	160,100.00 8,723,368,700	1.81
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	17,582	520,669.93 9,154,418,726	481,000.00 8,456,942,000	1.75
21	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	16,514	536,340.40 8,857,125,376	512,000.00 8,455,168,000	1.75
22	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	25,899	354,666.20 9,185,500,018	320,000.00 8,287,680,000	1.72
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	52,339	157,956.95 8,267,309,246	157,400.00 8,238,158,600	1.71
24	イオンリート投資	日本	投資証券	49,269	157,555.34 7,762,594,294	154,500.00 7,612,060,500	1.58
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	61,676	119,156.30 7,349,084,520	114,900.00 7,086,572,400	1.47
26	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	41,643	170,195.50 7,087,451,554	163,900.00 6,825,287,700	1.41
27	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	32,639	221,260.72 7,221,728,892	205,600.00 6,710,578,400	1.39
28	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	15,292	463,712.06 7,091,084,932	422,000.00 6,453,224,000	1.34
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	29,841	199,671.65 5,958,401,798	207,500.00 6,192,007,500	1.28
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	20,705	333,595.24 6,907,089,475	296,600.00 6,141,103,000	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

投資証券	97.82%
合計	97.82%

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

#### 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 050 3月	買建	5,600	10,683,456,000	10,500,000,000	2.18%

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

(注2) 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

## ●FW J-REITインデックス

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,052円
純資産総額	73億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.6%
3カ月間	-2.0%
6カ月間	-2.0%
1年間	-5.2%
3年間	-2.1%
5年間	35.5%
設定来	30.5%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

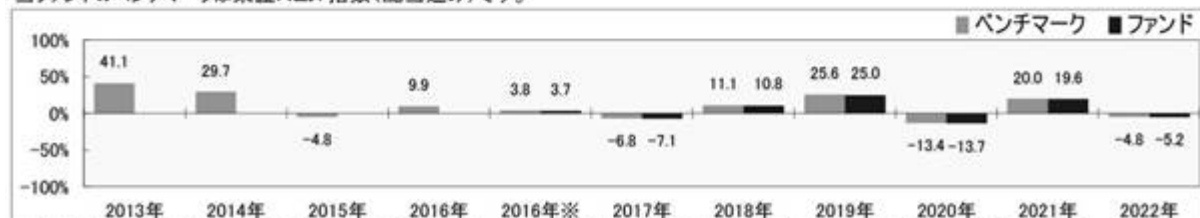
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	97.8%	オフィス不動産	26.7%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.3%
国内リート先物	1	2.2%	各種不動産	24.7%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	5.3%
			工業用不動産	20.1%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産	4.9%
			店舗用不動産	10.0%	野村不動産マスターF	各種不動産	4.9%
			住宅用不動産	9.8%	日本プロロジスリート	工業用不動産	4.8%
			ホテル・リゾート不動産	6.1%	GLP投資法人	工業用不動産	4.5%
			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%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.2%			ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	3.1%
合計	62	-	合計	97.8%	合計		44.4%

※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。

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	17,296,717,504	100.00
内 日本	17,296,717,504	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	349,678	0.00
純資産総額	17,296,367,826	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	20,566,846,022	0.8758 18,013,931,441	0.8410 17,296,717,504	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
第3計算期間末 (2019年6月17日)	10,895,667,977	10,895,667,977	1.0760	1.0760
第4計算期間末 (2020年6月15日)	12,056,922,582	12,056,922,582	0.9117	0.9117
第5計算期間末 (2021年6月15日)	17,785,453,405	17,785,453,405	1.2187	1.2187
2021年12月末日	20,867,273,600	-	1.3523	-
2022年1月末日	19,423,940,431	-	1.2555	-
2月末日	19,433,883,083	-	1.2513	-
3月末日	21,562,977,808	-	1.3284	-
4月末日	19,971,527,755	-	1.2911	-
5月末日	18,482,991,393	-	1.1943	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,269,529,050	16,269,529,050	1.0481	1.0481
6月末日	17,129,778,361	-	1.0925	-
7月末日	18,523,721,140	-	1.1651	-
8月末日	17,820,028,389	-	1.1069	-
9月末日	15,472,133,952	-	0.9409	-
10月末日	17,086,242,613	-	0.9975	-
11月末日	17,730,181,942	-	1.0283	-
12月末日	17,296,367,826	-	1.0019	-

## 【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

2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.6
第2計算期間	1.2
第3計算期間	10.7
第4計算期間	15.3
第5計算期間	33.7
第6計算期間	14.0
2022年6月16日～ 2022年12月15日	0.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,609,575,520	250,487,506
第2計算期間	4,660,565,456	1,092,724,304
第3計算期間	3,628,593,466	2,439,154,634
第4計算期間	5,683,570,118	2,585,491,447
第5計算期間	4,211,375,221	2,841,924,781
第6計算期間	5,111,449,724	4,182,934,798
2022年6月16日～ 2022年12月15日	3,026,899,015	1,399,568,955

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	5,165,613	0.03
内 イギリス	5,165,613	0.03
投資信託受益証券	286,311,875	1.42
内 アメリカ	286,311,875	1.42
投資証券	17,884,201,546	88.60
内 ガーンジー	44,931,842	0.22



内 韓国	47,886,522	0.24
内 香港	267,572,611	1.33
内 シンガポール	722,183,396	3.58
内 イスラエル	28,001,827	0.14
内 イギリス	839,131,227	4.16
内 アイルランド	6,933,982	0.03
内 オランダ	33,795,948	0.17
内 ベルギー	179,345,769	0.89
内 フランス	287,113,956	1.42
内 ドイツ	8,115,814	0.04
内 スペイン	72,149,335	0.36
内 イタリア	2,996,544	0.01
内 カナダ	350,987,451	1.74
内 アメリカ	13,648,980,327	67.62
内 オーストラリア	1,266,448,897	6.27
内 ニュージーランド	77,626,098	0.38
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,009,173,225	9.95
純資産総額	20,184,852,259	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,130,017,014	5.60
内 ドイツ	142,856,406	0.71
内 アメリカ	987,160,608	4.89
為替予約取引(買建)	132,601,600	0.66
内 日本	132,601,600	0.66
為替予約取引(売建)	19,141,750,155	94.83
内 日本	19,141,750,155	94.83

(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) 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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	----	----------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	97,948	18,193.56 1,782,036,904	15,123.81 1,481,347,823	7.34
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	9,819	93,433.00 917,419,578	88,294.59 866,964,668	4.30
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	16,816	46,546.51 782,728,070	37,498.36 630,572,523	3.12
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	66,547	9,867.97 656,684,828	8,496.78 565,435,285	2.80
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	34,692	15,373.29 533,330,350	15,568.36 540,097,684	2.68
6	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	102,508	4,696.25 481,403,503	4,300.80 440,867,124	2.18
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	50,139	10,918.95 547,467,608	8,735.64 437,996,304	2.17
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	30,591	17,439.43 533,489,725	13,442.51 411,219,823	2.04
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	14,883	28,949.83 430,860,350	21,583.65 321,229,537	1.59
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	196,018	1,786.83 350,268,234	1,555.83 304,970,861	1.51
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	15,804	22,570.94 356,711,183	19,268.04 304,512,104	1.51
12	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	25,970	11,250.43 292,175,834	11,024.71 286,311,875	1.42
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	36,029	10,610.69 382,292,622	7,940.76 286,097,930	1.42
14	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	14,253	28,127.09 400,895,442	19,773.62 281,833,506	1.40
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	42,544	6,961.44 296,167,588	6,045.81 257,213,026	1.27
16	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	12,287	24,919.73 306,188,759	20,932.09 257,192,688	1.27
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	13,126	22,771.58 298,900,899	19,218.94 252,267,820	1.25
18	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	61,716	5,253.59 324,230,746	3,984.98 245,937,087	1.22
19	LINK REIT	香港	投資証券	243,500	1,108.37 269,890,162	966.73 235,400,216	1.17
20	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	22,091	11,634.73 257,025,393	10,414.29 230,062,213	1.14

21	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	30,939	7,169.78 221,825,854	6,652.25 205,813,994	1.02
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	6,932	39,429.15 273,322,875	28,433.62 197,101,916	0.98
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	57,431	3,764.69 216,210,428	3,344.04 192,051,561	0.95
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	27,192	6,875.45 186,960,669	6,904.38 187,743,928	0.93
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	65,829	3,098.54 203,974,119	2,807.93 184,843,356	0.92
26	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	11,338	19,337.04 219,243,405	14,987.13 169,924,171	0.84
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	32,508	6,644.42 215,996,918	5,163.35 167,850,409	0.83
28	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	133,752	1,695.20 226,743,050	1,238.40 165,638,477	0.82
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	18,617	10,196.66 189,831,368	8,667.96 161,371,486	0.80
30	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	76,090	2,591.63 197,197,203	2,097.98 159,635,831	0.79

(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	0.03%
投資信託受益証券	1.42%
投資証券	88.60%
合計	90.05%

(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
不動産	0.03%
合計	0.03%

(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
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 23	買建	224	1,016,015,161	987,160,608	4.89%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 23	買建	170	145,678,662	142,856,406	0.71%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年1 月	買建	1,000,000	132,563,400	132,601,600	0.66%
		豪ドル売/円買 2023年1 月	売建	14,800,100	1,373,942,935	1,324,040,625	6.56%
		ユーロ売/円買 2023年1 月	売建	4,464,000	636,762,816	630,952,027	3.13%
		カナダ・ドル売/円買 2023年1月	売建	3,875,300	394,151,237	378,693,152	1.88%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2023年1月	売建	938,200	80,848,915	78,619,658	0.39%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2023年1月	売建	7,011,700	704,601,821	691,308,043	3.42%
		香港ドル売/円買 2023年 1月	売建	15,911,400	278,410,004	270,380,828	1.34%
		米ドル売/円買 2023年1 月	売建	111,640,300	15,221,653,134	14,788,309,533	73.26%
		イスラエル・シュケル 売/円買 2023年1月	売建	624,100	24,922,809	23,522,329	0.12%
英ポンド売/円買 2023年 1月	売建	5,983,500	987,837,858	955,923,960	4.74%		

(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

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,019円
純資産総額	172億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.6%
3カ月間	6.5%
6カ月間	-8.3%
1年間	-25.9%
3年間	-9.4%
5年間	0.9%
設定来	0.2%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

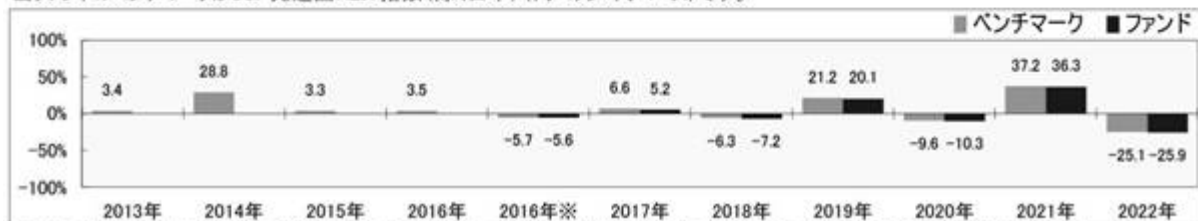
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	322	94.1%	日本円	102.5%	商業施設	17.6%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.3%
外国投資信託等	4	1.5%	韓国ウォン	0.2%	産業施設	15.2%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 23	-	アメリカ	4.9%
外国株式	1	0.0%	ユーロ	0.1%	住宅	13.0%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.3%
コール・ローン、その他		10.0%	香港ドル	0.1%	特殊用途施設	11.3%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.1%
合計	327	-	イスラエル・シケル	0.0%	各種不動産	8.7%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.8%
国・地域別構成			ニュージーランドドル	0.0%	ヘルスケア	7.6%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.7%
アメリカ		73.9%	シンガポール・ドル	-0.0%	オフィス	6.4%	VICI PROPERTIES INC	特殊用途施設	アメリカ	2.2%
オーストラリア		6.3%	カナダ・ドル	-0.1%	貸倉庫	6.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.2%
イギリス		4.2%	豪ドル	-0.2%	ホテル/リゾート	2.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.0%
その他		11.3%	その他	-2.7%			AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.6%
合計		95.6%	合計	100.0%	合計	88.5%	合計			33.1%

※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&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。

※2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】（2022年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,728,879,544	99.99
内 日本	3,728,879,544	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	396,834	0.01
純資産総額	3,729,276,378	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マ ザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	1,272,003,938	3.0501 3,879,821,684	2.9315 3,728,879,544	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,667,702,163	1,667,702,163	1.1931	1.1931
第4計算期間末 (2020年6月15日)	2,091,937,862	2,091,937,862	1.0120	1.0120
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,226,829,877	3,226,829,877	1.4252	1.4252
2021年12月末日	3,863,531,345	-	1.6322	-
2022年1月末日	3,618,905,610	-	1.5149	-
2月末日	3,620,413,927	-	1.5142	-
3月末日	4,109,584,067	-	1.7015	-
4月末日	4,017,065,467	-	1.7281	-
5月末日	3,715,901,865	-	1.5964	-
第6計算期間末 (2022年6月15日)	3,454,275,087	3,454,275,087	1.4737	1.4737
6月末日	3,682,125,556	-	1.5554	-
7月末日	3,962,926,967	-	1.6393	-
8月末日	3,895,753,622	-	1.6026	-
9月末日	3,491,147,200	-	1.4238	-
10月末日	3,876,371,008	-	1.5492	-
11月末日	3,828,585,598	-	1.5135	-
12月末日	3,729,276,378	-	1.4185	-

## 【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

2022年6月16日～ 2022年12月15日	-
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.3
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.8
第4計算期間	15.2
第5計算期間	40.8
第6計算期間	3.4
2022年6月16日～ 2022年12月15日	2.3

## (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	593,727,416	35,333,000
第2計算期間	637,956,340	111,827,964
第3計算期間	579,621,490	276,337,306
第4計算期間	1,036,279,306	366,994,605
第5計算期間	758,967,899	561,930,084
第6計算期間	709,209,320	629,454,617
2022年6月16日～ 2022年12月15日	454,537,672	199,926,603

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	7,172,352	0.03
内 イギリス	7,172,352	0.03
投資信託受益証券	1,571,022,030	5.81
内 アメリカ	1,571,022,030	5.81
投資証券	24,633,475,597	91.16
内 ガーンジー	55,597,620	0.21



内 韓国	60,373,068	0.22
内 香港	367,172,120	1.36
内 シンガポール	999,898,718	3.70
内 イスラエル	33,460,735	0.12
内 イギリス	1,167,467,798	4.32
内 アイルランド	8,549,598	0.03
内 オランダ	42,649,067	0.16
内 ベルギー	236,171,241	0.87
内 フランス	399,429,121	1.48
内 ドイツ	10,796,651	0.04
内 スペイン	96,853,757	0.36
内 イタリア	3,098,023	0.01
内 カナダ	478,936,734	1.77
内 アメリカ	18,800,825,578	69.58
内 オーストラリア	1,764,470,490	6.53
内 ニュージーランド	107,725,278	0.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	809,386,399	3.00
純資産総額	27,021,056,378	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)	811,373,733	3.00
内 ドイツ	260,502,858	0.96
内 アメリカ	550,870,875	2.04
為替予約取引(買建)	350,210,143	1.30
内 日本	350,210,143	1.30

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

(注2) 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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	134,422	15,102.58 2,030,119,950	15,123.81 2,032,973,998	7.52

2	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	142,500	11,325.81 1,613,939,691	11,024.71 1,571,022,030	5.81
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	13,498	89,033.20 1,201,771,950	88,294.59 1,191,800,497	4.41
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	23,242	38,562.62 896,272,414	37,498.36 871,537,023	3.23
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	91,354	8,268.00 755,321,659	8,496.78 776,214,931	2.87
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	48,158	15,586.94 750,635,953	15,568.36 749,741,274	2.77
7	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	140,284	4,468.00 626,790,175	4,300.80 603,334,409	2.23
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	68,868	9,176.20 631,951,451	8,735.64 601,606,124	2.23
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	42,282	14,431.12 610,176,827	13,442.51 568,376,208	2.10
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	20,571	22,663.83 466,217,709	21,583.65 443,997,367	1.64
11	GOODMAN GROUP	オーストラ リア	投資証券	274,378	1,673.52 459,199,033	1,555.83 426,885,771	1.58
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	21,844	20,239.40 442,109,541	19,268.04 420,891,066	1.56
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	49,799	8,437.06 420,157,450	7,940.76 395,442,306	1.46
14	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	19,700	20,372.10 401,330,449	19,773.62 389,540,452	1.44
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	58,803	6,024.58 354,263,378	6,045.81 355,511,883	1.32
16	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	16,983	21,486.78 364,910,053	20,932.09 355,489,820	1.32
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	18,143	19,216.28 348,641,095	19,218.94 348,689,247	1.29
18	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	85,302	4,235.78 361,320,847	3,984.98 339,926,849	1.26
19	LINK REIT	香港	投資証券	337,000	895.25 301,699,924	966.73 325,790,032	1.21
20	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	30,533	10,379.79 316,926,250	10,414.29 317,979,700	1.18
21	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	42,755	7,147.22 305,579,477	6,652.25 284,416,992	1.05

22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	9,581	28,462.82 272,702,307	28,433.62 272,422,599	1.01
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	79,379	3,402.42 270,081,332	3,344.04 265,446,551	0.98
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	37,584	6,843.33 257,200,053	6,904.38 259,494,256	0.96
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	90,987	3,014.94 274,320,710	2,807.93 255,485,309	0.95
26	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	15,672	15,625.42 244,881,661	14,987.13 234,878,427	0.87
27	UDR INC	アメリカ	投資証券	44,932	5,407.52 242,970,913	5,163.35 231,999,957	0.86
28	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	186,572	1,293.44 241,319,686	1,238.40 231,050,765	0.86
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	25,715	8,682.56 223,272,056	8,667.96 222,896,694	0.82
30	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	105,170	2,476.18 260,420,061	2,097.98 220,645,293	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
株式	0.03%
投資信託受益証券	5.81%
投資証券	91.16%
合計	97.00%

(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
不動産	0.03%
合計	0.03%

(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
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 23	買建	125	565,867,966	550,870,875	2.04%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 23	買建	310	265,599,810	260,502,858	0.96%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年1 月	買建	1,803,000	246,253,254	238,832,411	0.88%
		ユーロ買/円売 2023年1 月	買建	788,000	112,770,922	111,377,732	0.41%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2022年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	14,185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	-6.3%
3カ月間	-0.4%
6カ月間	-8.8%
1年間	-13.1%
3年間	12.8%
5年間	24.8%
設定来	41.9%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6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。

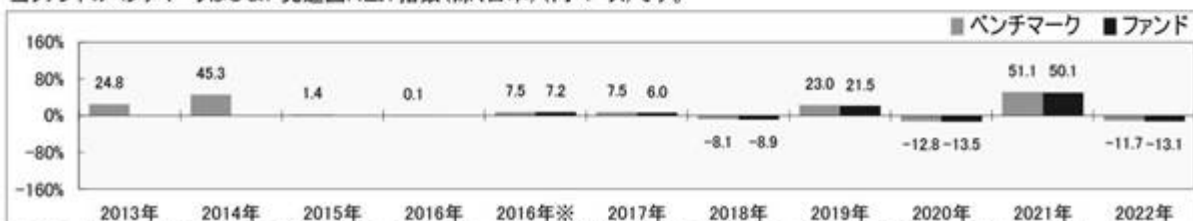
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	323	94.1%	米ドル	77.3%	商業施設	18.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	7.5%
外国投資信託等	4	5.9%	豪ドル	6.6%	産業施設	15.6%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	5.8%
外国株式	1	0.0%	英ポンド	4.6%	住宅	13.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		3.0%	ユーロ	3.8%	特殊用途施設	11.6%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.2%
合計	328	-	シンガポール・ドル	3.5%	各種不動産	8.9%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成			カナダ・ドル	1.8%	ヘルスケア	7.9%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.8%
アメリカ		77.4%	香港ドル	1.5%	オフィス	6.5%	VICI PROPERTIES INC	特殊用途施設	アメリカ	2.2%
オーストラリア		6.5%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.5%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.2%
イギリス		4.3%	韓国ウォン	0.2%	ホテル/リゾート	2.6%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.1%
その他		11.7%	その他	0.2%	その他	0.0%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 23	-	アメリカ	2.0%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	91.1%	合計			35.2%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

※2016年※は設定日(9月26日)から年末、2022年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## (参考情報)ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	0.35%	0.34%	0.01%
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)	0.52%	0.46%	0.06%
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)	0.48%	0.45%	0.03%
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)	0.48%	0.45%	0.04%
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)	0.47%	0.43%	0.04%
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)	0.43%	0.42%	0.01%
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)	0.44%	0.42%	0.02%
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)	0.45%	0.43%	0.02%
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)	0.50%	0.43%	0.07%
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 日経225インデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	0.15%	0.15%	0.01%

※対象期間は2021年6月16日～2022年6月15日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。)を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 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（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW 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。

\*「FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FW 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わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等\*）があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

ファンド名	解約代金支払開始日
FW TOPIXインデックス	4営業日目
FW 日経225インデックス	
FW 日本債券インデックス	



FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	5営業日目
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）	
FW J - R E I Tインデックス	
FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）	
FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）	
FW 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。

\* 「FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FW 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
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	ニューヨーク証券取引所の休業日
FW 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
FW 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
FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） FW 外国R E I T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
-------	----

FW TOPIXインデックス FW 日経225インデックス FW 日本債券インデックス FW J-REITインデックス	申込受付日の基準価額
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	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。

\*「FW J-REITインデックス」は除きます。

#### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

#### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

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い合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

毎年6月16日から翌年6月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年9月26日から2017年6月15日までとします。

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

## (5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合(「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」を除きます。)、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

#### 信託約款の変更等

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

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

#### < 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップ 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	23,051,434	28,597,197
親投資信託受益証券	13,377,264,144	14,581,011,581
流動資産合計	13,400,315,578	14,609,608,778
資産合計	13,400,315,578	14,609,608,778
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	61,998	2,915,623
未払受託者報酬	1,401,093	1,563,840
未払委託者報酬	20,316,511	22,676,319
その他未払費用	350,191	390,874
流動負債合計	22,129,793	27,546,656
負債合計	22,129,793	27,546,656
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 8,307,899,565	1 9,440,492,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,070,286,220	5,141,570,050
（分配準備積立金）	2,577,642,091	2,093,542,475
元本等合計	13,378,185,785	14,582,062,122
純資産合計	13,378,185,785	14,582,062,122
負債純資産合計	13,400,315,578	14,609,608,778



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		67		4
有価証券売買等損益		3,336,884,392		558,352,563
営業収益合計		3,336,884,459		558,352,559
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,104		5,009
受託者報酬		2,675,672		3,077,764
委託者報酬		38,798,526		44,628,800
その他費用		668,872		769,276
営業費用合計		42,148,174		48,480,849
営業利益又は営業損失（ ）		3,294,736,285		606,833,408
経常利益又は経常損失（ ）		3,294,736,285		606,833,408
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,294,736,285		606,833,408
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（ ）		557,632,873		6,789,707
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,049,167,750		5,070,286,220
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,020,511,902		1,765,874,211
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,020,511,902		1,765,874,211
剰余金減少額又は欠損金増加額		736,496,844		1,094,546,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		736,496,844		1,094,546,680
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,070,286,220		5,141,570,050

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	9,121,901,905円	8,307,899,565円
期中追加設定元本額	2,257,267,174円	2,926,939,275円
期中一部解約元本額	3,071,269,514円	1,794,346,768円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,307,899,565口	9,440,492,072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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,233,509,299円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,492,648,375円)及び分配準備積立金(344,132,792円)より分配対象額は5,070,290,466円(1万口当たり6,102.98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(3,048,035,557円)及び分配準備積立金(2,093,542,475円)より分配対象額は5,141,578,032円(1万口当たり5,446.30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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,906,992,736	555,104,020
合計	2,906,992,736	555,104,020

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6103円 (16,103円)	1.5446円 (15,446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	11,370,096,367	14,581,011,581	
親投資信託受益証券 合計			14,581,011,581	
合計			14,581,011,581	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		9,333,778,781	8,230,806,548
株式	2 3	176,669,720,970	181,589,336,570
派生商品評価勘定		36,834,650	85,050
未収配当金		1,083,477,946	1,553,974,549
未収利息		255,932	266,286
前払金		-	113,100,000
その他未収収益	4	19,206,442	21,518,346
流動資産合計		187,143,274,721	191,509,087,349
資産合計		187,143,274,721	191,509,087,349
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,100	158,435,700
前受金		2,600,000	-
未払解約金		43,339,590	175,195,940
受入担保金		5,651,977,789	6,201,448,165
流動負債合計		5,697,918,479	6,535,079,805
負債合計		5,697,918,479	6,535,079,805
純資産の部			
元本等			
元本	1	136,188,256,579	144,235,597,142
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,257,099,663	40,738,410,402
元本等合計		181,445,356,242	184,974,007,544
純資産合計		181,445,356,242	184,974,007,544
負債純資産合計		187,143,274,721	191,509,087,349

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	141,769,254,313円	136,188,256,579円
期中追加設定元本額	23,223,708,925円	22,302,544,819円
期中一部解約元本額	28,804,706,659円	14,255,204,256円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス	3,007,921,668円	2,959,635,810円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	6,153,412,861円	5,194,200,289円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	927,296円	920,771円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	25,923,401円	23,273,435円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	511,513,581円	330,188,566円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,728,376円	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	761,667,628円	632,779,466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)	171,090,658円	349,235,167円
D-I's TOPIXイン デックス	31,725,000円	32,293,095円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	81,759,929円	197,307,863円
iFree TOPIXイン デックス	3,600,007,778円	5,757,358,366円
iFree 8資産バランス	2,950,735,005円	3,906,830,420円
iFree 年金バランス	365,291,756円	677,734,898円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,441,251,037円	68,636,503,469円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,833,165,324円	3,235,070,346円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,784,765,693円	4,563,138,048円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,584,315,339円	4,448,846,181円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,710,990,378円	6,458,323,592円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	46,852,838円	58,672,093円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	43,845,022円	64,569,771円



ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,110,959,581円	2,078,783,183円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,159,812円	11,942,293円
ダイワつみたてインデックス バランス50	8,324,391円	9,836,532円
ダイワつみたてインデックス バランス70	13,605,466円	24,153,161円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	- 円	163,023,260円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	117,698,161円	85,987,356円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	130,882,312円	97,123,951円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,575,175,983円	5,590,450,708円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	580,569,028円	510,036,783円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	82,764,931円	73,437,877円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	149,390,769円	117,645,774円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	165,602,078円	214,978,027円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,040,729,674円	11,370,096,367円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,252,508,305円	1,804,406,520円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,522,537,924円	3,235,449,119円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,218,784,836円	1,201,985,990円
ダイワライフスタイル25	158,924,191円	139,631,194円
ダイワライフスタイル50	608,100,800円	572,086,028円
ダイワライフスタイル75	500,068,324円	436,660,665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)	10,807,579,445円	8,949,205,532円

計	136,188,256,579円	144,235,597,142円
2. 期末日における受益権の総数	136,188,256,579口	144,235,597,142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 5,415,195,540円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 5,795,665,380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 971,440,000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 821,220,000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18,808,175円が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分21,154,630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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	28,152,441,149	19,044,812,219
合計	28,152,441,149	19,044,812,219

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年9月24日から2021年6月15日まで、及び2021年9月22日から2022年6月15日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	4,677,310,000	-	4,714,275,000	36,965,000	3,547,410,000	-	3,389,160,000	158,250,000
合計	4,677,310,000	-	4,714,275,000	36,965,000	3,547,410,000	-	3,389,160,000	158,250,000

(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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.3323円	1.2824円
(1万口当たり純資産額)	(13,323円)	(12,824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	3,400	3,295.00	11,203,000	
日本水産	96,400	531.00	51,188,400	
マルハニチロ	14,200	2,320.00	32,944,000	
雪国まいたけ	7,400	864.00	6,393,600	
カネコ種苗	2,900	1,628.00	4,721,200	
サカタのタネ	11,300	4,565.00	51,584,500	貸付株式数 4,400株
ホクト	7,900	1,900.00	15,010,000	貸付株式数 2,200株
ホクリヨウ	1,500	634.00	951,000	
ショーボンドHD	12,700	6,080.00	77,216,000	

ミライト・ホールディングス	32,700	1,618.00	52,908,600	
タマホーム	6,200	2,369.00	14,687,800	貸付株式数 2,400株
サンヨーホームズ	800	723.00	578,400	貸付株式数 400株
日本アクア	4,100	595.00	2,439,500	
ファーストコーポレーション	2,100	723.00	1,518,300	貸付株式数 700株
ベステラ	2,000	1,128.00	2,256,000	貸付株式数 800株
キャンディル	1,000	530.00	530,000	貸付株式数 600株
住石ホールディングス	17,500	186.00	3,255,000	
日鉄鉱業	2,100	5,550.00	11,655,000	
三井松島HLDGS	4,200	2,720.00	11,424,000	貸付株式数 1,600株
INPEX	363,900	1,662.00	604,801,800	貸付株式数 146,700株
石油資源開発	11,900	3,450.00	41,055,000	
K&Oエナジーグループ	4,200	1,560.00	6,552,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,900	930.00	1,767,000	
第一カッター興業	2,300	1,293.00	2,973,900	
明豊ファシリティワークス	3,200	619.00	1,980,800	貸付株式数 1,100株
安藤・間	47,600	822.00	39,127,200	
東急建設	27,900	612.00	17,074,800	
コムシスホールディングス	32,700	2,457.00	80,343,900	
ピーアールホールディングス	12,800	308.00	3,942,400	貸付株式数 4,900株
高松コンストラクションG P	6,100	2,047.00	12,486,700	
東建コーポレーション	2,800	7,650.00	21,420,000	貸付株式数 1,100株
ソネック	1,000	1,016.00	1,016,000	貸付株式数 300株
ヤマウラ	4,100	918.00	3,763,800	貸付株式数 1,700株
オリエンタル白石	33,600	239.00	8,030,400	
大成建設	63,500	4,000.00	254,000,000	
大林組	223,000	951.00	212,073,000	
清水建設	207,100	716.00	148,283,600	
飛島建設	5,900	999.00	5,894,100	
長谷工コーポレーション	65,200	1,559.00	101,646,800	
松井建設	8,100	665.00	5,386,500	貸付株式数 400株
銭高組	900	3,320.00	2,988,000	貸付株式数 300株
鹿島建設	163,300	1,438.00	234,825,400	
不動テトラ	5,000	1,556.00	7,780,000	
大末建設	2,400	1,538.00	3,691,200	

鉄建建設	4,600	1,800.00	8,280,000	
西松建設	14,200	4,215.00	59,853,000	貸付株式数 5,100株
三井住友建設	52,500	454.00	23,835,000	貸付株式数 400株
大豊建設	3,400	4,445.00	15,113,000	
佐田建設	4,700	447.00	2,100,900	貸付株式数 600株
ナカノフード建設	5,100	300.00	1,530,000	貸付株式数 1,500株
奥村組	12,200	2,913.00	35,538,600	
東鉄工業	9,800	2,269.00	22,236,200	
イチケン	1,600	1,814.00	2,902,400	
富士ピー・エス	2,700	465.00	1,255,500	貸付株式数 1,100株
浅沼組	2,600	5,280.00	13,728,000	貸付株式数 100株
戸田建設	92,200	705.00	65,001,000	
熊谷組	11,600	2,695.00	31,262,000	
北野建設	1,400	2,051.00	2,871,400	貸付株式数 400株
植木組	1,800	1,447.00	2,604,600	貸付株式数 700株
矢作建設	9,400	750.00	7,050,000	
ピーエス三菱	7,500	593.00	4,447,500	
日本ハウスHLDGS	15,700	390.00	6,123,000	貸付株式数 6,000株
大東建託	24,000	11,020.00	264,480,000	
新日本建設	9,700	720.00	6,984,000	
東亜道路	1,200	5,400.00	6,480,000	
日本道路	2,000	6,500.00	13,000,000	
東亜建設	5,400	2,384.00	12,873,600	
日本国土開発	19,400	509.00	9,874,600	
若築建設	3,600	2,131.00	7,671,600	
東洋建設	24,200	795.00	19,239,000	
五洋建設	88,600	630.00	55,818,000	貸付株式数 700株
世紀東急	11,100	799.00	8,868,900	
福田組	2,500	4,420.00	11,050,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	2,100	1,524.00	3,200,400	貸付株式数 200株
住友林業	54,200	1,955.00	105,961,000	
日本基礎技術	5,800	569.00	3,300,200	
巴コーポレーション	8,700	402.00	3,497,400	
大和ハウス	195,500	3,041.00	594,515,500	
ライト工業	13,300	1,789.00	23,793,700	
積水ハウス	232,700	2,333.00	542,889,100	
日特建設	4,600	781.00	3,592,600	
北陸電気工事	4,200	743.00	3,120,600	
ユアテック	13,200	702.00	9,266,400	
日本リーテック	4,500	1,031.00	4,639,500	

四電工	2,200	1,682.00	3,700,400	
中電工	9,800	2,077.00	20,354,600	
関電工	38,000	815.00	30,970,000	
きんでん	49,200	1,506.00	74,095,200	
東京エネシス	7,100	953.00	6,766,300	
トーエネック	2,300	3,215.00	7,394,500	
住友電設	5,700	2,482.00	14,147,400	
日本電設工業	10,900	1,585.00	17,276,500	
エクシオグループ	33,600	2,091.00	70,257,600	
新日本空調	5,400	1,820.00	9,828,000	貸付株式数 1,300株
日本工営	4,500	3,270.00	14,715,000	
九電工	15,900	2,668.00	42,421,200	
三機工業	15,200	1,474.00	22,404,800	
日揮ホールディングス	68,100	1,873.00	127,551,300	
中外炉工業	2,100	1,695.00	3,559,500	
ヤマト	5,700	743.00	4,235,100	
太平電業	4,500	2,721.00	12,244,500	
高砂熱学	19,000	1,595.00	30,305,000	
三晃金属	800	2,570.00	2,056,000	
NEC ネットズエスアイ	24,300	1,809.00	43,958,700	
朝日工業社	3,000	1,575.00	4,725,000	
明星工業	12,400	729.00	9,039,600	
大気社	10,300	3,075.00	31,672,500	
ダイダン	4,700	2,050.00	9,635,000	
日比谷総合設備	6,600	1,886.00	12,447,600	
ニッポン	19,400	1,559.00	30,244,600	
日清製粉G本社	75,100	1,499.00	112,574,900	
日東富士製粉	1,200	4,215.00	5,058,000	
昭和産業	6,400	2,413.00	15,443,200	
鳥越製粉	6,100	630.00	3,843,000	
中部飼料	8,100	989.00	8,010,900	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	9,400	650.00	6,110,000	
東洋精糖	1,500	950.00	1,425,000	貸付株式数 100株
日本甜菜糖	4,000	1,636.00	6,544,000	
DM三井製糖ホールディ	6,300	1,860.00	11,718,000	
塩水港精糖	9,300	208.00	1,934,400	貸付株式数 2,700株
日新製糖	3,800	1,724.00	6,551,200	
LIFULL	21,300	161.00	3,429,300	貸付株式数 8,600株
ミクシィ	16,200	2,169.00	35,137,800	

ジェイエシーリクルートメント	5,700	1,658.00	9,450,600	
日本M&Aセンターホールデ	116,900	1,331.00	155,593,900	
メンバーズ	1,900	2,628.00	4,993,200	
中広	1,100	382.00	420,200	貸付株式数 400株
UTグループ	10,300	2,300.00	23,690,000	
アイティメディア	3,400	1,553.00	5,280,200	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	4,100	1,142.00	4,682,200	貸付株式数 1,500株
夢真ビーネックスグループ	23,200	1,355.00	31,436,000	
コシダカホールディングス	19,200	764.00	14,668,800	貸付株式数 6,100株
アルトナー	1,800	832.00	1,497,600	
パソナグループ	7,700	1,868.00	14,383,600	
CDS	1,700	1,812.00	3,080,400	
リンクアンドモチベーション	15,700	424.00	6,656,800	貸付株式数 6,200株
エス・エム・エス	24,200	2,556.00	61,855,200	
サニーサイドアップG	2,500	560.00	1,400,000	貸付株式数 100株
パーソルホールディングス	71,300	2,267.00	161,637,100	
リニカル	3,900	762.00	2,971,800	
クックパッド	22,100	202.00	4,464,200	貸付株式数 5,200株
エスクリ	3,200	400.00	1,280,000	貸付株式数 1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	3,200	563.00	1,801,600	貸付株式数 1,200株
森永製菓	15,800	3,835.00	60,593,000	
中村屋	1,600	3,050.00	4,880,000	貸付株式数 600株
江崎グリコ	18,400	3,565.00	65,596,000	
名糖産業	3,000	1,608.00	4,824,000	貸付株式数 1,200株
井村屋グループ	3,900	2,204.00	8,595,600	貸付株式数 1,500株
不二家	4,400	2,265.00	9,966,000	
山崎製パン	49,200	1,482.00	72,914,400	
第一屋製パン	1,600	505.00	808,000	貸付株式数 400株
モロゾフ	2,300	3,385.00	7,785,500	
亀田製菓	4,000	4,485.00	17,940,000	
寿スピリッツ	6,700	7,120.00	47,704,000	
カルビー	34,000	2,391.00	81,294,000	
森永乳業	13,000	4,335.00	56,355,000	
六甲バター	5,200	1,390.00	7,228,000	貸付株式数 2,000株
ヤクルト	50,100	7,360.00	368,736,000	
明治ホールディングス	43,500	6,210.00	270,135,000	



雪印メグミルク	16,800	1,685.00	28,308,000	
プリマハム	9,400	2,100.00	19,740,000	
日本ハム	27,000	4,030.00	108,810,000	
林兼産業	2,700	486.00	1,312,200	貸付株式数 400株
丸大食品	7,000	1,481.00	10,367,000	
S Foods	6,700	3,010.00	20,167,000	貸付株式数 2,400株
柿安本店	2,400	2,347.00	5,632,800	貸付株式数 200株
伊藤ハム米久HLDGS	47,900	662.00	31,709,800	
学情	2,900	943.00	2,734,700	貸付株式数 200株
スタジオアリス	3,200	2,266.00	7,251,200	貸付株式数 1,100株
クロスキャット	3,800	981.00	3,727,800	貸付株式数 1,200株
シミックホールディングス	3,600	1,406.00	5,061,600	貸付株式数 1,400株
エプロ	1,600	726.00	1,161,600	貸付株式数 600株
システナ	104,600	412.00	43,095,200	
NJS	1,600	1,933.00	3,092,800	
デジタルアーツ	3,900	5,660.00	22,074,000	
日鉄ソリューションズ	12,000	3,530.00	42,360,000	
総合警備保障	26,800	3,520.00	94,336,000	
キューブシステム	3,600	895.00	3,222,000	貸付株式数 1,300株
いちご	81,400	286.00	23,280,400	
WOW WORLD	1,000	1,021.00	1,021,000	
日本駐車場開発	75,400	166.00	12,516,400	貸付株式数 29,400株
コア	3,000	1,395.00	4,185,000	貸付株式数 600株
カカクコム	52,300	2,155.00	112,706,500	
アイロムグループ	2,600	1,746.00	4,539,600	貸付株式数 900株
セントケア・ホールディング	4,600	799.00	3,675,400	
サイネックス	1,700	588.00	999,600	貸付株式数 200株
ルネサンス	4,900	921.00	4,512,900	貸付株式数 1,900株
ディップ	12,500	3,440.00	43,000,000	貸付株式数 4,000株
SBSホールディングス	5,500	2,655.00	14,602,500	
デジタルホールディングス	4,900	1,287.00	6,306,300	
新日本科学	8,700	1,910.00	16,617,000	貸付株式数 3,100株
キャリアデザインセンター	1,600	1,113.00	1,780,800	
ベネフィット・ワン	26,000	1,690.00	43,940,000	
エムスリー	125,700	3,566.00	448,246,200	
ツカダ・グローバルHOLD	4,400	323.00	1,421,200	貸付株式数 1,800株
プラス	900	848.00	763,200	貸付株式数 300株
アウトソーシング	40,800	1,061.00	43,288,800	

ウェルネット	6,400	486.00	3,110,400	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,800	2,299.00	6,437,200	貸付株式数	1,000株
ディー・エヌ・エー	27,100	1,728.00	46,828,800		
博報堂D Y H L D G S	93,200	1,176.00	109,603,200		
ぐるなび	10,900	402.00	4,381,800	貸付株式数	100株
タカミヤ	8,600	363.00	3,121,800		
ジャパンベストレスキュー S	4,300	764.00	3,285,200		
ファンコミュニケーションズ	16,600	388.00	6,440,800	貸付株式数	2,400株
ライク	2,400	2,060.00	4,944,000	貸付株式数	800株
ビジネス・ブレークスルー	2,000	414.00	828,000	貸付株式数	1,000株
エスプール	20,100	1,108.00	22,270,800		
W D B ホールディングス	3,200	2,184.00	6,988,800		
手間いらず	1,100	4,980.00	5,478,000	貸付株式数	400株
ティア	3,100	431.00	1,336,100	貸付株式数	500株
C D G	900	1,283.00	1,154,700	貸付株式数	200株
アドウェイズ	10,600	658.00	6,974,800	貸付株式数	4,200株
バリューコマース	5,600	2,963.00	16,592,800	貸付株式数	2,000株
インフォマート	78,300	378.00	29,597,400	貸付株式数	29,800株
サッポロホールディングス	23,100	2,764.00	63,848,400		
アサヒグループホールディ ン	160,400	4,223.00	677,369,200	貸付株式数	63,600株
キリンHD	275,000	2,033.00	559,075,000		
宝ホールディングス	44,700	950.00	42,465,000		
オエノンホールディングス	20,800	291.00	6,052,800		
養命酒	2,300	1,730.00	3,979,000		
コカ・コーラボトラーズJ HD	49,200	1,423.00	70,011,600		
サントリー食品インター	50,000	4,660.00	233,000,000	貸付株式数	18,000株
ダイドーグループHD	3,800	4,870.00	18,506,000	貸付株式数	1,500株
伊藤園	22,700	5,160.00	117,132,000		
キーコーヒー	6,900	2,058.00	14,200,200		
ユニカフェ	2,400	907.00	2,176,800	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	1,100	1,168.00	1,284,800	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,800	2,979.00	26,215,200		
不二製油グループ	16,100	1,867.00	30,058,700	貸付株式数	100株
かどや製油	800	3,450.00	2,760,000	貸付株式数	300株
J - オイルミルズ	7,200	1,503.00	10,821,600		
ローソン	16,300	4,285.00	69,845,500		

サンエー	5,100	3,955.00	20,170,500		
カワチ薬品	5,600	2,025.00	11,340,000	貸付株式数	300株
エービーシー・マート	11,400	5,730.00	65,322,000		
ハードオフコーポレーション	3,600	855.00	3,078,000		
高千穂交易	2,600	1,790.00	4,654,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	16,500	1,435.00	23,677,500	貸付株式数	4,800株 (100株)
ゲオホールディングス	9,100	1,199.00	10,910,900		
アダストリア	7,800	1,959.00	15,280,200	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,000	330.00	1,320,000	貸付株式数	1,700株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	398.00	278,600	貸付株式数	300株
オルパヘルスケアHLDGS	1,500	1,768.00	2,652,000	貸付株式数	400株
伊藤忠食品	1,600	4,705.00	7,528,000	貸付株式数	600株
くら寿司	7,600	2,906.00	22,085,600	貸付株式数	3,000株
キャンドウ	2,700	2,128.00	5,745,600	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,700	1,291.00	7,358,700		
アイケイ	2,400	515.00	1,236,000	貸付株式数	800株
パルグループHLDGS	6,500	1,743.00	11,329,500		
エディオン	33,500	1,177.00	39,429,500	貸付株式数	13,400株
あらた	5,500	3,775.00	20,762,500	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	14,700	619.00	9,099,300		
ワッツ	3,100	705.00	2,185,500	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,100	5,800.00	6,380,000		
ハローズ	3,300	2,941.00	9,705,300	貸付株式数	700株
J Pホールディングス	18,100	219.00	3,963,900	貸付株式数	1,200株
フジオフードG本社	5,800	1,345.00	7,801,000	貸付株式数	2,100株
あみやき亭	1,800	2,868.00	5,162,400	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,200	5,410.00	11,902,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,300	199.00	3,044,700		
フィールズ	6,400	996.00	6,374,400		
双日	77,200	2,028.00	156,561,600		
アルフレッサホールディングス	77,900	1,657.00	129,080,300		
大黒天物産	2,300	4,030.00	9,269,000	貸付株式数	800株 (200株)
ハニーズホールディングス	6,200	1,157.00	7,173,400	貸付株式数	2,100株
ファーマライズHD	1,700	700.00	1,190,000	貸付株式数	300株

キッコーマン	47,900	6,650.00	318,535,000	
味の素	153,300	3,044.00	466,645,200	
ブルドックソ - ス	2,800	1,806.00	5,056,800	貸付株式数 1,100株
キューピー	34,800	2,143.00	74,576,400	
ハウス食品G本社	24,800	2,703.00	67,034,400	
カゴメ	28,300	3,225.00	91,267,500	
焼津水産化工	3,400	902.00	3,066,800	貸付株式数 1,200株
アリアケジャパン	6,800	5,200.00	35,360,000	
ピエトロ	1,100	1,803.00	1,983,300	貸付株式数 300株
エバラ食品工業	1,700	2,950.00	5,015,000	貸付株式数 500株
やまみ	700	1,548.00	1,083,600	
ニチレイ	30,000	2,215.00	66,450,000	
横浜冷凍	18,100	835.00	15,113,500	貸付株式数 6,900株
東洋水産	34,200	4,825.00	165,015,000	貸付株式数 1,100株
イトアンドHLDGS	2,800	2,232.00	6,249,600	貸付株式数 1,000株
大冷	900	1,896.00	1,706,400	貸付株式数 300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,900	511.00	1,992,900	貸付株式数 1,500株
日清食品HD	25,700	8,430.00	216,651,000	
永谷園ホールディングス	3,400	1,950.00	6,630,000	貸付株式数 800株
一正蒲鉾	3,100	800.00	2,480,000	貸付株式数 1,100株
フジッコ	7,100	1,912.00	13,575,200	
ロックフィールド	7,600	1,366.00	10,381,600	貸付株式数 2,900株
日本たばこ産業	401,200	2,380.00	954,856,000	貸付株式数 144,800株
ケンコーマヨネーズ	4,000	1,396.00	5,584,000	
わらべや日洋HD	4,600	1,700.00	7,820,000	
なとり	4,400	1,963.00	8,637,200	貸付株式数 1,500株
イフジ産業	1,500	956.00	1,434,000	貸付株式数 200株
ピックルスコーポレーション	3,600	1,298.00	4,672,800	
ファーマフーズ	9,400	1,483.00	13,940,200	貸付株式数 3,700株
北の達人コーポ	26,700	200.00	5,340,000	貸付株式数 10,500株 (2,600株)
ユーグレナ	38,300	858.00	32,861,400	貸付株式数 15,100株
紀文食品	5,800	930.00	5,394,000	貸付株式数 100株
スター・マイカ・HLDGS	4,000	1,556.00	6,224,000	
SREホールディングス	1,900	1,819.00	3,456,100	貸付株式数 700株
ADワークスグループ	12,400	153.00	1,897,200	貸付株式数 5,300株
片倉工業	7,000	2,059.00	14,413,000	

グンゼ	4,500	3,635.00	16,357,500	貸付株式数	600株
ヒューリック	165,700	1,055.00	174,813,500	貸付株式数	63,100株
神栄	1,100	889.00	977,900	貸付株式数	200株
ラサ商事	3,200	955.00	3,056,000		
アルペン	5,500	1,960.00	10,780,000	貸付株式数	2,100株
ハブ	2,500	566.00	1,415,000	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	6,200	1,574.00	9,758,800	貸付株式数	2,400株
クオールホールディングス	9,000	1,269.00	11,421,000	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	9,200	1,285.00	11,822,000		
神戸物産	52,700	3,045.00	160,471,500	貸付株式数	20,200株
ソリトンシステムズ	3,700	1,211.00	4,480,700	貸付株式数	1,400株 (100株)
ジズホールディングス	4,200	4,035.00	16,947,000	貸付株式数	200株
ビックカメラ	43,100	1,095.00	47,194,500	貸付株式数	17,200株
DCMホールディングス	43,200	1,014.00	43,804,800		
ペッパーフードサービス	10,000	392.00	3,920,000	貸付株式数	4,000株
ハイパー	2,200	457.00	1,005,400	貸付株式数	600株
MonotaRO	92,800	1,785.00	165,648,000		
東京一番フーズ	2,200	589.00	1,295,800	貸付株式数	600株
DDホールディングス	3,900	619.00	2,414,100	貸付株式数	1,100株
あいホールディングス	10,400	1,585.00	16,484,000	貸付株式数	2,800株
ディービーエックス	2,900	1,007.00	2,920,300	貸付株式数	1,000株
きちりホールディングス	2,300	414.00	952,200	貸付株式数	500株
アークランドサービスHD	5,600	2,115.00	11,844,000	貸付株式数	2,100株
J. フロントリテイリング	83,700	1,113.00	93,158,100		
ドトール・日レスHD	12,000	1,527.00	18,324,000		
マツキヨココカラ&カンパニー	43,700	4,815.00	210,415,500		
ブロンコビリー	4,000	2,420.00	9,680,000	貸付株式数	1,500株
ZOZO	50,400	2,368.00	119,347,200		
トレジャー・ファクトリー	2,300	1,036.00	2,382,800	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	3,600	5,680.00	20,448,000	貸付株式数	1,400株 (100株)
三越伊勢丹HD	116,500	1,040.00	121,160,000		
東洋紡	29,600	1,020.00	30,192,000		
ユニチカ	21,200	230.00	4,876,000		
富士紡ホールディングス	3,100	3,320.00	10,292,000		
日清紡ホールディングス	42,600	1,064.00	45,326,400		
倉敷紡績	5,700	1,988.00	11,331,600		

ダイワボウHD	32,700	1,673.00	54,707,100	
シキボウ	3,300	882.00	2,910,600	
日東紡績	9,800	2,443.00	23,941,400	
トヨタ紡織	27,600	2,061.00	56,883,600	
マクニカ・富士エレHLDGS	17,500	2,763.00	48,352,500	
Hamee	2,700	1,020.00	2,754,000	貸付株式数 100株
マーケットエンタープライズ	800	1,025.00	820,000	貸付株式数 200株
ラクト・ジャパン	2,500	1,996.00	4,990,000	貸付株式数 900株 (400株)
ウエルシアHD	38,900	2,345.00	91,220,500	貸付株式数 300株
クリエイトSDH	10,800	2,689.00	29,041,200	貸付株式数 3,700株
グリムス	3,300	1,358.00	4,481,400	貸付株式数 1,200株
バイタルKSKHD	12,100	670.00	8,107,000	
八洲電機	4,700	947.00	4,450,900	貸付株式数 1,800株
メディアスホールディングス	4,500	969.00	4,360,500	貸付株式数 1,600株
レスターホールディングス	6,800	1,947.00	13,239,600	貸付株式数 1,600株
ジューテックHD	1,500	995.00	1,492,500	貸付株式数 600株
丸善CHI HD	10,600	384.00	4,070,400	貸付株式数 3,200株
大光	3,200	697.00	2,230,400	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,800	1,218.00	2,192,400	貸付株式数 700株
TOKAIホールディングス	35,600	858.00	30,544,800	
黒谷	1,900	585.00	1,111,500	貸付株式数 700株
ミサワ	1,600	612.00	979,200	貸付株式数 500株
ティーライフ	1,000	1,357.00	1,357,000	貸付株式数 300株
Cominix	2,800	718.00	2,010,400	貸付株式数 400株
エー・ピーホールディングス	1,500	450.00	675,000	貸付株式数 500株
三洋貿易	7,000	958.00	6,706,000	
チムニー	2,300	1,195.00	2,748,500	貸付株式数 900株
シュッピン	6,100	1,400.00	8,540,000	貸付株式数 2,200株
ビューティガレージ	1,200	2,434.00	2,920,800	貸付株式数 400株
オイシックス・ラ・大地	10,500	1,526.00	16,023,000	貸付株式数 4,100株
ウイン・パートナーズ	5,900	993.00	5,858,700	貸付株式数 2,000株
ネクステージ	14,900	2,054.00	30,604,600	
ジョイフル本田	21,900	1,570.00	34,383,000	貸付株式数 8,400株
鳥貴族ホールディングス	2,500	2,354.00	5,885,000	貸付株式数 900株

ホットランド	5,700	1,332.00	7,592,400	貸付株式数 2,200株 (1,800株)
すかいらーくHD	91,000	1,573.00	143,143,000	貸付株式数 35,800株
SFPホールディングス	3,700	1,515.00	5,605,500	貸付株式数 1,400株
綿半ホールディングス	5,400	1,290.00	6,966,000	貸付株式数 1,400株
日本毛織	19,300	947.00	18,277,100	貸付株式数 8,000株
ダイトウボウ	10,000	90.00	900,000	貸付株式数 4,400株
トーア紡コーポレーション	2,100	372.00	781,200	貸付株式数 500株
ダイドーリミテッド	7,700	135.00	1,039,500	貸付株式数 3,000株
ヨシックスホールディングス	1,500	2,368.00	3,552,000	貸付株式数 500株
ユナイテッド・スーパー マーケ	21,100	1,027.00	21,669,700	貸付株式数 8,200株
三栄建築設計	2,900	1,607.00	4,660,300	
野村不動産HLDS	38,200	3,215.00	122,813,000	
三重交通グループHD	14,800	482.00	7,133,600	貸付株式数 5,300株
サムティ	10,400	1,999.00	20,789,600	貸付株式数 3,700株
地主	4,600	1,970.00	9,062,000	貸付株式数 1,800株
プレサンスコーポレーショ ン	8,600	1,490.00	12,814,000	貸付株式数 900株
フィル・カンパニー	1,300	1,116.00	1,450,800	貸付株式数 400株
ハウスコム	900	973.00	875,700	貸付株式数 200株
JPMC	3,400	996.00	3,386,400	
サンセイランディック	1,700	874.00	1,485,800	貸付株式数 700株
エストラスト	1,100	547.00	601,700	
フージャースHD	9,300	793.00	7,374,900	貸付株式数 100株
オープンハウスグループ	23,400	5,100.00	119,340,000	
東急不動産HD	206,200	672.00	138,566,400	
飯田GHD	61,400	2,031.00	124,703,400	
イーグランド	1,000	1,411.00	1,411,000	
帝国繊維	7,700	1,542.00	11,873,400	貸付株式数 2,900株
日本コークス工業	62,700	125.00	7,837,500	
ゴルフダイジェスト・オン	3,800	1,420.00	5,396,000	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	1,700	909.00	1,545,300	貸付株式数 600株
B E E N O S	3,700	1,959.00	7,248,300	貸付株式数 100株
あさひ	6,400	1,283.00	8,211,200	貸付株式数 2,200株
日本調剤	4,500	1,259.00	5,665,500	貸付株式数 200株
コスモス薬品	7,400	11,580.00	85,692,000	貸付株式数 2,800株
シップヘルスケアHD	21,700	2,318.00	50,300,600	
トーエル	3,300	874.00	2,884,200	貸付株式数 1,200株

ソフトクリエイイトHD	3,200	3,760.00	12,032,000	
セブン&アイ・HLDGS	259,900	5,206.00	1,353,039,400	
クリエイイト・レストランツ・ホール	45,700	935.00	42,729,500	貸付株式数 15,900株 (1,600株)
明治電機工業	3,000	1,070.00	3,210,000	貸付株式数 600株
ツルハホールディングス	16,000	6,380.00	102,080,000	
デリカフーズHLDGS	3,000	520.00	1,560,000	貸付株式数 1,100株
スターティアホールディングス	1,700	715.00	1,215,500	貸付株式数 600株
サンマルクホールディングス	6,000	1,527.00	9,162,000	
フェリシモ	1,700	1,133.00	1,926,100	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	18,200	2,199.00	40,021,800	貸付株式数 6,800株 (200株)
帝人	65,900	1,384.00	91,205,600	
東レ	477,700	704.20	336,396,340	
クラレ	101,100	1,122.00	113,434,200	
旭化成	462,500	1,057.00	488,862,500	
TOKYO BASE	6,900	329.00	2,270,100	貸付株式数 2,700株
稲葉製作所	3,800	1,349.00	5,126,200	貸付株式数 1,500株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,295.00	6,919,500	
トーカロ	19,300	1,271.00	24,530,300	
アルファCO	2,300	954.00	2,194,200	貸付株式数 1,000株
SUMCO	118,900	2,021.00	240,296,900	貸付株式数 33,200株
川田テクノロジーズ	1,300	3,500.00	4,550,000	
RS TECHNOLOGIES	2,400	6,010.00	14,424,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,967.00	1,967,000	
信和	4,500	780.00	3,510,000	
ビーロット	4,700	485.00	2,279,500	
ファーストブラザーズ	1,700	849.00	1,443,300	貸付株式数 200株 (200株)
AND DOホールディングス	3,600	876.00	3,153,600	貸付株式数 1,400株
シーアールイー	2,500	1,583.00	3,957,500	貸付株式数 800株
プロパティエージェント	800	1,429.00	1,143,200	貸付株式数 400株
ケイアイスター不動産	3,300	4,365.00	14,404,500	
アグレ都市デザイン	1,200	1,435.00	1,722,000	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,500	3,260.00	4,890,000	貸付株式数 500株



ロードスターキャピタル	1,900	1,519.00	2,886,100	貸付株式数	700株
テンポイノベーション	1,900	821.00	1,559,900	貸付株式数	200株
グローバルリンクマネジメン ト	1,200	915.00	1,098,000	貸付株式数	300株
フェイスネットワーク	700	1,339.00	937,300		
住江織物	1,200	1,651.00	1,981,200	貸付株式数	500株
日本フェルト	4,400	415.00	1,826,000	貸付株式数	1,700株
イチカワ	700	1,378.00	964,600	貸付株式数	300株
エコナックホールディング ス	13,500	86.00	1,161,000	貸付株式数	4,600株
日東製網	700	1,328.00	929,600	貸付株式数	100株
芦森工業	1,500	1,023.00	1,534,500	貸付株式数	200株
アツギ	5,100	496.00	2,529,600		
ウイルプラスHLDGS	1,300	889.00	1,155,700	貸付株式数	400株
JMホールディングス	5,300	1,442.00	7,642,600		
コメダホールディングス	16,000	2,268.00	36,288,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	3,600	647.00	2,329,200	貸付株式数	1,100株
アレンザホールディングス	5,200	969.00	5,038,800	貸付株式数	2,000株
串カツ田中HLDGS	2,000	1,810.00	3,620,000	貸付株式数	700株
パロックジャパン	4,800	790.00	3,792,000	貸付株式数	1,900株
クスリのアオキHLDGS	6,800	5,060.00	34,408,000	貸付株式数	2,600株
ダイニック	2,300	662.00	1,522,600	貸付株式数	100株
共和レザー	3,600	575.00	2,070,000		
ピーバンドットコム	800	520.00	416,000	貸付株式数	300株
力の源HD	4,000	696.00	2,784,000	貸付株式数	1,500株
FOOD&LIFE CO MPAN	39,400	2,762.00	108,822,800		
アセンテック	2,500	640.00	1,600,000	貸付株式数	900株
セーレン	14,000	1,907.00	26,698,000	貸付株式数	5,500株
ソトー	2,500	833.00	2,082,500		
東海染工	500	1,142.00	571,000	貸付株式数	100株
小松マテーレ	11,200	1,259.00	14,100,800		
ワコールホールディングス	16,200	2,093.00	33,906,600		
ホギメディカル	9,400	2,846.00	26,752,400	貸付株式数	400株
クラウディアHLDGS	1,600	238.00	380,800		
TSIホールディングス	22,900	350.00	8,015,000	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,000	974.00	1,948,000	貸付株式数	800株
ワールド	9,500	1,266.00	12,027,000		
TIS	65,900	3,175.00	209,232,500		
JNSホールディングス	3,100	428.00	1,326,800	貸付株式数	1,100株

グリー	33,200	820.00	27,224,000	貸付株式数	16,200株
GMOベパボ	800	1,995.00	1,596,000	貸付株式数	300株
コーエーテクモHD	23,300	4,210.00	98,093,000		
三菱総合研究所	3,400	4,115.00	13,991,000		
ボルテージ	2,000	348.00	696,000	貸付株式数	800株
電算	600	2,238.00	1,342,800	貸付株式数	100株
AGS	2,800	736.00	2,060,800	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	6,100	620.00	3,782,000	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,200	1,037.00	6,429,400		
KLab	12,800	481.00	6,156,800		
ポルトゥウィンホール ディン	10,500	932.00	9,786,000		
ネクソン	166,200	2,932.00	487,298,400		
アイスタイル	18,600	229.00	4,259,400	貸付株式数	7,600株
エムアップホールディング ス	8,400	1,180.00	9,912,000		
エイチーム	4,600	716.00	3,293,600	貸付株式数	1,800株
エニグモ	8,100	518.00	4,195,800	貸付株式数	3,100株
テクノスジャパン	5,800	490.00	2,842,000	貸付株式数	100株
enish	5,100	314.00	1,601,400	貸付株式数	1,600株
コロプラ	24,000	625.00	15,000,000	貸付株式数	7,900株
オルトプラス	5,800	364.00	2,111,200	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	36,400	422.00	15,360,800	貸付株式数	12,800株
クロス・マーケティングG	2,800	801.00	2,242,800	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,300	1,577.00	5,204,100	貸付株式数	1,200株
システム情報	5,400	965.00	5,211,000	貸付株式数	2,000株
メディアドゥ	2,600	1,724.00	4,482,400	貸付株式数	100株
じげん	20,700	334.00	6,913,800		
ブイキューブ	7,500	954.00	7,155,000	貸付株式数	2,900株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	900	517.00	465,300	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	2,500	1,122.00	2,805,000	貸付株式数	900株
ディー・エル・イー	4,300	336.00	1,444,800		
フィックスターズ	7,200	951.00	6,847,200		
CARTA HOLDING GS	2,900	1,796.00	5,208,400	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,300	755.00	4,001,500	貸付株式数	2,000株 (1,800株)
セレス	2,700	1,156.00	3,121,200	貸付株式数	1,000株
SHIFT	4,300	17,390.00	74,777,000		

特種東海製紙	4,000	3,080.00	12,320,000	
ティーガイア	6,600	1,606.00	10,599,600	貸付株式数 2,300株
セック	1,000	2,425.00	2,425,000	貸付株式数 100株
テクマトリックス	12,400	1,592.00	19,740,800	貸付株式数 3,900株
プロシップ	2,300	1,410.00	3,243,000	貸付株式数 800株
ガンホー・オンライン・エンター	19,000	2,343.00	44,517,000	貸付株式数 7,300株
GMOペイメントゲートウェイ	14,200	9,090.00	129,078,000	
ザッパラス	2,600	388.00	1,008,800	
システムリサーチ	2,000	2,025.00	4,050,000	貸付株式数 700株
インターネットイニシアティブ	19,500	4,450.00	86,775,000	
さくらインターネット	7,700	542.00	4,173,400	貸付株式数 3,100株
ヴィンクス	2,000	1,114.00	2,228,000	
GMOグローバルサインHD	1,600	5,650.00	9,040,000	貸付株式数 600株
SRAホールディングス	3,500	2,794.00	9,779,000	
システムインテグレータ	1,900	479.00	910,100	貸付株式数 700株
朝日ネット	6,700	565.00	3,785,500	
eBASE	8,800	522.00	4,593,600	貸付株式数 300株
アバント	7,800	1,251.00	9,757,800	
アドソル日進	2,600	1,477.00	3,840,200	貸付株式数 1,000株
ODKソリューションズ	1,300	574.00	746,200	
フリービット	3,800	756.00	2,872,800	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
コムチュア	8,200	2,592.00	21,254,400	
サイバーコム	900	1,139.00	1,025,100	
アステリア	5,300	1,018.00	5,395,400	貸付株式数 1,900株
アイル	3,700	1,454.00	5,379,800	貸付株式数 1,400株
王子ホールディングス	289,800	563.00	163,157,400	
日本製紙	31,600	946.00	29,893,600	貸付株式数 12,200株
三菱製紙	8,100	297.00	2,405,700	
北越コーポレーション	44,900	679.00	30,487,100	
中越パルプ	2,400	896.00	2,150,400	貸付株式数 900株
巴川製紙	2,700	607.00	1,638,900	
大王製紙	32,500	1,376.00	44,720,000	
阿波製紙	1,000	308.00	308,000	貸付株式数 400株
マークラインズ	3,700	2,086.00	7,718,200	
メディカル・データ・ビジ	9,400	972.00	9,136,800	

g u m i	10,200	565.00	5,763,000	貸付株式数	4,000株
ショーケース	1,600	461.00	737,600	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,700	1,139.00	1,936,300	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,700	1,403.00	3,788,100	貸付株式数	1,000株
デジタル・インフォメーション	3,200	1,355.00	4,336,000		
P C Iホールディングス	3,000	961.00	2,883,000	貸付株式数	1,200株
パイプドHD	1,300	2,726.00	3,543,800	貸付株式数	500株
アイピーシー	900	454.00	408,600	貸付株式数	200株
ネオジャパン	2,000	1,071.00	2,142,000	貸付株式数	600株
P R T I M E S	1,600	1,986.00	3,177,600	貸付株式数	600株
ラクス	33,600	1,409.00	47,342,400		
ランドコンピュータ	1,300	891.00	1,158,300	貸付株式数	600株
ダブルスタンダード	2,200	1,804.00	3,968,800	貸付株式数	800株
オープンドア	4,400	1,734.00	7,629,600	貸付株式数	1,700株
マイネット	2,600	497.00	1,292,200	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,300	2,744.00	9,055,200		
ベネフィットジャパン	600	1,868.00	1,120,800	貸付株式数	200株
U B I C O Mホールディングス	1,900	2,239.00	4,254,100	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	9,200	520.00	4,784,000	貸付株式数	2,800株
ノムラシステムコーポレーション	3,500	234.00	819,000	貸付株式数	1,400株
レンゴー	61,000	710.00	43,310,000		
トーモク	3,800	1,498.00	5,692,400		
ザ・パック	5,000	2,149.00	10,745,000	貸付株式数	1,500株
チェンジ	14,700	1,842.00	27,077,400		
シンクロ・フード	4,000	332.00	1,328,000	貸付株式数	1,400株
オークネット	3,900	1,794.00	6,996,600	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,200	686.00	823,200	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,900	538.00	1,022,200	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	1,957.00	1,957,000	貸付株式数	500株
マクロミル	14,600	921.00	13,446,600		
ビーグリー	1,700	1,333.00	2,266,100		
オロ	2,300	1,654.00	3,804,200	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,200	1,650.00	3,630,000	貸付株式数	800株
テモナ	1,600	374.00	598,400	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	645.00	1,161,000	貸付株式数	500株
マネーフォワード	14,900	3,265.00	48,648,500	貸付株式数	4,100株

サインポスト	2,300	812.00	1,867,600	貸付株式数	900株
昭和電工	63,900	2,577.00	164,670,300		
住友化学	510,800	555.00	283,494,000		
住友精化	3,000	2,952.00	8,856,000	貸付株式数	400株
日産化学	35,300	6,710.00	236,863,000		
ラサ工業	2,600	1,932.00	5,023,200		
クレハ	5,400	10,490.00	56,646,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,500	4,530.00	11,325,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,211.00	5,570,600		
石原産業	12,600	1,109.00	13,973,400	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,800	1,415.00	2,547,000		
日本曹達	8,400	4,365.00	36,666,000	貸付株式数	900株
東ソー	95,300	1,787.00	170,301,100		
トクヤマ	22,300	1,813.00	40,429,900		
セントラル硝子	11,200	3,035.00	33,992,000	貸付株式数	100株
東亜合成	36,700	1,031.00	37,837,700		
大阪ソーダ	5,900	3,140.00	18,526,000	貸付株式数	2,500株
関東電化	14,100	917.00	12,929,700	貸付株式数	100株
デンカ	25,300	3,320.00	83,996,000		
イビデン	37,000	4,105.00	151,885,000		
信越化学	118,900	17,300.00	2,056,970,000		
日本カ-バイド	2,500	1,398.00	3,495,000		
電算システムHD	3,000	2,271.00	6,813,000		
堺化学	4,900	1,924.00	9,427,600	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,400	1,116.00	7,142,400	貸付株式数	2,400株
エア・ウォーター	61,900	1,697.00	105,044,300		
日本酸素HLDGS	63,400	2,425.00	153,745,000		
日本化学工業	2,100	2,091.00	4,391,100		
東邦アセチレン	1,600	1,148.00	1,836,800		
日本パ-カラヰジング	32,600	895.00	29,177,000		
高压ガス	11,000	648.00	7,128,000		
チタン工業	900	1,690.00	1,521,000	貸付株式数	300株
四国化成	8,700	1,239.00	10,779,300		
戸田工業	1,500	2,550.00	3,825,000	貸付株式数	600株
ステラケミファ	3,600	2,519.00	9,068,400	貸付株式数	1,200株
保土谷化学	2,100	3,850.00	8,085,000		
日本触媒	10,900	5,330.00	58,097,000		
大日精化	5,400	1,803.00	9,736,200		
カネカ	16,700	3,395.00	56,696,500		
協和キリン	79,200	2,822.00	223,502,400		

三菱瓦斯化学	60,900	2,097.00	127,707,300	
三井化学	60,000	3,150.00	189,000,000	
J S R	68,000	3,680.00	250,240,000	貸付株式数 25,600株
東京応化工業	11,200	6,990.00	78,288,000	
大阪有機化学	5,500	2,380.00	13,090,000	
三菱ケミカルH L D G S	464,600	801.80	372,516,280	
K H ネオケム	11,400	2,541.00	28,967,400	貸付株式数 4,300株
ダイセル	99,200	881.00	87,395,200	
住友ベ - クライト	10,700	4,530.00	48,471,000	
積水化学	145,400	1,829.00	265,936,600	
日本ゼオン	58,000	1,373.00	79,634,000	
アイカ工業	18,200	2,800.00	50,960,000	
U B E	34,400	2,088.00	71,827,200	
積水樹脂	10,300	1,675.00	17,252,500	
タキロンシーアイ	17,200	532.00	9,150,400	
旭有機材	4,500	2,104.00	9,468,000	
ニチバン	4,100	1,601.00	6,564,100	貸付株式数 1,500株
リケンテクノス	16,100	426.00	6,858,600	
大倉工業	3,200	1,715.00	5,488,000	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	14,700	407.00	5,982,900	
群栄化学	1,600	2,612.00	4,179,200	
タイガース ポリマー	7,500	430.00	3,225,000	貸付株式数 1,600株
ミライアル	2,300	1,834.00	4,218,200	
ダイキアクシス	2,700	733.00	1,979,100	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	17,300	497.00	8,598,100	
竹本容器	2,500	798.00	1,995,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,600	1,774.00	6,386,400	
恵和	2,000	4,005.00	8,010,000	
日本化薬	52,400	1,113.00	58,321,200	
カーリットホールディングス	6,200	709.00	4,395,800	貸付株式数 2,500株
ソルクシーズ	6,200	359.00	2,225,800	貸付株式数 2,300株
C L ホールディングス	1,500	971.00	1,456,500	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	26,500	609.00	16,138,500	
フェイス	1,900	640.00	1,216,000	貸付株式数 700株
プロトコーポレーション	7,900	942.00	7,441,800	貸付株式数 1,400株
ハイマックス	1,900	1,236.00	2,348,400	貸付株式数 600株
アミューズ	3,900	1,971.00	7,686,900	
野村総合研究所	132,000	3,645.00	481,140,000	
ドリームインキュベータ	2,100	2,145.00	4,504,500	貸付株式数 700株

サイバネットシステム	5,200	768.00	3,993,600	
クイック	4,600	1,397.00	6,426,200	
T A C	2,300	225.00	517,500	
C E ホールディングス	3,400	417.00	1,417,800	貸付株式数 1,400株
日本システム技術	1,300	2,403.00	3,123,900	
電通グループ	69,000	4,205.00	290,145,000	
インテージホールディングス	8,400	1,351.00	11,348,400	
テイクアンドギヴニーズ	3,300	1,487.00	4,907,100	
東邦システムサイエンス	1,600	884.00	1,414,400	貸付株式数 600株
びあ	2,300	3,280.00	7,544,000	貸付株式数 900株
イオンファンタジー	2,700	2,474.00	6,679,800	貸付株式数 1,000株
ソースネクスト	31,600	250.00	7,900,000	貸付株式数 12,100株
シーティーエス	8,000	785.00	6,280,000	貸付株式数 500株
ネクシーズグループ	2,300	527.00	1,212,100	貸付株式数 800株
インフォコム	8,000	2,077.00	16,616,000	
メディカルシステムネットワーク	6,700	405.00	2,713,500	
日本精化	5,100	2,000.00	10,200,000	貸付株式数 2,100株
扶桑化学工業	6,000	3,620.00	21,720,000	
トリケミカル	7,500	2,435.00	18,262,500	
シンプレクスHD	11,600	1,813.00	21,030,800	
HEROZ	2,100	906.00	1,902,600	貸付株式数 700株 (700株)
ラクスル	8,500	1,547.00	13,149,500	貸付株式数 3,300株
I P S	2,000	2,259.00	4,518,000	貸付株式数 700株
F I G	7,600	301.00	2,287,600	貸付株式数 1,900株
システムサポート	2,600	1,158.00	3,010,800	貸付株式数 1,000株
A D E K A	30,400	2,509.00	76,273,600	
日油	22,300	4,980.00	111,054,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,036.00	2,900,800	貸付株式数 900株
新日本理化	10,900	248.00	2,703,200	貸付株式数 800株
ハリマ化成グループ	5,000	755.00	3,775,000	
イーソル	4,500	541.00	2,434,500	貸付株式数 1,600株
アルテリア・ネットワークス	7,600	1,230.00	9,348,000	貸付株式数 100株
東海ソフト	1,100	953.00	1,048,300	貸付株式数 400株
ウイングアーク1ST	5,600	1,467.00	8,215,200	
ヒト・コミュニケーションズHD	1,700	1,484.00	2,522,800	貸付株式数 500株

サーバーワークス	1,300	2,022.00	2,628,600	貸付株式数	400株
東名	700	1,123.00	786,100	貸付株式数	100株
ヴィッツ	600	1,083.00	649,800		
トビラシステムズ	1,400	858.00	1,201,200	貸付株式数	500株
Sansan	24,200	898.00	21,731,600	貸付株式数	9,200株
Link-U	1,400	651.00	911,400	貸付株式数	500株
ギフトィ	6,200	1,052.00	6,522,400	貸付株式数	2,400株
花王	157,600	5,100.00	803,760,000		
第一工業製薬	2,600	2,125.00	5,525,000		
石原ケミカル	3,600	1,298.00	4,672,800		
日華化学	2,500	868.00	2,170,000	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,120.00	2,968,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,300	4,680.00	20,124,000		
ベース	1,200	5,740.00	6,888,000	貸付株式数	400株
JMDC	9,200	5,010.00	46,092,000	貸付株式数	3,500株
武田薬品	585,900	3,535.00	2,071,156,500		
アステラス製薬	637,300	1,995.00	1,271,413,500		
住友ファーマ	46,100	1,042.00	48,036,200		
塩野義製薬	88,900	6,493.00	577,227,700		
わかもと製薬	7,700	255.00	1,963,500	貸付株式数	3,000株
日本新薬	17,300	7,240.00	125,252,000		
中外製薬	233,200	3,380.00	788,216,000		
科研製薬	10,900	3,715.00	40,493,500	貸付株式数	500株
エーザイ	84,700	5,084.00	430,614,800		
理研ビタミン	6,700	1,590.00	10,653,000		
ロート製薬	36,400	3,460.00	125,944,000		
小野薬品	151,700	3,234.00	490,597,800		
久光製薬	17,100	3,315.00	56,686,500		
有機合成薬品	5,200	271.00	1,409,200		
持田製薬	8,600	3,065.00	26,359,000	貸付株式数	100株
参天製薬	133,000	978.00	130,074,000		
扶桑薬品	2,500	2,123.00	5,307,500		
日本ケミファ	900	1,889.00	1,700,100		
ツムラ	21,900	2,832.00	62,020,800		
日医工	21,800	351.00	7,651,800	貸付株式数	8,500株
テルモ	210,800	3,827.00	806,731,600		
HUグループHD	18,600	2,687.00	49,978,200		
キッセイ薬品工業	11,500	2,400.00	27,600,000		
生化学工業	13,000	790.00	10,270,000		
栄研化学	11,700	1,623.00	18,989,100		



日水製薬	2,900	1,710.00	4,959,000		
鳥居薬品	4,000	2,854.00	11,416,000		
J C R ファーマ	21,000	2,258.00	47,418,000		
東和薬品	10,700	2,240.00	23,968,000		
富士製薬工業	4,300	930.00	3,999,000		
ゼリア新薬工業	11,800	2,061.00	24,319,800	貸付株式数	4,900株
第一三共	555,800	3,081.00	1,712,419,800		
キョーリン製薬HD	13,900	1,676.00	23,296,400	貸付株式数	100株
大幸薬品	11,200	570.00	6,384,000	貸付株式数	4,400株
ダイト	4,700	2,680.00	12,596,000		
大塚ホールディングス	146,300	4,311.00	630,699,300		
大正製薬HD	15,100	4,895.00	73,914,500		
ペプチドリーム	39,200	1,318.00	51,665,600		
大日本塗料	8,400	735.00	6,174,000	貸付株式数	3,100株
日本ペイントHOLD	274,300	918.00	251,807,400		
関西ペイント	67,300	1,767.00	118,919,100		
神東塗料	6,800	152.00	1,033,600	貸付株式数	2,100株
中国塗料	16,200	853.00	13,818,600		
日本特殊塗料	4,600	966.00	4,443,600		
藤倉化成	8,700	474.00	4,123,800	貸付株式数	100株
太陽ホールディングス	10,600	2,952.00	31,291,200		
D I C	27,800	2,505.00	69,639,000	貸付株式数	11,000株
サカタインクス	14,300	893.00	12,769,900	貸付株式数	5,300株
東洋インキSCホールディングン	14,200	1,943.00	27,590,600	貸付株式数	5,600株
T & K TOKA	5,900	797.00	4,702,300		
アルプス技研	5,900	1,801.00	10,625,900		
サニックス	12,300	213.00	2,619,900	貸付株式数	4,800株 (300株)
ダイオーズ	1,200	1,045.00	1,254,000	貸付株式数	400株
日本空調サービス	7,600	781.00	5,935,600		
オリエンタルランド	78,600	18,085.00	1,421,481,000		
フォーカスシステムズ	4,500	885.00	3,982,500	貸付株式数	1,600株
ダスキン	15,700	2,676.00	42,013,200		
パーク24	43,600	1,861.00	81,139,600	貸付株式数	5,500株
明光ネットワークジャパン	8,100	592.00	4,795,200	貸付株式数	3,000株
ファルコホールディングス	3,100	2,040.00	6,324,000	貸付株式数	400株
クレスコ	5,300	1,949.00	10,329,700		
フジ・メディア・HD	66,600	1,120.00	74,592,000		
秀英予備校	2,200	430.00	946,000	貸付株式数	800株

田谷	1,600	561.00	897,600	貸付株式数	600株
ラウンドワン	19,900	1,575.00	31,342,500		
リゾートトラスト	31,000	2,064.00	63,984,000		
オービック	23,100	18,350.00	423,885,000		
ジャストシステム	10,400	3,715.00	38,636,000		
TDCソフト	6,000	1,004.00	6,024,000		
Zホールディングス	1,054,800	396.50	418,228,200		
ビー・エム・エル	9,000	3,435.00	30,915,000		
トレンドマイクロ	37,000	6,570.00	243,090,000		
りらいあコミュニケーション	10,500	1,042.00	10,941,000		
IDホールディングス	4,200	823.00	3,456,600		
リソー教育	32,700	316.00	10,333,200	貸付株式数	200株
日本オラクル	11,900	7,370.00	87,703,000		
早稲田アカデミー	3,700	1,126.00	4,166,200	貸付株式数	400株
アルファシステムズ	1,900	4,155.00	7,894,500	貸付株式数	700株
フューチャー	15,500	1,539.00	23,854,500		
CAC HOLDINGS	3,800	1,392.00	5,289,600		
SBテクノロジー	3,200	2,211.00	7,075,200		
トーセ	2,300	743.00	1,708,900	貸付株式数	500株
ユー・エス・エス	79,700	2,355.00	187,693,500		
オービックビジネスC	7,000	4,245.00	29,715,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	33,400	3,145.00	105,043,000		
アイティフォー	8,700	768.00	6,681,600		
東京個別指導学院	6,200	595.00	3,689,000	貸付株式数	2,400株
東計電算	800	5,960.00	4,768,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	160,000	1,250.00	200,000,000	貸付株式数	64,600株
楽天グループ	342,400	649.00	222,217,600	貸付株式数	137,500株
エクスネット	700	998.00	698,600	貸付株式数	200株
クリーク・アンド・リバー社	3,700	1,876.00	6,941,200	貸付株式数	1,300株
モーニングスター	12,500	499.00	6,237,500	貸付株式数	4,800株
テー・オー・ダブリュー	13,500	324.00	4,374,000	貸付株式数	4,200株
大塚商会	39,600	3,845.00	152,262,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,900	950.00	9,405,000		
山田コンサルティンググループ	3,700	1,100.00	4,070,000	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,600	2,389.00	6,211,400	貸付株式数	1,000株
パラカ	1,900	1,717.00	3,262,300	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	9,600	3,715.00	35,664,000	貸付株式数	3,800株
ACCESS	8,200	692.00	5,674,400	貸付株式数	2,400株
デジタルガレージ	12,100	3,775.00	45,677,500	貸付株式数	4,400株

イーエムシステムズ	12,100	956.00	11,567,600	貸付株式数	3,500株
ウェザーニューズ	2,300	6,030.00	13,869,000		
C I J	5,200	759.00	3,946,800		
ビジネスエンジニアリング	1,600	2,022.00	3,235,200	貸付株式数	600株
日本エンタープライズ	6,700	157.00	1,051,900	貸付株式数	400株
WOWOW	3,500	1,463.00	5,120,500	貸付株式数	400株
スカラ	6,100	754.00	4,599,400		
インテリジェント ウェイ ブ	3,300	803.00	2,649,900	貸付株式数	1,300株
フルキャストホールディング クス	6,000	2,101.00	12,606,000		
エン・ジャパン	12,300	1,707.00	20,996,100		
あすか製薬HD	7,500	965.00	7,237,500		
サワイグループHD	14,900	3,820.00	56,918,000		
富士フイルムHLDGS	131,000	6,919.00	906,389,000		
コニカミノルタ	155,000	460.00	71,300,000		
資 生 堂	138,900	5,091.00	707,139,900		
ライオン	79,000	1,394.00	110,126,000	貸付株式数	32,500株
高砂香料	4,500	2,367.00	10,651,500		
マンダム	14,800	1,432.00	21,193,600		
ミルボン	9,200	4,930.00	45,356,000	貸付株式数	2,200株
ファンケル	30,200	2,213.00	66,832,600		
コーセー	14,000	11,400.00	159,600,000		
コタ	5,300	1,434.00	7,600,200		
シーボン	1,000	1,682.00	1,682,000	貸付株式数	300株
ポーラ・オルビスHD	31,800	1,512.00	48,081,600	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,700	5,480.00	31,236,000		
アジュバンホールディング	1,800	954.00	1,717,200	貸付株式数	600株
新日本製薬	3,000	1,348.00	4,044,000	貸付株式数	1,200株 (500株)
エステー	4,900	1,450.00	7,105,000		
アグロカネショウ	2,500	1,239.00	3,097,500	貸付株式数	700株
コ ニ シ	12,200	1,528.00	18,641,600		
長谷川香料	12,700	2,405.00	30,543,500	貸付株式数	500株
星光PMC	4,400	556.00	2,446,400		
小林製薬	20,900	7,970.00	166,573,000		
荒川化学工業	5,600	996.00	5,577,600	貸付株式数	1,800株
メック	5,200	2,469.00	12,838,800		
日本高純度化学	1,900	2,304.00	4,377,600		
タカラバイオ	19,500	1,847.00	36,016,500		

J C U	7,800	3,395.00	26,481,000	
新田ゼラチン	4,300	602.00	2,588,600	貸付株式数 900株
O A T アグリオ	3,000	1,668.00	5,004,000	
デクセリアルズ	19,400	4,055.00	78,667,000	
アース製薬	6,100	4,990.00	30,439,000	
北興化学	6,500	1,029.00	6,688,500	
大成ラミック	2,000	2,609.00	5,218,000	
クミアイ化学	27,500	1,148.00	31,570,000	
日本農薬	13,200	734.00	9,688,800	
富士興産	1,800	1,097.00	1,974,600	
ニチレキ	8,500	1,303.00	11,075,500	
ユシロ化学	3,500	965.00	3,377,500	
ビーピー・カストロール	2,600	1,190.00	3,094,000	
富士石油	17,400	327.00	5,689,800	
M O R E S C O	2,600	1,227.00	3,190,200	
出光興産	78,200	3,550.00	277,610,000	
E N E O S ホールディングス	1,122,000	538.70	604,421,400	
コスモエネルギーH L D G S	26,800	3,790.00	101,572,000	
テスホールディングス	6,500	1,196.00	7,774,000	貸付株式数 2,500株
インフロニアH D	90,700	910.00	82,537,000	
横浜ゴム	37,900	1,722.00	65,263,800	
T O Y O T I R E	36,800	1,710.00	62,928,000	
ブリヂストン	203,800	5,065.00	1,032,247,000	
住友ゴム	62,900	1,190.00	74,851,000	
藤倉コンポジット	6,500	847.00	5,505,500	貸付株式数 2,400株
オカモト	4,300	3,795.00	16,318,500	
アキレス	5,200	1,343.00	6,983,600	貸付株式数 500株
フ コ ク	2,900	947.00	2,746,300	
ニッタ	8,000	2,845.00	22,760,000	
クリエートメディック	3,000	978.00	2,934,000	貸付株式数 700株
住友理工	16,200	573.00	9,282,600	
三ツ星ベルト	9,200	2,790.00	25,668,000	
バンドー化学	13,900	913.00	12,690,700	貸付株式数 100株
A G C	65,000	5,030.00	326,950,000	
日本板硝子	34,500	387.00	13,351,500	
石塚硝子	1,400	1,652.00	2,312,800	貸付株式数 400株
有沢製作所	10,200	1,084.00	11,056,800	貸付株式数 1,100株
日本山村硝子	1,900	695.00	1,320,500	

日本電気硝子	28,400	2,767.00	78,582,800	
オハラ	2,900	1,188.00	3,445,200	貸付株式数 1,100株 (100株)
住友大阪セメント	12,600	3,585.00	45,171,000	
太平洋セメント	42,400	2,059.00	87,301,600	
リソルホールディングス	700	4,500.00	3,150,000	貸付株式数 300株
日本ヒューム	6,000	661.00	3,966,000	
日本コンクリート	13,300	281.00	3,737,300	貸付株式数 100株
三谷セキサン	3,200	4,325.00	13,840,000	
アジアパイルHD	9,800	447.00	4,380,600	
東海カーボン	59,100	1,163.00	68,733,300	
日本カーボン	3,800	4,235.00	16,093,000	
東洋炭素	4,900	2,704.00	13,249,600	
ノリタケ	3,900	4,140.00	16,146,000	
TOTO	47,900	4,265.00	204,293,500	
日本碍子	76,000	1,894.00	143,944,000	
日本特殊陶業	53,500	2,571.00	137,548,500	
ダントーホールディングス	4,800	258.00	1,238,400	貸付株式数 1,800株
MARUWA	2,600	14,900.00	38,740,000	
品川リフラクトリーズ	1,700	3,525.00	5,992,500	
黒崎播磨	1,200	4,225.00	5,070,000	
ヨータイ	4,600	1,387.00	6,380,200	
東京窯業	6,700	272.00	1,822,400	貸付株式数 1,800株
ニッカトー	2,800	474.00	1,327,200	貸付株式数 1,300株
フジインコーポレーテッド	6,000	5,660.00	33,960,000	
クニミネ工業	2,000	913.00	1,826,000	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	500	863.00	431,500	貸付株式数 300株
ニチアス	16,300	2,296.00	37,424,800	貸付株式数 800株
日本製鉄	315,400	2,015.00	635,531,000	
神戸製鋼所	131,700	658.00	86,658,600	
中山製鋼所	10,400	419.00	4,357,600	
合同製鉄	3,600	1,311.00	4,719,600	
JFEホールディングス	180,300	1,512.00	272,613,600	
東京製鉄	22,700	1,529.00	34,708,300	
共英製鋼	7,500	1,301.00	9,757,500	
大和工業	12,500	4,410.00	55,125,000	貸付株式数 100株
東京製鋼	2,900	1,210.00	3,509,000	貸付株式数 1,100株
大阪製鉄	3,800	1,421.00	5,399,800	
淀川製鋼所	8,600	2,209.00	18,997,400	貸付株式数 400株

丸一鋼管	22,000	2,900.00	63,800,000	
モリ工業	1,900	2,412.00	4,582,800	
大同特殊鋼	10,600	3,515.00	37,259,000	
日本高周波	2,000	338.00	676,000	貸付株式数 800株
日本冶金工	5,100	2,134.00	10,883,400	
山陽特殊製鋼	6,700	2,000.00	13,400,000	
愛知製鋼	4,100	2,038.00	8,355,800	
日立金属	71,500	1,990.00	142,285,000	
日本金属	1,800	1,104.00	1,987,200	貸付株式数 600株
大太平洋金属	4,500	2,638.00	11,871,000	
新日本電工	42,900	357.00	15,315,300	
栗本鉄工所	2,900	1,617.00	4,689,300	
虹 技	700	970.00	679,000	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	800	1,000.00	800,000	貸付株式数 200株
日本製鋼所	19,800	3,085.00	61,083,000	
三菱製鋼	4,700	951.00	4,469,700	
日亜鋼業	7,600	256.00	1,945,600	
日本精線	1,200	4,165.00	4,998,000	貸付株式数 300株
エンビプロHD	4,900	862.00	4,223,800	貸付株式数 1,900株
大紀アルミニウム	9,800	1,233.00	12,083,400	
日本軽金属HD	18,700	1,526.00	28,536,200	
三井金属	19,900	3,270.00	65,073,000	
東邦亜鉛	3,900	2,289.00	8,927,100	
三菱マテリアル	44,700	1,977.00	88,371,900	
住友鉱山	85,300	4,893.00	417,372,900	
DOWAホールディングス	18,200	4,555.00	82,901,000	
古河機金	11,100	1,218.00	13,519,800	
エス・サイエンス	33,300	28.00	932,400	貸付株式数 9,700株
大阪チタニウム	8,500	2,510.00	21,335,000	貸付株式数 3,300株
東邦チタニウム	13,200	2,470.00	32,604,000	貸付株式数 5,100株
UACJ	10,500	2,134.00	22,407,000	
CKサンエツ	1,400	3,875.00	5,425,000	貸付株式数 500株
古河電工	22,000	2,232.00	49,104,000	
住友電工	263,300	1,453.50	382,706,550	
フジクラ	82,300	805.00	66,251,500	
昭和電線HLDGS	6,400	1,709.00	10,937,600	貸付株式数 100株
東京特殊電線	900	2,301.00	2,070,900	貸付株式数 400株
タツタ電線	12,700	474.00	6,019,800	
カナレ電気	1,100	1,611.00	1,772,100	貸付株式数 400株
平河ビューテック	3,800	1,081.00	4,107,800	貸付株式数 1,400株

リョービ	7,700	1,060.00	8,162,000	
アーレステイ	7,400	366.00	2,708,400	
アサヒHD	29,500	2,031.00	59,914,500	
東洋製罐グループHD	40,700	1,368.00	55,677,600	
ホッカンホールディングス	5,000	1,208.00	6,040,000	貸付株式数 1,400株
コロナ	3,600	820.00	2,952,000	
横河ブリッジHLDGS	11,300	1,965.00	22,204,500	
駒井ハルテック	1,200	1,687.00	2,024,400	
高田機工	500	2,476.00	1,238,000	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	69,700	1,248.00	86,985,600	
文化シャツタ-	22,100	971.00	21,459,100	貸付株式数 8,500株
三協立山	9,500	579.00	5,500,500	
アルインコ	4,700	841.00	3,952,700	貸付株式数 1,800株
東洋シャツタ-	1,600	621.00	993,600	
LIXIL	116,100	2,533.00	294,081,300	
日本ファイルコン	7,100	495.00	3,514,500	貸付株式数 2,100株
ノーリツ	12,600	1,472.00	18,547,200	
長府製作所	7,300	1,740.00	12,702,000	
リンナイ	13,200	8,980.00	118,536,000	
ユニプレス	11,800	913.00	10,773,400	
ダイニチ工業	3,500	620.00	2,170,000	貸付株式数 1,300株
日東精工	9,800	483.00	4,733,400	
三洋工業	900	1,703.00	1,532,700	貸付株式数 100株
岡部	11,600	621.00	7,203,600	
ジーテクト	8,300	1,280.00	10,624,000	
東プレ	12,000	1,032.00	12,384,000	
高周波熱錬	12,100	666.00	8,058,600	
東京製綱	4,500	890.00	4,005,000	
サンコール	6,000	623.00	3,738,000	
モリテックスチル	5,800	288.00	1,670,400	貸付株式数 2,100株
パイオラックス	9,800	1,948.00	19,090,400	
エイチワン	6,300	590.00	3,717,000	
日本発条	63,300	935.00	59,185,500	貸付株式数 100株
中央発條	4,700	684.00	3,214,800	
アドバネクス	1,200	1,300.00	1,560,000	
三浦工業	29,800	2,633.00	78,463,400	
タクマ	22,100	1,366.00	30,188,600	
テクノプロ・ホールディング	42,700	2,670.00	114,009,000	貸付株式数 15,700株
アトラグループ	1,900	200.00	380,000	貸付株式数 600株

インターワークス	2,000	370.00	740,000	貸付株式数	500株
アイ・アールジャパンHD	3,300	1,991.00	6,570,300	貸付株式数	1,300株
K e e P e r 技研	4,600	3,210.00	14,766,000		
ファーストロジック	1,300	810.00	1,053,000	貸付株式数	500株
三機サービス	1,100	1,025.00	1,127,500	貸付株式数	400株
G u n o s y	3,900	916.00	3,572,400	貸付株式数	1,500株
デザインワン・ジャパン	2,300	176.00	404,800	貸付株式数	700株
イー・ガーディアン	2,600	2,810.00	7,306,000		
リブセンス	4,100	164.00	672,400	貸付株式数	2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	21,900	1,869.00	40,931,100		
ベクトル	10,000	998.00	9,980,000	貸付株式数	3,600株
ウチヤマホールディングス	2,800	291.00	814,800	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレーション	5,300	967.00	5,125,100	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,600	1,903.00	4,947,800	貸付株式数	1,000株
I B J	6,000	696.00	4,176,000	貸付株式数	2,300株
アサンテ	3,100	1,500.00	4,650,000	貸付株式数	1,000株
バリューHR	6,000	1,230.00	7,380,000	貸付株式数	2,100株
M & A キャピタルパートナー	5,900	3,065.00	18,083,500	貸付株式数	300株
ライドオンエクスプレスHD	2,800	1,162.00	3,253,600	貸付株式数	1,000株
E R I ホールディングス	2,000	1,422.00	2,844,000		
アビスト	1,100	2,803.00	3,083,300	貸付株式数	400株 (300株)
シグマクシス・ホールディング	8,500	978.00	8,313,000		
ウィルグループ	5,200	1,063.00	5,527,600		
エスクローAJ	8,400	167.00	1,402,800	貸付株式数	3,300株
メドピア	5,200	1,859.00	9,666,800	貸付株式数	1,200株
レアジョブ	1,300	539.00	700,700	貸付株式数	100株
リクルートホールディングス	523,400	4,017.00	2,102,497,800		
エラン	9,900	992.00	9,820,800		
ツガミ	15,700	1,146.00	17,992,200		
オークマ	7,700	5,380.00	41,426,000		
芝浦機械	8,300	2,833.00	23,513,900		
アマダ	115,500	1,039.00	120,004,500		
アイダエンジニア	17,900	903.00	16,163,700		



滝澤鉄工所	2,700	1,193.00	3,221,100	
F U J I	30,700	2,058.00	63,180,600	
牧野フライス	7,700	4,445.00	34,226,500	貸付株式数 100株
オーエスジー	32,700	1,606.00	52,516,200	
ダイジェット	1,300	918.00	1,193,400	
旭ダイヤモンド	19,300	599.00	11,560,700	
D M G 森精機	41,400	1,842.00	76,258,800	
ソディック	17,100	808.00	13,816,800	
ディスコ	10,900	31,850.00	347,165,000	
日東工器	4,600	1,499.00	6,895,400	
日進工具	6,100	1,242.00	7,576,200	
パンチ工業	6,900	461.00	3,180,900	
富士ダイス	5,300	649.00	3,439,700	
土木管理総合試験	3,500	324.00	1,134,000	
ネットマーケティング	3,500	633.00	2,215,500	貸付株式数 1,200株
日本郵政	852,700	964.80	822,684,960	
ベルシステム24HLDGS	10,200	1,365.00	13,923,000	
鎌倉新書	8,100	498.00	4,033,800	貸付株式数 3,200株
S M N	1,600	600.00	960,000	貸付株式数 500株
一蔵	700	506.00	354,200	貸付株式数 300株
グローバルキッズCOMP	1,000	671.00	671,000	
エアトリ	4,300	2,550.00	10,965,000	貸付株式数 1,600株
アトラエ	5,000	1,728.00	8,640,000	
ストライク	3,000	3,370.00	10,110,000	
ソラスト	17,700	649.00	11,487,300	
セラク	2,300	1,051.00	2,417,300	貸付株式数 800株
インソース	7,600	1,990.00	15,124,000	貸付株式数 2,700株
豊田自動織機	55,300	8,220.00	454,566,000	
豊和工業	4,700	975.00	4,582,500	貸付株式数 1,500株
O K K	2,800	1,016.00	2,844,800	貸付株式数 1,100株
石川製作所	2,200	1,740.00	3,828,000	貸付株式数 700株
東洋機械金属	5,500	576.00	3,168,000	貸付株式数 700株
津田駒工業	2,000	559.00	1,118,000	貸付株式数 400株
エンシュウ	2,000	864.00	1,728,000	
島精機製作所	10,800	2,084.00	22,507,200	貸付株式数 1,100株
オプトラン	9,200	1,965.00	18,078,000	
N C ホールディングス	2,000	1,868.00	3,736,000	
イワキポンプ	5,200	919.00	4,778,800	
フリーユ	6,600	1,063.00	7,015,800	貸付株式数 900株

ヤマシンフィルタ	13,900	315.00	4,378,500	
日阪製作所	10,000	845.00	8,450,000	
やまびこ	12,900	1,173.00	15,131,700	
野村マイクロ・サイエンス	2,500	3,800.00	9,500,000	貸付株式数 900株
平田機工	3,300	4,100.00	13,530,000	
ペガサスミシン製造	7,800	589.00	4,594,200	
マルマエ	3,000	1,895.00	5,685,000	貸付株式数 1,200株 (900株)
タツモ	3,300	1,169.00	3,857,700	貸付株式数 1,300株
ナブテスコ	39,700	3,120.00	123,864,000	貸付株式数 15,100株
三井海洋開発	7,800	1,210.00	9,438,000	
レオン自動機	8,000	1,218.00	9,744,000	
S M C	21,700	60,730.00	1,317,841,000	
ホソカワミクロン	5,200	2,589.00	13,462,800	
ユニオンツール	3,000	3,525.00	10,575,000	貸付株式数 1,000株
オイレス工業	11,300	1,539.00	17,390,700	貸付株式数 3,900株
日精エーエスピー	2,800	3,390.00	9,492,000	
サト - ホールディングス	9,700	1,901.00	18,439,700	
技研製作所	6,500	3,160.00	20,540,000	
日本エアーテック	3,700	1,005.00	3,718,500	貸付株式数 1,300株
カワタ	2,600	1,013.00	2,633,800	
日精樹脂工業	5,400	893.00	4,822,200	
オカダアイヨン	2,200	1,462.00	3,216,400	貸付株式数 700株
ワイエイシーホールディングス	2,900	1,651.00	4,787,900	
小松製作所	337,700	3,302.00	1,115,085,400	
住友重機械	40,100	3,150.00	126,315,000	
日立建機	29,900	3,315.00	99,118,500	
日工	8,700	602.00	5,237,400	
巴工業	3,200	2,270.00	7,264,000	貸付株式数 1,200株
井関農機	6,100	1,217.00	7,423,700	
T O W A	6,400	1,764.00	11,289,600	貸付株式数 2,400株
丸山製作所	1,300	1,531.00	1,990,300	貸付株式数 300株
北川鉄工所	2,900	1,452.00	4,210,800	
シンニッタン	14,800	222.00	3,285,600	
ローツェ	3,700	9,410.00	34,817,000	
タカキタ	2,300	533.00	1,225,900	貸付株式数 900株
クボタ	361,200	2,208.50	797,710,200	
荏原実業	3,400	2,274.00	7,731,600	
東洋エンジニア	9,800	620.00	6,076,000	貸付株式数 3,700株

三菱化工機	2,200	2,046.00	4,501,200	
月島機械	12,400	897.00	11,122,800	貸付株式数 4,000株
帝国電機製作所	5,100	1,563.00	7,971,300	
東京機械	3,100	870.00	2,697,000	
新東工業	16,500	680.00	11,220,000	
渋谷工業	6,400	2,250.00	14,400,000	
アイチ コーポレーション	10,100	848.00	8,564,800	貸付株式数 100株
小森コーポレーション	18,500	795.00	14,707,500	
鶴見製作所	5,900	1,821.00	10,743,900	
住友精密	1,000	2,813.00	2,813,000	
日本ギア工業	8,700	269.00	2,340,300	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,200	2,923.00	3,507,600	
荏原製作所	29,600	5,460.00	161,616,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	700	2,817.00	1,971,900	貸付株式数 300株
西島製作所	6,800	1,365.00	9,282,000	
北越工業	6,200	814.00	5,046,800	
ダイキン工業	86,000	19,885.00	1,710,110,000	
オルガノ	2,100	9,720.00	20,412,000	
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,674.00	6,952,400	
栗田工業	38,600	5,030.00	194,158,000	
椿本チエイン	10,300	3,150.00	32,445,000	
大同工業	3,400	812.00	2,760,800	
日 機 装	20,100	855.00	17,185,500	
木村化工機	5,900	673.00	3,970,700	貸付株式数 2,300株
レイズネクスト	10,400	1,120.00	11,648,000	
アネスト岩田	12,300	867.00	10,664,100	貸付株式数 100株
ダイフク	37,100	7,580.00	281,218,000	
サムコ	1,900	2,532.00	4,810,800	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,100	809.00	2,507,900	
油研工業	1,600	1,747.00	2,795,200	貸付株式数 200株
タダノ	36,900	957.00	35,313,300	
フジテック	24,200	2,686.00	65,001,200	貸付株式数 9,100株
C K D	20,000	1,814.00	36,280,000	
キトー	5,800	2,615.00	15,167,000	
平和	20,700	1,915.00	39,640,500	
理想科学工業	6,000	2,230.00	13,380,000	
S A N K Y O	16,100	4,100.00	66,010,000	
日本金銭機械	7,400	657.00	4,861,800	貸付株式数 1,400株
マースグループH L D G S	4,700	1,696.00	7,971,200	
フクシマガリレイ	4,800	3,245.00	15,576,000	

オーイズミ	2,800	406.00	1,136,800	貸付株式数	700株
ダイコク電機	3,400	1,197.00	4,069,800	貸付株式数	1,000株
竹内製作所	11,400	2,411.00	27,485,400		
アマノ	19,500	2,430.00	47,385,000		
JUKI	10,400	705.00	7,332,000	貸付株式数	400株
サンデン	10,000	219.00	2,190,000	貸付株式数	2,000株
ジャノメ	6,100	688.00	4,196,800	貸付株式数	800株
ブラザー工業	86,300	2,378.00	205,221,400		
マックス	9,800	1,599.00	15,670,200		
モリタホールディングス	11,700	1,275.00	14,917,500		
グローリー	18,100	2,030.00	36,743,000		
新晃工業	6,900	1,612.00	11,122,800		
大和冷機工業	10,600	1,032.00	10,939,200		
セガサミーホールディングス	73,900	2,161.00	159,697,900		
日本ピストンリング	2,400	1,285.00	3,084,000		
リケン	2,800	2,330.00	6,524,000	貸付株式数	400株
TPR	8,800	1,230.00	10,824,000		
ツバキ・ナカシマ	16,400	965.00	15,826,000		
ホシザキ	21,800	7,720.00	168,296,000		
大豊工業	5,800	698.00	4,048,400		
日本精工	130,500	763.00	99,571,500		
NTN	146,700	280.00	41,076,000		
ジェイテクト	66,300	1,058.00	70,145,400		
不二越	5,900	3,640.00	21,476,000		
ミネベアミツミ	121,900	2,314.00	282,076,600		
日本トムソン	19,300	526.00	10,151,800		
THK	41,600	2,654.00	110,406,400	貸付株式数	10,000株
ユーシン精機	7,300	690.00	5,037,000		
前澤給装工業	5,000	870.00	4,350,000	貸付株式数	1,400株
イーグル工業	8,300	961.00	7,976,300		
前澤工業	4,900	593.00	2,905,700		
日本ピラ - 工業	6,900	2,737.00	18,885,300		
キッツ	24,900	676.00	16,832,400		
日立	358,600	6,675.00	2,393,655,000		
東芝	130,300	5,475.00	713,392,500		
三菱電機	712,600	1,405.50	1,001,559,300		
富士電機	42,700	5,780.00	246,806,000		
東洋電機製造	2,100	895.00	1,879,500		
安川電機	75,500	4,290.00	323,895,000		

シンフォニア テクノロ ジー	7,700	1,373.00	10,572,100	貸付株式数	3,200株
明電舎	11,300	1,984.00	22,419,200		
オリジン	1,600	1,215.00	1,944,000		
山洋電気	2,900	5,250.00	15,225,000		
デンヨー	5,500	1,545.00	8,497,500		
PHCホールディングス	11,400	1,298.00	14,797,200		
ベйкаレントコンサルティ ング	5,000	31,650.00	158,250,000		
ORCHESTRA HL DGS	1,400	2,505.00	3,507,000	貸付株式数	200株
アイモバイル	3,000	1,351.00	4,053,000	貸付株式数	500株
キャリアインデックス	2,400	461.00	1,106,400		
MS - J a p a n	2,900	873.00	2,531,700	貸付株式数	1,000株
船場	700	670.00	469,000		
ジャパンエレベーターSH D	22,600	1,300.00	29,380,000		
フルテック	1,100	1,311.00	1,442,100	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,500	624.00	1,560,000	貸付株式数	1,000株
ツナググループHLDGS	1,600	313.00	500,800	貸付株式数	300株
GAMEWITH	1,900	466.00	885,400	貸付株式数	600株
MS&CONSULTIN G	1,100	701.00	771,100	貸付株式数	200株
ウェルビー	4,700	739.00	3,473,300	貸付株式数	1,800株
エル・ティー・エス	900	3,470.00	3,123,000		
ミダックホールディングス	3,200	2,620.00	8,384,000	貸付株式数	1,200株
日総工産	5,600	556.00	3,113,600	貸付株式数	2,100株
キュービーネットHLDG S	3,300	1,273.00	4,200,900		
RPAホールディングス	10,000	375.00	3,750,000	貸付株式数	200株
三桜工業	10,400	645.00	6,708,000		
マキタ	85,700	3,467.00	297,121,900		
東芝テック	8,000	4,020.00	32,160,000		
芝浦メカトロニクス	1,300	11,050.00	14,365,000	貸付株式数	500株
マブチモーター	17,100	3,585.00	61,303,500		
日本電産	174,800	8,243.00	1,440,876,400		
ユーエムシーエレクトロニ クス	2,700	454.00	1,225,800	貸付株式数	1,000株
トレックス・セミコンダク ター	3,400	2,831.00	9,625,400	貸付株式数	1,300株

東光高岳	4,100	1,699.00	6,965,900	貸付株式数	1,600株
ダブル・スコープ	21,500	1,443.00	31,024,500	貸付株式数	8,300株 (100株)
宮越ホールディングス	2,800	850.00	2,380,000	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,300	4,210.00	30,733,000		
ヤーマン	12,100	1,399.00	16,927,900	貸付株式数	4,600株
JVCケンウッド	60,500	178.00	10,769,000		
ミマキエンジニアリング	6,500	520.00	3,380,000	貸付株式数	200株
I - P E X	3,400	1,342.00	4,562,800	貸付株式数	400株
日新電機	17,500	1,536.00	26,880,000		
大崎電気	12,400	488.00	6,051,200	貸付株式数	500株
オムロン	61,800	6,699.00	413,998,200		
日東工業	9,300	2,272.00	21,129,600	貸付株式数	100株
I D E C	9,200	2,643.00	24,315,600	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,100	1,081.00	2,270,100	貸付株式数	800株
不二電機工業	700	1,117.00	781,900	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ コーポ	23,100	2,113.00	48,810,300		
サクサホールディングス	1,700	1,384.00	2,352,800	貸付株式数	100株
メルコホールディングス	1,900	3,370.00	6,403,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	2,000	1,525.00	3,050,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリック H D	2,100	1,211.00	2,543,100	貸付株式数	800株
日本電気	90,600	5,110.00	462,966,000		
富士通	67,100	17,100.00	1,147,410,000		
沖電気	28,900	792.00	22,888,800		
岩崎通信機	3,200	813.00	2,601,600	貸付株式数	100株
電気興業	3,900	2,494.00	9,726,600		
サンケン電気	6,600	4,945.00	32,637,000		
ナカヨ	1,400	1,084.00	1,517,600	貸付株式数	100株
アイホン	3,600	1,705.00	6,138,000	貸付株式数	900株
ルネサスエレクトロニクス	405,200	1,340.00	542,968,000		
セイコーエプソン	86,300	2,168.00	187,098,400		
ワコム	57,900	837.00	48,462,300	貸付株式数	22,600株
アルバック	14,700	5,050.00	74,235,000		
アクセル	2,800	815.00	2,282,000	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,400	3,795.00	20,493,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	64.00	3,948,800		
日本信号	16,600	904.00	15,006,400		
京三製作所	14,400	422.00	6,076,800		
能美防災	8,900	1,682.00	14,969,800		

ホーチキ	4,600	1,239.00	5,699,400	
星和電機	3,200	467.00	1,494,400	貸付株式数 1,300株
エレコム	17,000	1,517.00	25,789,000	
パナソニックホールディング	795,200	1,105.50	879,093,600	
シャープ	75,600	1,026.00	77,565,600	貸付株式数 28,300株
アンリツ	47,600	1,468.00	69,876,800	貸付株式数 1,100株
富士通ゼネラル	20,200	2,395.00	48,379,000	
ソニーグループ	467,000	11,115.00	5,190,705,000	
T D K	108,000	4,385.00	473,580,000	
帝国通信工業	3,200	1,335.00	4,272,000	
タムラ製作所	27,400	559.00	15,316,600	貸付株式数 10,300株
アルプスアルパイン	62,600	1,457.00	91,208,200	
池上通信機	2,400	595.00	1,428,000	
日本電波工業	7,400	1,124.00	8,317,600	貸付株式数 2,800株
鈴木	3,400	802.00	2,726,800	貸付株式数 600株
メイコー	8,100	3,875.00	31,387,500	
日本トリム	1,400	2,435.00	3,409,000	
ローランド ディー . ジー .	4,300	3,290.00	14,147,000	貸付株式数 700株
フオスタ - 電機	6,800	740.00	5,032,000	
S M K	1,500	2,091.00	3,136,500	貸付株式数 600株
ヨコオ	5,100	2,186.00	11,148,600	
ティアック	10,900	118.00	1,286,200	貸付株式数 4,200株
ホシデン	16,900	1,222.00	20,651,800	
ヒロセ電機	10,900	17,650.00	192,385,000	
日本航空電子	15,600	2,119.00	33,056,400	
T O A	7,600	760.00	5,776,000	貸付株式数 100株
マクセル	13,900	1,313.00	18,250,700	
古野電気	8,800	1,033.00	9,090,400	貸付株式数 3,400株
ユニデンホールディングス	1,600	3,850.00	6,160,000	
スミダコーポレーション	6,900	809.00	5,582,100	
アイコム	2,500	2,419.00	6,047,500	貸付株式数 1,000株
リオン	2,700	2,501.00	6,752,700	
本多通信工業	5,000	523.00	2,615,000	貸付株式数 2,100株
横河電機	70,200	2,257.00	158,441,400	
新電元工業	2,700	3,300.00	8,910,000	
アズビル	43,700	3,450.00	150,765,000	
東亜ディーケーケー	4,300	828.00	3,560,400	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	29,200	2,917.00	85,176,400	

チノール	2,500	1,610.00	4,025,000	貸付株式数	700株
共和電業	8,700	318.00	2,766,600	貸付株式数	2,600株
日本電子材料	3,600	1,856.00	6,681,600	貸付株式数	1,200株
堀場製作所	13,100	6,400.00	83,840,000	貸付株式数	4,900株
アドバンテスト	55,400	7,730.00	428,242,000		
小野測器	3,600	439.00	1,580,400		
エスペック	5,900	1,783.00	10,519,700		
キーエンス	67,500	46,250.00	3,121,875,000		
日置電機	3,500	6,600.00	23,100,000	貸付株式数	1,300株
シスメックス	56,600	7,724.00	437,178,400		
日本マイクロニクス	11,800	1,382.00	16,307,600	貸付株式数	3,400株
メガチップス	6,600	3,050.00	20,130,000		
OBARA GROUP	3,400	2,883.00	9,802,200	貸付株式数	1,400株
IMAGICA GROUP	5,500	710.00	3,905,000		
澤藤電機	800	1,441.00	1,152,800	貸付株式数	300株
デンソー	152,000	7,548.00	1,147,296,000		
原田工業	3,100	910.00	2,821,000	貸付株式数	1,100株 (1,000株)
コーセル	7,900	811.00	6,406,900		
イリソ電子工業	6,300	3,270.00	20,601,000	貸付株式数	2,300株
オプテックスグループ	12,200	1,939.00	23,655,800		
千代田インテグレ	2,800	1,930.00	5,404,000		
レーザーテック	31,300	17,100.00	535,230,000		
スタンレー電気	49,500	2,230.00	110,385,000		
岩崎電気	2,400	2,588.00	6,211,200		
ウシオ電機	36,200	1,656.00	59,947,200		
岡谷電機	4,000	257.00	1,028,000	貸付株式数	2,000株
ヘリオステクノH	9,000	295.00	2,655,000		
エノモト	2,000	1,571.00	3,142,000	貸付株式数	700株
日本セラミック	6,900	2,020.00	13,938,000		
遠藤照明	3,300	746.00	2,461,800		
古河電池	5,300	1,213.00	6,428,900	貸付株式数	2,000株
双信電機	3,400	555.00	1,887,000	貸付株式数	1,300株
山一電機	5,000	1,869.00	9,345,000	貸付株式数	600株
図研	4,800	2,807.00	13,473,600	貸付株式数	1,700株
日本電子	14,700	5,720.00	84,084,000		
カシオ	48,100	1,250.00	60,125,000		
ファナック	65,400	20,040.00	1,310,616,000		
日本シイエムケイ	13,500	458.00	6,183,000	貸付株式数	5,500株



エンプラス	1,800	3,360.00	6,048,000	
大真空	9,500	986.00	9,367,000	貸付株式数 3,700株
ローム	31,800	9,970.00	317,046,000	
浜松ホトニクス	50,900	5,750.00	292,675,000	
三井ハイテック	6,700	9,400.00	62,980,000	貸付株式数 2,500株
新光電気工業	21,900	4,225.00	92,527,500	
京セラ	104,900	7,196.00	754,860,400	
協栄産業	500	1,383.00	691,500	
太陽誘電	34,200	5,160.00	176,472,000	
村田製作所	208,600	8,050.00	1,679,230,000	
双葉電子工業	12,300	649.00	7,982,700	
日東電工	44,900	9,400.00	422,060,000	
北陸電気工業	2,600	1,113.00	2,893,800	貸付株式数 300株
東海理化電機	19,600	1,442.00	28,263,200	
ニチコン	21,000	1,363.00	28,623,000	
日本ケミコン	7,000	1,808.00	12,656,000	
K O A	10,600	1,650.00	17,490,000	
三井E & S H D	21,700	358.00	7,768,600	
日立造船	59,900	849.00	50,855,100	
三菱重工業	111,900	5,225.00	584,677,500	
川崎重工業	51,800	2,831.00	146,645,800	
I H I	46,400	3,920.00	181,888,000	
名村造船所	20,100	409.00	8,220,900	貸付株式数 8,400株
サノヤスホールディングス	6,000	127.00	762,000	貸付株式数 2,400株
スプリックス	2,300	963.00	2,214,900	
マネジメントソリューションズ	3,500	2,515.00	8,802,500	貸付株式数 1,100株
プロレド・パートナーズ	1,700	487.00	827,900	貸付株式数 600株 (100株)
AND FACTORY	1,600	411.00	657,600	貸付株式数 500株
テノ・ホールディングス	800	640.00	512,000	貸付株式数 300株
フロンティア・マネジメント	1,900	1,185.00	2,251,500	
ピアラ	1,200	707.00	848,400	貸付株式数 400株
コプロ・ホールディングス	1,400	893.00	1,250,200	
ギークス	1,200	955.00	1,146,000	貸付株式数 400株
カーブスホールディングス	19,500	652.00	12,714,000	貸付株式数 6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,500	925.00	4,162,500	

FAST FITNESS JAP	1,300	1,359.00	1,766,700	貸付株式数	500株
日本車輛	2,300	2,031.00	4,671,300		
三菱ロジスネクスト	9,800	800.00	7,840,000		
近畿車輛	800	1,125.00	900,000	貸付株式数	400株
一家ホールディングス	1,300	580.00	754,000	貸付株式数	400株
フルサト・マルカHD	6,600	2,828.00	18,664,800	貸付株式数	2,500株
ヤマエグループHD	4,400	1,152.00	5,068,800		
藤久ホールディングス	2,400	707.00	1,696,800	貸付株式数	900株
FPG	24,700	910.00	22,477,000	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,000	512.00	1,024,000		
じもとホールディングス	4,700	570.00	2,679,000		
全国保証	17,500	4,265.00	74,637,500	貸付株式数	100株
めぶきフィナンシャルG	321,200	259.00	83,190,800		
ジャパンインベストメント A	5,600	1,395.00	7,812,000	貸付株式数	2,200株 (2,100株)
東京きらぼしFG	8,800	2,000.00	17,600,000		
九州フィナンシャルG	136,200	387.00	52,709,400	貸付株式数	12,300株
かんぼ生命保険	73,900	2,223.00	164,279,700		
ゆうちょ銀行	173,600	986.00	171,169,600	貸付株式数	67,800株
あんしん保証	3,500	264.00	924,000	貸付株式数	1,100株
富山第一銀行	16,100	434.00	6,987,400	貸付株式数	1,500株 (1,500株)
コンコルディア・フィナン シャル	383,900	467.00	179,281,300		
ジェイリース	2,500	1,773.00	4,432,500	貸付株式数	900株
西日本フィナンシャルHD	41,100	756.00	31,071,600		
イントラスト	3,500	532.00	1,862,000		
日本モーゲージサービス	4,200	943.00	3,960,600	貸付株式数	1,600株
Casa	2,900	833.00	2,415,700	貸付株式数	1,000株
アルヒ	10,800	990.00	10,692,000	貸付株式数	4,300株
プレミアグループ	3,700	3,835.00	14,189,500		
日産自動車	879,600	533.60	469,354,560		
いすゞ自動車	222,000	1,571.00	348,762,000		
トヨタ自動車	3,524,400	2,080.00	7,330,752,000		
日野自動車	93,300	692.00	64,563,600		
三菱自動車工業	276,100	439.00	121,207,900	貸付株式数	107,800株
エフテック	4,800	542.00	2,601,600		
レシップホールディングス	2,300	544.00	1,251,200		
GMB	1,200	700.00	840,000	貸付株式数	400株

ファルテック	1,000	603.00	603,000	
武蔵精密工業	16,700	1,337.00	22,327,900	
日産車体	10,500	582.00	6,111,000	貸付株式数 4,100株
新明和工業	20,400	1,113.00	22,705,200	
極東開発工業	12,500	1,435.00	17,937,500	
トピー工業	5,600	1,293.00	7,240,800	
ティラド	1,900	2,726.00	5,179,400	
タチエス	12,400	1,111.00	13,776,400	
N O K	30,700	1,173.00	36,011,100	
フタバ産業	17,100	383.00	6,549,300	
K Y B	7,000	2,992.00	20,944,000	
市光工業	8,800	368.00	3,238,400	
大同メタル工業	13,000	518.00	6,734,000	貸付株式数 1,400株
プレス工業	33,400	420.00	14,028,000	
ミクニ	8,700	345.00	3,001,500	
太平洋工業	14,700	1,027.00	15,096,900	
河西工業	8,500	275.00	2,337,500	貸付株式数 1,200株
アイシン	54,600	4,255.00	232,323,000	
マ ツ ダ	224,400	1,107.00	248,410,800	
今仙電機製作所	4,300	584.00	2,511,200	貸付株式数 1,700株
本田技研	559,100	3,305.00	1,847,825,500	
スズキ	155,400	4,035.00	627,039,000	
S U B A R U	201,800	2,447.50	493,905,500	
安永	3,000	698.00	2,094,000	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	97,400	2,580.00	251,292,000	
小糸製作所	38,500	4,535.00	174,597,500	
T B K	6,000	340.00	2,040,000	
エクセディ	11,200	1,749.00	19,588,800	
ミツバ	12,200	387.00	4,721,400	
豊田合成	22,100	2,091.00	46,211,100	
愛三工業	11,600	705.00	8,178,000	
盟和産業	600	1,009.00	605,400	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,100	451.00	2,300,100	貸付株式数 500株
ヨ ロ ズ	6,000	871.00	5,226,000	貸付株式数 1,000株
エフ・シー・シー	12,100	1,364.00	16,504,400	貸付株式数 4,500株
新家工業	1,500	1,460.00	2,190,000	
シマノ	28,400	21,075.00	598,530,000	
テイ・エス テック	31,500	1,393.00	43,879,500	
3 3 F G	6,000	1,359.00	8,154,000	
第四北越フィナンシャルG	10,900	2,493.00	27,173,700	

ひろぎんHLDGS	99,200	605.00	60,016,000		
マーキュリアホールディングス	3,500	592.00	2,072,000	貸付株式数	800株
おきなわFG	6,400	2,100.00	13,440,000	貸付株式数	2,400株
ダイレクトマーケティングミクス	7,500	1,676.00	12,570,000		
ポピンズ	1,700	1,878.00	3,192,600		
LITALICO	5,800	2,247.00	13,032,600		
十六FG	9,100	2,291.00	20,848,100		
北國FHD	6,500	4,465.00	29,022,500		
ネットプロHD	22,400	512.00	11,468,800	貸付株式数	8,700株
プロクレアホールディングス	7,500	1,869.00	14,017,500	貸付株式数	2,900株
ジャムコ	4,300	1,227.00	5,276,100	貸付株式数	1,600株 (100株)
小野建	6,700	1,389.00	9,306,300		
はるやまHLDGS	3,700	431.00	1,594,700	貸付株式数	1,400株
南陽	1,700	1,781.00	3,027,700		
ノジマ	11,800	2,832.00	33,417,600		
佐島電機	4,400	1,185.00	5,214,000		
カップ・クリエイト	10,500	1,390.00	14,595,000	貸付株式数	4,100株
エコートレーディング	1,800	567.00	1,020,600	貸付株式数	500株
伯東	4,400	2,742.00	12,064,800		
コンドーテック	5,400	988.00	5,335,200	貸付株式数	2,000株
中山福	3,800	319.00	1,212,200	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,700	715.00	4,075,500	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	9,000	1,838.00	16,542,000		
三菱食品	7,000	3,130.00	21,910,000		
良品計画	84,500	1,341.00	113,314,500		
パリミキホールディングス	10,000	268.00	2,680,000	貸付株式数	3,400株
松田産業	5,300	1,981.00	10,499,300		
第一興商	14,000	3,725.00	52,150,000		
メディパルHD	71,600	1,799.00	128,808,400		
アドヴァングループ	6,600	785.00	5,181,000	貸付株式数	600株
SPK	2,500	1,319.00	3,297,500	貸付株式数	1,000株
萩原電気HLDGS	2,300	2,022.00	4,650,600		
アルビス	2,400	2,192.00	5,260,800	貸付株式数	700株
アズワン	10,500	5,730.00	60,165,000		
スズデン	2,600	1,961.00	5,098,600		
尾家産業	1,800	857.00	1,542,600	貸付株式数	700株

シモジマ	4,600	935.00	4,301,000	貸付株式数	1,700株
ドウシシャ	6,900	1,500.00	10,350,000	貸付株式数	2,200株 (100株)
小津産業	1,400	1,834.00	2,567,600	貸付株式数	400株
コナカ	8,200	333.00	2,730,600	貸付株式数	3,100株
高速	4,300	1,489.00	6,402,700		
ハウス ローゼ	1,100	1,659.00	1,824,900	貸付株式数	300株
G - 7ホールディングス	8,100	1,362.00	11,032,200		
たけびし	2,200	1,437.00	3,161,400	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	10,700	1,048.00	11,213,600	貸付株式数	4,600株
コジマ	12,800	588.00	7,526,400	貸付株式数	4,400株
ヒマラヤ	2,500	938.00	2,345,000		
コーナン商事	10,300	3,525.00	36,307,500		
ネットワンシステムズ	27,000	2,762.00	74,574,000		
エコス	2,400	1,985.00	4,764,000	貸付株式数	1,000株
ワタミ	8,800	911.00	8,016,800	貸付株式数	1,500株
マルシェ	2,700	459.00	1,239,300	貸付株式数	800株
リックス	2,300	1,833.00	4,215,900	貸付株式数	600株
システムソフト	19,600	100.00	1,960,000	貸付株式数	5,600株
パンパシフィックHD	146,800	1,902.00	279,213,600		
丸文	5,700	752.00	4,286,400		
西松屋チェーン	14,900	1,418.00	21,128,200	貸付株式数	5,700株
ゼンショーホールディングス	35,600	3,040.00	108,224,000	貸付株式数	13,500株
ハピネット	5,600	1,537.00	8,607,200		
幸楽苑ホールディングス	4,500	1,277.00	5,746,500	貸付株式数	1,700株
ハークスレイ	3,600	571.00	2,055,600	貸付株式数	1,100株
橋本総業HLDS	1,300	1,916.00	2,490,800	貸付株式数	400株
日本ライフライン	22,000	903.00	19,866,000		
サイゼリヤ	10,800	2,579.00	27,853,200	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,500	750.00	4,125,000	貸付株式数	1,900株
V Tホールディングス	27,400	458.00	12,549,200		
アルゴグラフィックス	5,700	3,085.00	17,584,500		
魚力	2,300	2,240.00	5,152,000	貸付株式数	700株
IDOM	22,200	706.00	15,673,200	貸付株式数	8,000株
日本エム・ディ・エム	4,500	1,506.00	6,777,000		
ポプラ	1,800	142.00	255,600	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	4,100	1,166.00	4,780,600	貸付株式数	1,400株
ユナイテッドアローズ	7,600	1,924.00	14,622,400	貸付株式数	3,000株
進和	4,900	2,076.00	10,172,400	貸付株式数	1,700株

エスケイジャパン	1,800	457.00	822,600	
ダイトロン	2,800	1,926.00	5,392,800	
ハイデイ日高	10,600	2,030.00	21,518,000	貸付株式数 3,200株
シークス	9,700	998.00	9,680,600	
Y U - W A C R E A T I O N H	5,200	234.00	1,216,800	貸付株式数 500株
コロワイド	30,000	1,792.00	53,760,000	貸付株式数 11,500株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,800	337.00	2,965,600	貸付株式数 3,500株
田中商事	2,200	593.00	1,304,600	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	3,500	1,281.00	4,483,500	
壱番屋	5,200	4,805.00	24,986,000	貸付株式数 1,200株
白銅	2,300	2,436.00	5,602,800	貸付株式数 400株
トップカルチャー	3,700	262.00	969,400	
P L A N T	1,700	650.00	1,105,000	貸付株式数 600株
スギホールディングス	14,700	5,060.00	74,382,000	
ダイコー通産	600	1,125.00	675,000	貸付株式数 300株
薬王堂ホールディングス	3,800	2,019.00	7,672,200	
島津製作所	91,200	4,445.00	405,384,000	
J M S	6,300	566.00	3,565,800	
クボテック	2,200	264.00	580,800	貸付株式数 600株
長野計器	5,200	1,145.00	5,954,000	
ブイ・テクノロジー	3,300	2,805.00	9,256,500	
スター精密	10,700	1,712.00	18,318,400	
東京計器	5,100	1,384.00	7,058,400	貸付株式数 1,600株
愛知時計	2,800	1,414.00	3,959,200	
インターアクション	3,800	1,898.00	7,212,400	貸付株式数 1,400株
オーバル	7,300	309.00	2,255,700	貸付株式数 2,500株
東京精密	11,900	4,700.00	55,930,000	
マニー	27,700	1,356.00	37,561,200	貸付株式数 10,500株
ニコン	107,900	1,669.00	180,085,100	
トプコン	34,900	1,847.00	64,460,300	
オリンパス	370,700	2,705.00	1,002,743,500	
理研計器	5,200	3,750.00	19,500,000	貸付株式数 2,100株
S C R E E Nホールディン グス	12,200	10,440.00	127,368,000	
キヤノン電子	6,600	1,527.00	10,078,200	
タムロン	5,300	2,454.00	13,006,200	貸付株式数 400株
H O Y A	143,900	12,215.00	1,757,738,500	
シード	4,300	489.00	2,102,700	貸付株式数 1,200株

ノーリツ鋼機	6,700	2,330.00	15,611,000	
A & Dホロンホールディングス	8,400	955.00	8,022,000	
朝日インテック	81,500	1,780.00	145,070,000	
キヤノン	370,300	3,251.00	1,203,845,300	
リコー	187,200	1,104.00	206,668,800	
シチズン時計	77,600	560.00	43,456,000	
リズム	2,300	1,748.00	4,020,400	
大研医器	7,200	494.00	3,556,800	
メニコン	23,600	2,685.00	63,366,000	貸付株式数 400株
シンシア	1,000	416.00	416,000	貸付株式数 200株
中本パックス	2,100	1,565.00	3,286,500	貸付株式数 700株
スノーピーク	9,700	2,410.00	23,377,000	貸付株式数 3,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	14,300	1,975.00	28,242,500	
トランザクション	4,600	1,081.00	4,972,600	貸付株式数 1,100株
粧美堂	2,400	394.00	945,600	貸付株式数 700株
ニホンフラッシュ	5,900	977.00	5,764,300	貸付株式数 900株
前田工織	7,400	2,607.00	19,291,800	
永大産業	7,900	270.00	2,133,000	
アートネイチャー	6,100	715.00	4,361,500	
バンダイナムコHLDGS	63,400	9,306.00	590,000,400	
アイフィスジャパン	2,100	680.00	1,428,000	貸付株式数 700株
共立印刷	10,900	153.00	1,667,700	貸付株式数 4,100株
SHOEI	6,700	5,020.00	33,634,000	
フランスベッドHLDGS	9,300	890.00	8,277,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	11,500	668.00	7,682,000	
パイロットコーポレーション	11,300	5,040.00	56,952,000	
萩原工業	4,800	1,094.00	5,251,200	貸付株式数 1,800株
エイベックス	12,700	1,251.00	15,887,700	貸付株式数 4,500株
フジシールインターナショナル	16,000	1,475.00	23,600,000	
タカラトミー	30,700	1,263.00	38,774,100	貸付株式数 3,000株
広済堂ホールディングス	4,600	1,145.00	5,267,000	貸付株式数 1,600株
エステールホールディングス	1,400	635.00	889,000	貸付株式数 700株
レック	9,100	673.00	6,124,300	
タカノ	2,500	766.00	1,915,000	貸付株式数 800株
三光合成	9,800	334.00	3,273,200	貸付株式数 3,300株

プロネクサス	5,800	1,031.00	5,979,800	
ホクシン	5,100	144.00	734,400	
ウッドワン	2,200	1,177.00	2,589,400	貸付株式数 500株
大建工業	3,900	1,743.00	6,797,700	
きもと	10,900	223.00	2,430,700	
凸版印刷	102,500	2,336.00	239,440,000	
大日本印刷	83,200	2,878.00	239,449,600	
共同印刷	2,000	2,600.00	5,200,000	貸付株式数 700株
N I S S H A	13,700	1,483.00	20,317,100	
光村印刷	600	1,256.00	753,600	貸付株式数 200株
藤森工業	6,100	3,500.00	21,350,000	
ヴィア・ホールディングス	9,900	149.00	1,475,100	貸付株式数 3,800株
TAKARA & COMPANY	4,300	1,814.00	7,800,200	貸付株式数 1,300株
前澤化成工業	4,300	1,288.00	5,538,400	貸付株式数 1,400株
未来工業	2,700	1,481.00	3,998,700	
アシックス	60,100	2,437.00	146,463,700	
ツツミ	1,900	1,887.00	3,585,300	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	3,100	649.00	2,011,900	貸付株式数 900株
ジェイエスピー	4,200	1,398.00	5,871,600	貸付株式数 1,600株
ニチハ	9,800	2,492.00	24,421,600	
ローランド	5,200	4,280.00	22,256,000	貸付株式数 1,900株
エフピコ	13,600	2,603.00	35,400,800	
小松ウオール工業	2,200	1,860.00	4,092,000	
ヤマハ	43,400	5,320.00	230,888,000	
河合楽器	1,900	2,620.00	4,978,000	
クリナップ	6,700	545.00	3,651,500	
ビジョン	45,100	1,701.00	76,715,100	貸付株式数 17,200株
天馬	6,300	2,346.00	14,779,800	貸付株式数 2,200株
兼松サステック	500	1,587.00	793,500	貸付株式数 100株
キングジム	5,800	913.00	5,295,400	貸付株式数 2,200株
象印マホービン	19,000	1,414.00	26,866,000	貸付株式数 500株 (500株)
リンテック	15,800	2,392.00	37,793,600	
信越ポリマー	13,200	1,129.00	14,902,800	
東リ	16,500	206.00	3,399,000	
イトーキ	13,200	381.00	5,029,200	貸付株式数 3,700株
任天堂	42,100	56,210.00	2,366,441,000	
三菱鉛筆	10,700	1,378.00	14,744,600	貸付株式数 400株
松風	2,800	1,640.00	4,592,000	貸付株式数 1,200株



タカラスタンダ - ド	13,100	1,254.00	16,427,400	貸付株式数	100株
コ ク ヨ	33,700	1,634.00	55,065,800	貸付株式数	12,900株
ナカバヤシ	6,300	491.00	3,093,300	貸付株式数	600株
ニ フ コ	24,700	3,085.00	76,199,500		
立川ブラインド	2,900	1,053.00	3,053,700	貸付株式数	1,000株
グロープライド	5,900	2,119.00	12,502,100		
オカムラ	22,500	1,105.00	24,862,500		
バルカー	6,700	2,734.00	18,317,800		
MUTOHホールディングス	800	2,056.00	1,644,800	貸付株式数	300株
伊 藤 忠	464,700	3,702.00	1,720,319,400		
丸 紅	670,500	1,333.00	893,776,500		
スクロール	11,200	869.00	9,732,800	貸付株式数	500株
高 島	1,100	2,479.00	2,726,900		
ヨンドシーホールディングス	6,300	1,749.00	11,018,700	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,200	844.00	2,700,800	貸付株式数	700株
長瀬産業	35,200	1,847.00	65,014,400		
ナイガイ	2,300	289.00	664,700	貸付株式数	900株
蝶 理	4,100	1,901.00	7,794,100		
豊田通商	68,300	4,785.00	326,815,500		
オンワ - ドホールディングス	41,400	247.00	10,225,800	貸付株式数	16,100株
三共生興	9,100	538.00	4,895,800		
兼 松	26,000	1,329.00	34,554,000		
美 津 濃	6,500	2,213.00	14,384,500		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,143.00	1,371,600	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,300	1,528.00	3,514,400	貸付株式数	800株
三井物産	544,800	3,213.00	1,750,442,400		
日本紙パルプ	3,500	3,610.00	12,635,000		
東京エレクトロン	47,300	51,000.00	2,412,300,000		
カメイ	8,100	1,047.00	8,480,700	貸付株式数	100株
東都水産	400	4,355.00	1,742,000		
OUGホールディングス	1,100	2,738.00	3,011,800	貸付株式数	400株
スターゼン	5,200	1,934.00	10,056,800	貸付株式数	1,900株
セイコーHD	10,500	2,772.00	29,106,000		
山 善	27,800	993.00	27,605,400	貸付株式数	11,600株
椿本興業	1,500	3,535.00	5,302,500	貸付株式数	400株
住友商事	444,200	1,849.00	821,325,800		
B I P R O G Y	22,900	2,803.00	64,188,700		

内田洋行	3,000	5,200.00	15,600,000	貸付株式数	1,100株
三菱商事	504,400	4,383.00	2,210,785,200		
第一実業	3,000	3,350.00	10,050,000		
キャノンマーケティングJ P N	18,100	2,887.00	52,254,700		
西華産業	3,300	1,615.00	5,329,500		
佐藤商事	5,100	1,100.00	5,610,000		
菱洋エレクトロ	4,300	2,272.00	9,769,600	貸付株式数	1,600株
東京産業	5,600	690.00	3,864,000	貸付株式数	400株
ユアサ商事	6,200	3,355.00	20,801,000		
神鋼商事	1,700	3,810.00	6,477,000		
トルク	10,100	197.00	1,989,700	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,400	2,907.00	38,953,800		
正栄食品	4,700	3,535.00	16,614,500	貸付株式数	1,800株
カナデン	6,200	1,003.00	6,218,600	貸付株式数	2,200株
菱電商事	5,800	1,585.00	9,193,000	貸付株式数	2,300株
ニプロ	52,600	1,016.00	53,441,600		
岩谷産業	16,700	5,230.00	87,341,000		
ナイス	2,500	1,622.00	4,055,000		
ニチモウ	1,000	2,292.00	2,292,000		
極東貿易	2,100	2,616.00	5,493,600	貸付株式数	600株
アステナホールディングス	9,800	416.00	4,076,800		
兼松エレクトロニクス	3,900	3,860.00	15,054,000		
三愛オブリ	17,000	950.00	16,150,000		
稲畑産業	14,700	2,252.00	33,104,400	貸付株式数	2,000株
G S Iクレオス	3,500	1,268.00	4,438,000	貸付株式数	1,300株
明和産業	6,700	685.00	4,589,500	貸付株式数	2,600株
クワザワホールディングス	2,500	462.00	1,155,000	貸付株式数	1,000株
ゴ - ルドウイン	12,400	7,790.00	96,596,000		
ユニ・チャ - ム	143,700	4,181.00	600,809,700		
デサント	13,100	2,770.00	36,287,000		
キ ン グ	3,300	536.00	1,768,800	貸付株式数	1,300株
ワ キ タ	13,800	1,150.00	15,870,000		
ヤマトインタ - ナショナル	5,200	281.00	1,461,200	貸付株式数	2,300株
東邦ホールディングス	21,000	1,876.00	39,396,000		
サンゲツ	18,000	1,521.00	27,378,000		
ミツウロコグループ	9,100	891.00	8,108,100		
シナネンホールディングス	2,500	3,340.00	8,350,000		
伊藤忠エネクス	16,000	1,053.00	16,848,000		
サンリオ	21,300	2,497.00	53,186,100	貸付株式数	500株

サンワ テクノス	3,700	1,367.00	5,057,900	
リョーサン	7,600	2,287.00	17,381,200	
新光商事	9,700	871.00	8,448,700	
トーホー	3,000	1,312.00	3,936,000	貸付株式数 1,200株
三信電気	3,000	1,569.00	4,707,000	
東陽テクニカ	7,900	1,095.00	8,650,500	
モスフード サービス	9,600	3,010.00	28,896,000	貸付株式数 3,600株
加賀電子	6,200	3,085.00	19,127,000	
三益半導体	5,700	2,315.00	13,195,500	貸付株式数 700株
都築電気	3,400	1,267.00	4,307,800	
ソーダニツカ	6,500	600.00	3,900,000	
立花エレテック	5,100	1,518.00	7,741,800	貸付株式数 1,800株
木曽路	9,800	2,078.00	20,364,400	貸付株式数 2,800株
S R S ホールディングス	10,700	836.00	8,945,200	貸付株式数 3,200株
千 趣 会	13,700	392.00	5,370,400	貸付株式数 5,400株 (500株)
タカキュー	6,300	91.00	573,300	貸付株式数 2,200株
リテールパートナーズ	10,400	1,100.00	11,440,000	貸付株式数 3,300株
ケーヨー	13,700	927.00	12,699,900	
上新電機	7,600	1,825.00	13,870,000	貸付株式数 2,000株
日本瓦斯	35,700	1,905.00	68,008,500	
ロイヤルホールディングス	12,000	2,234.00	26,808,000	貸付株式数 4,600株
東 天 紅	700	913.00	639,100	
いなげや	7,700	1,155.00	8,893,500	
チヨダ	6,700	729.00	4,884,300	貸付株式数 2,500株
ライフコーポレーション	6,100	2,472.00	15,079,200	
リンガーハット	8,700	2,277.00	19,809,900	貸付株式数 3,300株
Mr M a x H D	9,400	578.00	5,433,200	
テンアライド	7,300	307.00	2,241,100	貸付株式数 2,800株
A O K I ホールディングス	14,000	663.00	9,282,000	貸付株式数 2,400株
オークワ	10,500	847.00	8,893,500	
コメリ	11,300	2,638.00	29,809,400	
青山商事	14,300	871.00	12,455,300	貸付株式数 100株
しまむら	8,500	11,250.00	95,625,000	
はせがわ	4,800	264.00	1,267,200	貸付株式数 900株
高 島 屋	50,900	1,278.00	65,050,200	
松 屋	13,200	871.00	11,497,200	貸付株式数 1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,900	995.00	32,735,500	貸付株式数 12,100株
近鉄百貨店	2,300	2,385.00	5,485,500	貸付株式数 900株

丸井グループ	54,800	2,271.00	124,450,800		
クレディセゾン	44,400	1,525.00	67,710,000		
アクシアル リテイリング	5,100	2,953.00	15,060,300	貸付株式数	1,900株
井筒屋	3,400	352.00	1,196,800	貸付株式数	1,300株
イオン	255,700	2,172.00	555,380,400		
イズミ	12,200	2,934.00	35,794,800	貸付株式数	1,300株
フオーバル	2,800	809.00	2,265,200	貸付株式数	500株
平和堂	11,300	1,861.00	21,029,300	貸付株式数	5,200株
フジ	17,400	2,216.00	38,558,400	貸付株式数	7,400株
ヤオコー	8,300	6,040.00	50,132,000	貸付株式数	3,000株
ゼビオホールディングス	10,200	890.00	9,078,000		
ケーズホールディングス	63,900	1,234.00	78,852,600		
PALTA C	10,300	4,160.00	42,848,000	貸付株式数	100株
三谷産業	11,600	306.00	3,549,600	貸付株式数	3,700株
OLYMPICグループ	3,000	643.00	1,929,000	貸付株式数	1,200株
日産東京販売HD	9,000	255.00	2,295,000		
新生銀行	48,000	1,936.00	92,928,000		
あおぞら銀行	41,100	2,649.00	108,873,900		
三菱UFJフィナンシャルG	4,406,400	740.20	3,261,617,280	貸付株式数	1,720,900株
りそなホールディングス	796,500	510.20	406,374,300		
三井住友トラストHD	127,400	4,110.00	523,614,000		
三井住友フィナンシャルG	487,800	4,016.00	1,959,004,800		
千葉銀行	220,800	746.00	164,716,800		
群馬銀行	125,400	373.00	46,774,200		
武蔵野銀行	9,900	1,752.00	17,344,800		
千葉興業銀行	15,800	257.00	4,060,600	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	28,300	186.00	5,263,800	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,800	1,918.00	39,894,400		
秋田銀行	4,300	1,558.00	6,699,400		
山形銀行	7,000	856.00	5,992,000	貸付株式数	300株
岩手銀行	4,500	2,012.00	9,054,000		
東邦銀行	54,600	200.00	10,920,000	貸付株式数	7,900株
東北銀行	3,000	980.00	2,940,000		
ふくおかフィナンシャルG	56,200	2,472.00	138,926,400		
静岡銀行	161,200	809.00	130,410,800		
スルガ銀行	63,000	356.00	22,428,000		
八十二銀行	150,100	469.00	70,396,900		
山梨中央銀行	7,400	1,118.00	8,273,200	貸付株式数	800株

大垣共立銀行	13,200	1,707.00	22,532,400	
福井銀行	5,900	1,308.00	7,717,200	貸付株式数 100株
清水銀行	2,500	1,455.00	3,637,500	
富山銀行	1,100	1,849.00	2,033,900	貸付株式数 400株
滋賀銀行	12,600	2,707.00	34,108,200	貸付株式数 1,200株
南都銀行	10,500	1,950.00	20,475,000	貸付株式数 100株
百五銀行	64,800	322.00	20,865,600	
京都銀行	24,000	5,870.00	140,880,000	
紀陽銀行	23,000	1,340.00	30,820,000	
ほくほくフィナンシャルG	43,000	817.00	35,131,000	
山陰合同銀行	41,900	656.00	27,486,400	貸付株式数 13,600株
中国銀行	55,500	956.00	53,058,000	貸付株式数 400株
鳥取銀行	2,000	1,170.00	2,340,000	
伊予銀行	87,900	656.00	57,662,400	
百十四銀行	7,000	1,719.00	12,033,000	
四国銀行	10,000	809.00	8,090,000	貸付株式数 3,100株
阿波銀行	10,200	1,996.00	20,359,200	
大分銀行	4,000	1,802.00	7,208,000	
宮崎銀行	4,100	2,050.00	8,405,000	
佐賀銀行	3,700	1,426.00	5,276,200	貸付株式数 200株
琉球銀行	15,700	775.00	12,167,500	貸付株式数 1,900株
セブン銀行	219,600	250.00	54,900,000	貸付株式数 19,900株
みずほフィナンシャルG	901,200	1,509.00	1,359,910,800	
高知銀行	2,200	728.00	1,601,600	貸付株式数 1,000株
山口フィナンシャルG	78,000	758.00	59,124,000	
芙蓉総合リース	6,700	7,510.00	50,317,000	
みずほリース	9,800	3,050.00	29,890,000	
東京センチュリー	12,400	4,105.00	50,902,000	
SBIホールディングス	90,800	2,560.00	232,448,000	
日本証券金融	28,700	857.00	24,595,900	
アイフル	123,500	343.00	42,360,500	
日本アジア投資	5,900	241.00	1,421,900	
長野銀行	2,100	1,223.00	2,568,300	
名古屋銀行	4,800	3,040.00	14,592,000	
北洋銀行	99,200	217.00	21,526,400	
愛知銀行	2,400	5,520.00	13,248,000	
中京銀行	2,300	1,764.00	4,057,200	
大光銀行	2,200	1,296.00	2,851,200	貸付株式数 900株
愛媛銀行	9,700	898.00	8,710,600	
トマト銀行	2,100	1,009.00	2,118,900	

京葉銀行	30,700	469.00	14,398,300	貸付株式数	11,200株
栃木銀行	33,400	256.00	8,550,400		
北日本銀行	2,000	1,507.00	3,014,000	貸付株式数	700株
東和銀行	12,100	507.00	6,134,700		
福島銀行	7,300	221.00	1,613,300		
大東銀行	2,900	640.00	1,856,000		
リコーリース	6,500	3,420.00	22,230,000		
イオンフィナンシャルサー ビス	40,100	1,200.00	48,120,000		
アコム	144,900	314.00	45,498,600		
ジャックス	7,600	3,285.00	24,966,000		
オリコ	198,600	123.00	24,427,800		
オリックス	436,900	2,314.50	1,011,205,050		
三菱HCキャピタル	248,500	618.00	153,573,000		
ジャフコグループ	28,100	1,612.00	45,297,200		
九州リースサービス	3,300	565.00	1,864,500	貸付株式数	1,300株
トモニホールディングス	54,400	308.00	16,755,200		
大和証券G本社	524,000	615.60	322,574,400		
野村ホールディングス	1,122,300	490.00	549,927,000		
岡三証券グループ	54,000	334.00	18,036,000	貸付株式数	400株
丸三証券	21,900	476.00	10,424,400		
東洋証券	22,800	180.00	4,104,000	貸付株式数	9,000株
東海東京HD	75,300	371.00	27,936,300		
光世証券	1,900	463.00	879,700	貸付株式数	500株
水戸証券	18,900	256.00	4,838,400		
いちよし証券	13,100	630.00	8,253,000	貸付株式数	100株
松井証券	35,900	809.00	29,043,100		
SOMP Oホールディング ス	110,000	5,914.00	650,540,000		
日本取引所グループ	175,300	2,076.50	364,010,450		
マネックスG	61,300	425.00	26,052,500	貸付株式数	24,000株
極東証券	8,900	675.00	6,007,500	貸付株式数	3,500株
岩井コスモホールディング	7,000	1,228.00	8,596,000	貸付株式数	900株
アイザワ証券グループ	10,800	676.00	7,300,800	貸付株式数	100株
フィデアホール	6,700	1,262.00	8,455,400	貸付株式数	200株
池田泉州HD	80,600	193.00	15,555,800		
アニコムホールディング ス	22,500	644.00	14,490,000	貸付株式数	8,200株
MS & AD	155,700	4,059.00	631,986,300		
マネーパートナーズGP	7,500	240.00	1,800,000		

スパークス・グループ	33,800	245.00	8,281,000	貸付株式数	12,600株 (200株)
小林洋行	3,000	219.00	657,000		
第一生命HLDGS	350,100	2,645.00	926,014,500		
東京海上HD	215,100	7,435.00	1,599,268,500		
アドバンテッジリスクマネ	3,600	456.00	1,641,600	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	10,800	1,952.00	21,081,600		
アサックス	4,600	596.00	2,741,600	貸付株式数	1,500株
NECキャピタルソリューション	3,200	1,955.00	6,256,000		
T&Dホールディングス	172,800	1,606.00	277,516,800		
アドバンスクリエイト	3,500	958.00	3,353,000	貸付株式数	1,100株
三井不動産	303,700	2,888.00	877,085,600		
三菱地所	440,400	1,936.50	852,834,600		
平和不動産	12,000	3,870.00	46,440,000		
東京建物	66,500	1,707.00	113,515,500		
京阪神ビルディング	10,200	1,245.00	12,699,000		
住友不動産	139,700	3,485.00	486,854,500		
太平洋興発	2,700	626.00	1,690,200		
テオーシー	11,900	621.00	7,389,900		
東京楽天地	1,000	3,890.00	3,890,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	10,100	2,560.00	25,856,000		
フジ住宅	8,200	631.00	5,174,200		
空港施設	6,900	524.00	3,615,600		
明和地所	3,100	608.00	1,884,800		
ゴールドクレスト	5,800	1,665.00	9,657,000		
リログループ	39,000	1,995.00	77,805,000	貸付株式数	200株
エスリード	2,700	1,638.00	4,422,600	貸付株式数	500株
日神グループHLDGS	11,600	432.00	5,011,200	貸付株式数	4,400株
日本エスコ	13,600	762.00	10,363,200	貸付株式数	4,900株
タカラレーベン	30,400	333.00	10,123,200	貸付株式数	200株
AVANTIA	3,200	826.00	2,643,200	貸付株式数	600株
イオンモール	37,100	1,599.00	59,322,900		
毎日コムネット	2,100	656.00	1,377,600	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,600	1,080.00	2,808,000	貸付株式数	900株
ランド	403,800	10.00	4,038,000	貸付株式数	144,600株
カチタス	18,300	2,622.00	47,982,600		
東祥	5,400	1,267.00	6,841,800	貸付株式数	1,500株
トーセイ	10,200	1,130.00	11,526,000	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,500	2,242.00	3,363,000	貸付株式数	600株

サンフロンティア不動産	10,300	1,058.00	10,897,400	
インテリックス	1,500	585.00	877,500	貸付株式数 100株
ランドビジネス	1,700	233.00	396,100	貸付株式数 1,100株
サンネクスタグループ	2,200	1,135.00	2,497,000	貸付株式数 900株
グランディハウス	4,800	523.00	2,510,400	
東武鉄道	69,600	2,965.00	206,364,000	
相鉄ホールディングス	22,500	2,281.00	51,322,500	
東急	178,200	1,480.00	263,736,000	
京浜急行	87,200	1,418.00	123,649,600	貸付株式数 9,700株
小田急電鉄	99,600	1,705.00	169,818,000	
京王電鉄	34,800	4,435.00	154,338,000	
京成電鉄	46,500	3,470.00	161,355,000	
富士急行	8,000	3,990.00	31,920,000	貸付株式数 2,600株
新京成電鉄	2,000	2,821.00	5,642,000	貸付株式数 200株
東日本旅客鉄道	119,600	6,770.00	809,692,000	
西日本旅客鉄道	82,900	4,771.00	395,515,900	
東海旅客鉄道	55,600	15,410.00	856,796,000	
西武ホールディングス	92,300	1,380.00	127,374,000	
鴻池運輸	10,800	1,142.00	12,333,600	
西日本鉄道	18,700	2,787.00	52,116,900	
ハマキョウレックス	4,900	2,883.00	14,126,700	
サカイ引越センター	3,400	4,260.00	14,484,000	貸付株式数 1,200株
近鉄グループHLDGS	67,700	3,870.00	261,999,000	
阪急阪神HLDGS	84,300	3,505.00	295,471,500	
南海電鉄	30,100	2,546.00	76,634,600	貸付株式数 11,500株
京阪ホールディングス	28,900	3,180.00	91,902,000	
神戸電鉄	2,000	3,205.00	6,410,000	貸付株式数 600株
名古屋鉄道	71,300	2,093.00	149,230,900	
山陽電鉄	5,000	2,094.00	10,470,000	貸付株式数 600株
アルプス物流	4,800	1,092.00	5,241,600	
トランコム	2,000	6,120.00	12,240,000	貸付株式数 700株
ヤマトホールディングス	99,000	2,079.00	205,821,000	
山九	17,700	3,835.00	67,879,500	
日新	5,200	1,576.00	8,195,200	
丸運	3,100	238.00	737,800	貸付株式数 1,400株
丸全昭和運輸	5,100	2,939.00	14,988,900	貸付株式数 1,500株
センコーグループHLDGS	33,800	837.00	28,290,600	貸付株式数 3,500株
トナミホールディングス	1,400	3,405.00	4,767,000	
ニッコンホールディングス	22,700	2,035.00	46,194,500	



日石輸送	700	2,521.00	1,764,700	貸付株式数	200株
福山通運	9,900	3,075.00	30,442,500		
セイノーホールディングス	41,700	1,032.00	43,034,400	貸付株式数	6,500株
エスライン	1,800	848.00	1,526,400	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,000	3,370.00	6,740,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,300	8,550.00	113,715,000		
丸和運輸機関	12,900	1,416.00	18,266,400	貸付株式数	400株
C & F ロジホールディングス	6,300	1,000.00	6,300,000		
日本郵船	59,100	9,680.00	572,088,000		
商船三井	111,700	3,205.00	357,998,500		
川崎汽船	21,800	9,200.00	200,560,000	貸付株式数	8,500株
N S ユナイテッド海運	3,500	3,920.00	13,720,000	貸付株式数	1,400株
明治海運	7,200	1,469.00	10,576,800	貸付株式数	3,000株
飯野海運	29,500	758.00	22,361,000		
共栄タンカー	1,200	1,001.00	1,201,200	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,700	2,635.00	130,959,500		
S G ホールディングス	123,600	2,209.00	273,032,400		
N I P P O N E X P R E S S	22,100	7,610.00	168,181,000		
日本航空	155,200	2,268.00	351,993,600		
A N A ホールディングス	172,000	2,432.50	418,390,000		
ピーウィズ	1,900	1,358.00	2,580,200	貸付株式数	700株
パスコ	1,400	1,277.00	1,787,800		
T R E ホールディングス	12,200	1,876.00	22,887,200	貸付株式数	3,600株
人・夢・技術グループ	2,800	2,366.00	6,624,800		
西本W I S M E T T A C H D	1,700	3,870.00	6,579,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,600	1,672.00	2,675,200		
ヤマシタヘルスケアH L D G S	800	1,842.00	1,473,600	貸付株式数	200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	3,200	3,185.00	10,192,000	貸付株式数	1,200株
コア商事H L D G S	4,600	777.00	3,574,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
国際紙パルプ商事	14,000	455.00	6,370,000	貸付株式数	5,500株
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	861.00	1,377,600	貸付株式数	600株
ブックオフG H D	4,600	966.00	4,443,600	貸付株式数	1,500株
ギフトホールディングス	1,200	2,037.00	2,444,400		

三菱倉庫	19,800	3,180.00	62,964,000	
三井倉庫HOLD	7,100	2,990.00	21,229,000	
住友倉庫	22,000	2,012.00	44,264,000	貸付株式数 8,200株
渋沢倉庫	3,700	2,198.00	8,132,600	貸付株式数 600株
ヤマタネ	3,000	1,554.00	4,662,000	貸付株式数 1,100株
東陽倉庫	10,200	295.00	3,009,000	貸付株式数 1,700株
乾汽船	4,400	1,773.00	7,801,200	貸付株式数 1,800株
日本トランスシティ	13,500	498.00	6,723,000	
ケイヒン	1,200	1,324.00	1,588,800	
中央倉庫	3,700	960.00	3,552,000	貸付株式数 1,400株
川西倉庫	1,300	1,091.00	1,418,300	貸付株式数 400株
安田倉庫	4,700	945.00	4,441,500	
ファイズホールディングス	1,500	707.00	1,060,500	
東洋埠頭	1,800	1,271.00	2,287,800	
上組	36,400	2,551.00	92,856,400	
サンリツ	1,600	731.00	1,169,600	
キムラユニティー	1,800	1,465.00	2,637,000	貸付株式数 200株
キューソー流通システム	3,400	1,075.00	3,655,000	貸付株式数 1,200株
近鉄エクスプレス	12,800	4,170.00	53,376,000	
東海運	3,400	292.00	992,800	貸付株式数 1,400株
エーアイティー	4,400	1,414.00	6,221,600	
内外トランスライン	2,700	1,889.00	5,100,300	貸付株式数 900株
ショーエイコーポ	2,700	572.00	1,544,400	貸付株式数 800株
日本コンセプト	2,200	1,430.00	3,146,000	
TBSホールディングス	38,300	1,713.00	65,607,900	
日本テレビHLD S	60,800	1,243.00	75,574,400	
朝日放送グループHD	6,400	648.00	4,147,200	貸付株式数 2,500株
テレビ朝日HD	18,000	1,475.00	26,550,000	
スカパーJ S A T H D	61,700	514.00	31,713,800	貸付株式数 700株
テレビ東京HD	5,000	1,965.00	9,825,000	
日本BS放送	3,000	1,042.00	3,126,000	貸付株式数 900株
ビジョン	12,000	1,295.00	15,540,000	
スマートバリュー	1,700	469.00	797,300	貸付株式数 600株
USEN-NEXT HLDGS	6,000	1,877.00	11,262,000	貸付株式数 2,500株
ワイヤレスゲート	3,000	299.00	897,000	貸付株式数 1,100株
コネクシオ	5,300	1,285.00	6,810,500	
日本通信	60,700	188.00	11,411,600	貸付株式数 24,100株
クロップス	1,400	1,023.00	1,432,200	
日本電信電話	801,600	3,824.00	3,065,318,400	

KDDI	533,200	4,353.00	2,321,019,600		
ソフトバンク	1,107,600	1,458.50	1,615,434,600		
光通信	8,400	13,710.00	115,164,000		
エムティーアイ	6,100	443.00	2,702,300	貸付株式数	2,200株
GMOインターネット	25,600	2,246.00	57,497,600		
ファイバーゲート	3,400	906.00	3,080,400	貸付株式数	1,300株
アйдママーケティング ミュ	1,800	299.00	538,200	貸付株式数	600株
KADOKAWA	39,500	2,698.00	106,571,000		
学研ホールディングス	10,300	849.00	8,744,700	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	12,100	898.00	10,865,800	貸付株式数	4,300株
昭文社ホールディングス	3,000	385.00	1,155,000	貸付株式数	1,000株
インプレスホールディング ス	6,500	209.00	1,358,500		
東京電力HD	558,100	492.00	274,585,200	貸付株式数	105,400株
中部電力	216,500	1,255.00	271,707,500		
関西電力	267,900	1,254.00	335,946,600		
中国電力	110,400	832.00	91,852,800		
北陸電力	64,500	499.00	32,185,500	貸付株式数	25,700株
東北電力	167,000	701.00	117,067,000		
四国電力	63,500	739.00	46,926,500		
九州電力	146,400	830.00	121,512,000	貸付株式数	5,200株
北海道電力	64,400	459.00	29,559,600		
沖縄電力	15,700	1,220.00	19,154,000		
電源開発	57,800	2,059.00	119,010,200		
エフオン	4,500	546.00	2,457,000	貸付株式数	1,600株
イーレックス	10,100	2,036.00	20,563,600	貸付株式数	4,000株
レノバ	14,600	2,010.00	29,346,000	貸付株式数	5,700株
東京瓦斯	136,100	2,615.00	355,901,500		
大阪瓦斯	128,600	2,420.00	311,212,000		
東邦瓦斯	30,900	3,050.00	94,245,000		
北海道瓦斯	3,600	1,593.00	5,734,800	貸付株式数	400株
広島ガス	13,000	313.00	4,069,000		
西部ガスHLDGS	7,500	1,827.00	13,702,500	貸付株式数	600株
静岡ガス	18,200	834.00	15,178,800		
メタウォーター	7,800	1,962.00	15,303,600		
アイネット	3,300	1,203.00	3,969,900		
松竹	4,400	12,600.00	55,440,000		
東宝	43,200	4,810.00	207,792,000		
エイチ・アイ・エス	15,200	1,959.00	29,776,800	貸付株式数	5,900株

東映	2,200	17,080.00	37,576,000	
ラックランド	2,100	2,970.00	6,237,000	貸付株式数 800株
NTTデータ	194,900	1,859.00	362,319,100	
共立メンテナンス	12,700	4,885.00	62,039,500	貸付株式数 4,900株
イチネンホールディングス	7,600	1,198.00	9,104,800	
建設技術研究所	3,800	2,500.00	9,500,000	
スペース	4,700	901.00	4,234,700	
アインホールディングス	9,300	6,780.00	63,054,000	
燦ホールディングス	3,100	1,770.00	5,487,000	
ピー・シー・エー	4,300	1,044.00	4,489,200	貸付株式数 1,000株
スバル興業	400	8,860.00	3,544,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,000	1,210.00	2,420,000	貸付株式数 900株
タナベ経営	2,900	651.00	1,887,900	貸付株式数 300株
ビジネスB太田昭和	2,300	1,386.00	3,187,800	
ナガワ	2,100	7,890.00	16,569,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	5,400	3,750.00	20,250,000	
常磐興産	2,200	1,280.00	2,816,000	貸付株式数 1,000株
カナモト	11,900	1,959.00	23,312,100	
DTS	13,700	3,020.00	41,374,000	貸付株式数 100株
スクウェア・エニックス・HD	34,000	5,760.00	195,840,000	
シーイーシー	7,800	1,108.00	8,642,400	
カプコン	69,000	3,215.00	221,835,000	
西尾レントオール	6,100	2,728.00	16,640,800	
アイ・エス・ビー	3,400	1,003.00	3,410,200	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティーG	34,000	24.00	816,000	
日本空港ビルデング	25,200	5,000.00	126,000,000	貸付株式数 10,300株
トランス・コスモス	9,000	3,450.00	31,050,000	貸付株式数 3,200株
乃村工藝社	30,400	860.00	26,144,000	
ジャステック	4,100	1,149.00	4,710,900	貸付株式数 200株
SCSK	50,800	2,133.00	108,356,400	
藤田観光	3,100	2,871.00	8,900,100	貸付株式数 1,200株
KNT-CTホールディングス	4,400	1,589.00	6,991,600	貸付株式数 100株
日本管財	7,500	2,520.00	18,900,000	貸付株式数 1,700株
トーカイ	5,700	1,638.00	9,336,600	貸付株式数 100株
白洋舎	600	1,461.00	876,600	貸付株式数 300株
セコム	70,200	8,106.00	569,041,200	
日本システムウエア	2,700	2,373.00	6,407,100	

セントラル警備保障	3,500	2,194.00	7,679,000	貸付株式数	1,400株
アイネス	6,100	1,515.00	9,241,500	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,700	822.00	11,261,400		
メイテック	8,400	6,520.00	54,768,000		
T K C	11,600	3,145.00	36,482,000		
富士ソフト	7,300	7,210.00	52,633,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,200	1,708.00	12,297,600		
船井総研ホールディング	13,700	2,012.00	27,564,400		
N S D	23,000	2,303.00	52,969,000		
進学会ホールディングス	1,700	361.00	613,700	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	700	1,927.00	1,348,900		
オ オ バ	4,500	736.00	3,312,000	貸付株式数	1,800株
コナミホールディングス	26,600	7,840.00	208,544,000		
いであ	1,800	1,730.00	3,114,000	貸付株式数	600株
学 究 社	2,200	1,542.00	3,392,400		
ベネッセホールディングス	23,800	2,066.00	49,170,800		
イオンディライト	8,100	2,754.00	22,307,400		
ナック	3,200	936.00	2,995,200	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータH L D S	3,400	3,135.00	10,659,000		
ダイセキ	13,000	4,410.00	57,330,000		
ステップ	2,500	1,729.00	4,322,500	貸付株式数	800株
日鉄物産	4,700	5,100.00	23,970,000		
泉州電業	1,900	5,190.00	9,861,000	貸付株式数	700株
元気寿司	2,200	2,475.00	5,445,000	貸付株式数	700株
トラスコ中山	15,300	1,708.00	26,132,400		
ヤマダホールディングス	266,300	460.00	122,498,000		
オートバックスセブン	23,400	1,361.00	31,847,400	貸付株式数	9,300株
モリト	5,200	737.00	3,832,400		
アークランドサカモト	11,400	1,458.00	16,621,200		
ニトリホールディングス	29,100	12,155.00	353,710,500		
グルメ杵屋	5,900	990.00	5,841,000	貸付株式数	2,300株
愛 眼	7,400	185.00	1,369,000	貸付株式数	900株
ケーユーホールディングス	3,700	1,019.00	3,770,300		
吉野家ホールディングス	25,400	2,427.00	61,645,800	貸付株式数	10,100株
加藤産業	8,800	3,010.00	26,488,000		
北恵	1,900	860.00	1,634,000	貸付株式数	600株
イノテック	4,200	1,320.00	5,544,000		
イエローハット	12,000	1,607.00	19,284,000	貸付株式数	4,600株
松屋フーズH L D G S	3,700	3,785.00	14,004,500	貸付株式数	1,200株
J B C Cホールディングス	4,900	1,570.00	7,693,000		

J Kホールディングス	5,300	904.00	4,791,200	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,800	1,121.00	12,106,800	貸付株式数	4,000株
日 伝	6,200	1,911.00	11,848,200	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	6,300	1,183.00	7,452,900		
ミロク情報サービス	6,400	1,088.00	6,963,200	貸付株式数	1,800株
北沢産業	4,100	210.00	861,000		
杉本商事	3,800	2,103.00	7,991,400	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,200	2,667.00	48,539,400		
王将フードサービス	4,900	6,550.00	32,095,000	貸付株式数	1,700株
ブレナス	8,300	1,924.00	15,969,200		
ミニストップ	5,200	1,392.00	7,238,400	貸付株式数	2,000株
アークス	13,300	1,930.00	25,669,000	貸付株式数	5,000株
パローホールディングス	15,400	1,790.00	27,566,000		
東 テ ク	2,300	2,822.00	6,490,600		
ミスミグループ本社	91,800	2,758.00	253,184,400		
アルテック	5,700	234.00	1,333,800		
ベ ル ク	3,200	5,030.00	16,096,000		
大 庄	3,900	1,136.00	4,430,400	貸付株式数	1,300株
タキヒヨー	1,900	998.00	1,896,200	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	9,800	67,140.00	657,972,000		
ソフトバンクグループ	438,700	5,028.00	2,205,783,600		
蔵王産業	1,900	1,913.00	3,634,700	貸付株式数	400株
スズケン	27,000	3,475.00	93,825,000		
サンドラッグ	27,700	2,767.00	76,645,900		
サクスパーホールディング グ	7,100	541.00	3,841,100	貸付株式数	2,400株
ジェコス	5,100	810.00	4,131,000		
ヤマザワ	1,600	1,497.00	2,395,200	貸付株式数	600株
や ま や	1,800	2,453.00	4,415,400	貸付株式数	500株
グローセル	7,400	400.00	2,960,000	貸付株式数	3,000株
ペルーナ	15,700	686.00	10,770,200	貸付株式数	100株
合計			181,589,336,570		

（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 日経225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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	26,922,803	42,390,413
親投資信託受益証券	14,513,915,613	14,450,216,955
未収入金	-	5,000,000
流動資産合計	14,540,838,416	14,497,607,368
資産合計	14,540,838,416	14,497,607,368
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	52,309	20,047,989
未払受託者報酬	1,548,439	1,579,752
未払委託者報酬	22,453,084	22,907,160
その他未払費用	387,032	394,867
流動負債合計	24,440,864	44,929,768
負債合計	24,440,864	44,929,768
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	17,618,451,322	18,353,925,182
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,897,946,230	6,098,752,418
（分配準備積立金）	3,807,898,397	3,054,599,616
元本等合計	14,516,397,552	14,452,677,600
純資産合計	14,516,397,552	14,452,677,600
負債純資産合計	14,540,838,416	14,497,607,368

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自 2020年6月16日 至 2021年6月15日		自 2021年6月16日 至 2022年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		573		241
有価証券売買等損益		4,246,284,123		1,337,598,658
営業収益合計		4,246,284,696		1,337,598,417
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,952		8,797
受託者報酬		2,893,993		3,190,370
委託者報酬		41,964,262		46,261,624
その他費用		723,613		797,438
営業費用合計		45,591,820		50,258,229
営業利益又は営業損失（ ）		4,200,692,876		1,387,856,646
経常利益又は経常損失（ ）		4,200,692,876		1,387,856,646
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,200,692,876		1,387,856,646
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（ ）		704,804,222		118,646,618
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,057,059,287		6,897,946,230
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,397,500,069		2,042,224,179
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,397,500,069		2,042,224,179
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,052,501,780		1,572,207,963
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,052,501,780		1,572,207,963
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,897,946,230		6,098,752,418

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	8,153,504,515円	7,618,451,322円
期中追加設定元本額	2,128,271,246円	2,488,303,056円
期中一部解約元本額	2,663,324,439円	1,752,829,196円
2. 計算期間末日における受益権の総数	7,618,451,322口	8,353,925,182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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(3,468,797,324円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,090,055,930円)及び分配準備積立金(339,101,073円)より分配対象額は6,897,954,327円(1万口当たり9,054.27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(3,044,166,903円)及び分配準備積立金(3,054,599,616円)より分配対象額は6,098,766,519円(1万口当たり7,300.48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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,688,288,108	1,263,718,318
合計	3,688,288,108	1,263,718,318

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9054円 (19,054円)	1.7300円 (17,300円)
---------------------------	----------------------	----------------------

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス225・マザーファンド	4,144,976,466	14,450,216,955	
親投資信託受益証券 合計			14,450,216,955	
合計			14,450,216,955	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		3,489,894,062	7,589,051,922
株式	2 3	188,037,771,900	204,507,294,810
派生商品評価勘定		39,353,550	-
未収配当金		793,699,850	1,314,712,940
未収利息		21,001	163,422
前払金		-	117,547,760
その他未収収益	4	3,834,687	11,008,846
流動資産合計		192,364,575,050	213,539,779,700
資産合計		192,364,575,050	213,539,779,700
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	178,832,260
前受金		1,900,000	-
未払解約金		186,918,000	24,550,000
受入担保金		65,324,700	3,800,179,110
流動負債合計		254,142,700	4,003,561,370
負債合計		254,142,700	4,003,561,370
純資産の部			
元本等			
元本	1	50,206,993,331	60,104,604,144
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		141,903,439,019	149,431,614,186
元本等合計		192,110,432,350	209,536,218,330
純資産合計		192,110,432,350	209,536,218,330
負債純資産合計		192,364,575,050	213,539,779,700

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	57,999,406,705円	50,206,993,331円
期中追加設定元本額	10,080,290,067円	21,670,750,882円
期中一部解約元本額	17,872,703,441円	11,773,140,069円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファ ンド225	20,492,845,846円	25,285,506,759円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	349,458,715円	284,528,870円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	7,385,744,818円	8,019,187,520円
D-I's 日経225イン デックス	114,837,733円	101,546,677円
iFree 日経225イン デックス	5,573,145,682円	9,341,332,565円



	DC・ダイワ・ストックイン デックス225（確定拠出年 金専用ファンド）	5,431,588,581円	5,583,587,288円
	ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	305,581,482円	499,015,657円
	ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	3,793,099,418円	4,144,976,466円
	ダイワ日経225インデック ス（ダイワSMA専用）	116,453,431円	507,198,898円
	ダイワ・インデックスセレクト 日経225	6,644,237,625円	6,337,723,444円
	計	50,206,993,331円	60,104,604,144円
2.	期末日における受益権の総数	50,206,993,331口	60,104,604,144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 62,996,000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 3,511,184,000円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 3,274,570,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 3,127,850,000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3,819,950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10,876,700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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用 の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	37,566,639,983	23,892,814,207
合計	37,566,639,983	23,892,814,207

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年9月24日から2021年6月15日まで、及び2021年9月22日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	4,048,560,000	-	4,087,990,000	39,430,000	5,171,927,760	-	4,993,200,000	178,727,760
合計	4,048,560,000	-	4,087,990,000	39,430,000	5,171,927,760	-	4,993,200,000	178,727,760

(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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.8264円	3.4862円
(1万口当たり純資産額)	(38,264円)	(34,862円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

日本水産	273,000	531.00	144,963,000	貸付株式数	21,700株
マルハニチロ	27,300	2,320.00	63,336,000		
I N P E X	109,200	1,662.00	181,490,400	貸付株式数	36,000株
コムシスホールディングス	273,000	2,457.00	670,761,000		
大成建設	54,600	4,000.00	218,400,000		
大 林 組	273,000	951.00	259,623,000		
清水建設	273,000	716.00	195,468,000		
長谷工コーポレーション	54,600	1,559.00	85,121,400	貸付株式数	9,500株
鹿島建設	136,500	1,438.00	196,287,000		
大和ハウス	273,000	3,041.00	830,193,000		
積水ハウス	273,000	2,333.00	636,909,000		
日揮ホールディングス	273,000	1,873.00	511,329,000		
日清製粉G本社	273,000	1,499.00	409,227,000		
明治ホールディングス	54,600	6,210.00	339,066,000		
日本ハム	136,500	4,030.00	550,095,000		
エムスリー	655,200	3,566.00	2,336,443,200		
ディー・エヌ・エー	81,900	1,728.00	141,523,200		
サッポロホールディングス	54,600	2,764.00	150,914,400		
アサヒグループホールディングン	273,000	4,223.00	1,152,879,000	貸付株式数	90,000株
麒麟HD	273,000	2,033.00	555,009,000		
宝ホールディングス	273,000	950.00	259,350,000		
双日	27,300	2,028.00	55,364,400		
キッコーマン	273,000	6,650.00	1,815,450,000		
味の素	273,000	3,044.00	831,012,000		
ニチレイ	136,500	2,215.00	302,347,500		
日本たばこ産業	273,000	2,380.00	649,740,000	貸付株式数	90,000株
J. フロント リテイリング	136,500	1,113.00	151,924,500		
三越伊勢丹HD	273,000	1,040.00	283,920,000	貸付株式数	62,400株
東洋紡	27,300	1,020.00	27,846,000		
ユニチカ	27,300	230.00	6,279,000		
東急不動産HD	273,000	672.00	183,456,000		
セブン&アイ・HLDGS	273,000	5,206.00	1,421,238,000		
帝 人	54,600	1,384.00	75,566,400		
東 レ	273,000	704.20	192,246,600		
ク ラ レ	273,000	1,122.00	306,306,000		
旭 化 成	273,000	1,057.00	288,561,000		
SUMCO	27,300	2,021.00	55,173,300	貸付株式数	1,500株
ネクソン	546,000	2,932.00	1,600,872,000		

王子ホールディングス	273,000	563.00	153,699,000	貸付株式数	19,500株
日本製紙	27,300	946.00	25,825,800	貸付株式数	10,100株
昭和電工	27,300	2,577.00	70,352,100		
住友化学	273,000	555.00	151,515,000		
日産化学	273,000	6,710.00	1,831,830,000		
東ソー	136,500	1,787.00	243,925,500		
トクヤマ	54,600	1,813.00	98,989,800		
デンカ	54,600	3,320.00	181,272,000		
信越化学	273,000	17,300.00	4,722,900,000		
協和キリン	273,000	2,822.00	770,406,000	貸付株式数	91,400株
三井化学	54,600	3,150.00	171,990,000		
三菱ケミカルHLDGS	136,500	801.80	109,445,700		
UBE	27,300	2,088.00	57,002,400		
電通グループ	273,000	4,205.00	1,147,965,000		
花王	273,000	5,100.00	1,392,300,000	貸付株式数	92,200株
武田薬品	273,000	3,535.00	965,055,000		
アステラス製薬	1,365,000	1,995.00	2,723,175,000		
住友ファーマ	273,000	1,042.00	284,466,000		
塩野義製薬	273,000	6,493.00	1,772,589,000		
中外製薬	819,000	3,380.00	2,768,220,000	貸付株式数	219,800株
エーザイ	273,000	5,084.00	1,387,932,000	貸付株式数	36,100株
テルモ	1,092,000	3,827.00	4,179,084,000		
第一三共	819,000	3,081.00	2,523,339,000		
大塚ホールディングス	273,000	4,311.00	1,176,903,000		
DIC	27,300	2,505.00	68,386,500	貸付株式数	9,000株
Zホールディングス	109,200	396.50	43,297,800		
トレンドマイクロ	273,000	6,570.00	1,793,610,000		
サイバーエージェント	218,400	1,250.00	273,000,000		
楽天グループ	273,000	649.00	177,177,000	貸付株式数	101,200株
富士フイルムHLDGS	273,000	6,919.00	1,888,887,000		
コニカミノルタ	273,000	460.00	125,580,000		
資生堂	273,000	5,091.00	1,389,843,000	貸付株式数	2,000株
出光興産	109,200	3,550.00	387,660,000		
ENEOSホールディングス	273,000	538.70	147,065,100		
横浜ゴム	136,500	1,722.00	235,053,000		
ブリヂストン	273,000	5,065.00	1,382,745,000		
AGC	54,600	5,030.00	274,638,000		
日本板硝子	27,300	387.00	10,565,100	貸付株式数	100株
日本電気硝子	81,900	2,767.00	226,617,300		

住友大阪セメント	27,300	3,585.00	97,870,500	
太平洋セメント	27,300	2,059.00	56,210,700	
東海カーボン	273,000	1,163.00	317,499,000	
TOTO	136,500	4,265.00	582,172,500	
日本碍子	273,000	1,894.00	517,062,000	
日本製鉄	27,300	2,015.00	55,009,500	
神戸製鋼所	27,300	658.00	17,963,400	
JFEホールディングス	27,300	1,512.00	41,277,600	
大平洋金属	27,300	2,638.00	72,017,400	
日本製鋼所	54,600	3,085.00	168,441,000	
日本軽金属HD	27,300	1,526.00	41,659,800	貸付株式数 1,900株
三井金属	27,300	3,270.00	89,271,000	
東邦亜鉛	27,300	2,289.00	62,489,700	
三菱マテリアル	27,300	1,977.00	53,972,100	
住友鉱山	136,500	4,893.00	667,894,500	
DOWAホールディングス	54,600	4,555.00	248,703,000	
古河電工	27,300	2,232.00	60,933,600	
住友電工	273,000	1,453.50	396,805,500	
フジクラ	273,000	805.00	219,765,000	
リクルートホールディングス	819,000	4,017.00	3,289,923,000	
オークマ	54,600	5,380.00	293,748,000	
アマダ	273,000	1,039.00	283,647,000	
日本郵政	273,000	964.80	263,390,400	
小松製作所	273,000	3,302.00	901,446,000	
住友重機械	54,600	3,150.00	171,990,000	
日立建機	273,000	3,315.00	904,995,000	
クボタ	273,000	2,208.50	602,920,500	
荏原製作所	54,600	5,460.00	298,116,000	貸付株式数 500株
ダイキン工業	273,000	19,885.00	5,428,605,000	
日本精工	273,000	763.00	208,299,000	貸付株式数 50,000株
N T N	273,000	280.00	76,440,000	
ジェイテクト	273,000	1,058.00	288,834,000	
ミネベアミツミ	273,000	2,314.00	631,722,000	貸付株式数 52,000株
日立	54,600	6,675.00	364,455,000	
三菱電機	273,000	1,405.50	383,701,500	
富士電機	54,600	5,780.00	315,588,000	
安川電機	273,000	4,290.00	1,171,170,000	貸付株式数 5,500株
オムロン	273,000	6,699.00	1,828,827,000	
ジーエス・ユアサコーポ	54,600	2,113.00	115,369,800	貸付株式数 100株

日本電気	27,300	5,110.00	139,503,000	
富士通	27,300	17,100.00	466,830,000	
沖電気	27,300	792.00	21,621,600	
セイコーエプソン	546,000	2,168.00	1,183,728,000	
パナソニックホールディング	273,000	1,105.50	301,801,500	
シャープ	273,000	1,026.00	280,098,000	貸付株式数 98,200株
ソニーグループ	273,000	11,115.00	3,034,395,000	
T D K	819,000	4,385.00	3,591,315,000	
アルプスアルパイン	273,000	1,457.00	397,761,000	
横河電機	273,000	2,257.00	616,161,000	
アドバンテスト	546,000	7,730.00	4,220,580,000	
キーエンス	27,300	46,250.00	1,262,625,000	
デンソー	273,000	7,548.00	2,060,604,000	
カシオ	273,000	1,250.00	341,250,000	
ファナック	273,000	20,040.00	5,470,920,000	
京セラ	546,000	7,196.00	3,929,016,000	
太陽誘電	273,000	5,160.00	1,408,680,000	貸付株式数 3,900株
村田製作所	218,400	8,050.00	1,758,120,000	
日東電工	273,000	9,400.00	2,566,200,000	
三井E & S H D	27,300	358.00	9,773,400	貸付株式数 2,600株
日立造船	54,600	849.00	46,355,400	
三菱重工業	27,300	5,225.00	142,642,500	
川崎重工業	27,300	2,831.00	77,286,300	
I H I	27,300	3,920.00	107,016,000	貸付株式数 4,900株
コンコルディア・フィナン	273,000	467.00	127,491,000	
シャル				
日産自動車	273,000	533.60	145,672,800	
いすゞ自動車	136,500	1,571.00	214,441,500	
トヨタ自動車	1,365,000	2,080.00	2,839,200,000	
日野自動車	273,000	692.00	188,916,000	
三菱自動車工業	27,300	439.00	11,984,700	貸付株式数 9,300株
マツダ	54,600	1,107.00	60,442,200	
本田技研	546,000	3,305.00	1,804,530,000	
スズキ	273,000	4,035.00	1,101,555,000	
S U B A R U	273,000	2,447.50	668,167,500	
ヤマハ発動機	273,000	2,580.00	704,340,000	貸付株式数 90,000株
ニコン	273,000	1,669.00	455,637,000	
オリンパス	1,092,000	2,705.00	2,953,860,000	

SCREENホールディングス	54,600	10,440.00	570,024,000	貸付株式数	16,400株
キヤノン	409,500	3,251.00	1,331,284,500		
リコー	273,000	1,104.00	301,392,000		
シチズン時計	273,000	560.00	152,880,000		
バンダイナムコHLDGS	273,000	9,306.00	2,540,538,000	貸付株式数	6,800株
凸版印刷	136,500	2,336.00	318,864,000		
大日本印刷	136,500	2,878.00	392,847,000		
ヤマハ	273,000	5,320.00	1,452,360,000	貸付株式数	9,500株
任天堂	27,300	56,210.00	1,534,533,000		
伊藤忠	273,000	3,702.00	1,010,646,000		
丸紅	273,000	1,333.00	363,909,000		
豊田通商	273,000	4,785.00	1,306,305,000	貸付株式数	5,500株
三井物産	273,000	3,213.00	877,149,000		
東京エレクトロン	273,000	51,000.00	13,923,000,000		
住友商事	273,000	1,849.00	504,777,000		
三菱商事	273,000	4,383.00	1,196,559,000		
高島屋	136,500	1,278.00	174,447,000		
丸井グループ	273,000	2,271.00	619,983,000		
クレディセゾン	273,000	1,525.00	416,325,000		
イオン	273,000	2,172.00	592,956,000		
あおぞら銀行	27,300	2,649.00	72,317,700		
三菱UFJフィナンシャルG	273,000	740.20	202,074,600		
りそなホールディングス	27,300	510.20	13,928,460		
三井住友トラストHD	27,300	4,110.00	112,203,000		
三井住友フィナンシャルG	27,300	4,016.00	109,636,800		
千葉銀行	273,000	746.00	203,658,000		
ふくおかフィナンシャルG	54,600	2,472.00	134,971,200		
静岡銀行	273,000	809.00	220,857,000		
みずほフィナンシャルG	27,300	1,509.00	41,195,700		
オリックス	273,000	2,314.50	631,858,500		
大和証券G本社	273,000	615.60	168,058,800		
野村ホールディングス	273,000	490.00	133,770,000		
松井証券	273,000	809.00	220,857,000		
SOMPOホールディングス	54,600	5,914.00	322,904,400		
日本取引所グループ	273,000	2,076.50	566,884,500		
MS&AD	81,900	4,059.00	332,432,100		
第一生命HLDGS	27,300	2,645.00	72,208,500		



東京海上HD	136,500	7,435.00	1,014,877,500	
T & Dホールディングス	54,600	1,606.00	87,687,600	
三井不動産	273,000	2,888.00	788,424,000	貸付株式数 35,000株
三菱地所	273,000	1,936.50	528,664,500	
東京建物	136,500	1,707.00	233,005,500	貸付株式数 1,400株
住友不動産	273,000	3,485.00	951,405,000	
東武鉄道	54,600	2,965.00	161,889,000	
東急	136,500	1,480.00	202,020,000	
小田急電鉄	136,500	1,705.00	232,732,500	
京王電鉄	54,600	4,435.00	242,151,000	
京成電鉄	136,500	3,470.00	473,655,000	
東日本旅客鉄道	27,300	6,770.00	184,821,000	
西日本旅客鉄道	27,300	4,771.00	130,248,300	
東海旅客鉄道	27,300	15,410.00	420,693,000	
ヤマトホールディングス	273,000	2,079.00	567,567,000	
日本郵船	27,300	9,680.00	264,264,000	
商船三井	81,900	3,205.00	262,489,500	
川崎汽船	27,300	9,200.00	251,160,000	貸付株式数 1,000株
NIPPON EXPRESS	27,300	7,610.00	207,753,000	
ANAホールディングス	27,300	2,432.50	66,407,250	
三菱倉庫	136,500	3,180.00	434,070,000	
日本電信電話	109,200	3,824.00	417,580,800	
KDDI	1,638,000	4,353.00	7,130,214,000	
ソフトバンク	273,000	1,458.50	398,170,500	
東京電力HD	27,300	492.00	13,431,600	
中部電力	27,300	1,255.00	34,261,500	
関西電力	27,300	1,254.00	34,234,200	
東京瓦斯	54,600	2,615.00	142,779,000	
大阪瓦斯	54,600	2,420.00	132,132,000	
東宝	27,300	4,810.00	131,313,000	
NTTデータ	1,365,000	1,859.00	2,537,535,000	
セコム	273,000	8,106.00	2,212,938,000	
コナミホールディングス	273,000	7,840.00	2,140,320,000	
ファーストリテイリング	273,000	67,140.00	18,329,220,000	
ソフトバンクグループ	1,638,000	5,028.00	8,235,864,000	
合計			204,507,294,810	

(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。

武田薬品	50,000株	ファナック	30,000株
ファーストリテイリング	35,000株		

(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 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	168,541,696	150,841,916
親投資信託受益証券	56,157,391,602	53,707,123,797
未収入金	-	7,940,000
流動資産合計	56,325,933,298	53,865,905,713
資産合計	56,325,933,298	53,865,905,713
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	43,752,850	15,602,369
未払受託者報酬	5,700,688	6,572,608
未払委託者報酬	109,738,889	126,523,589
その他未払費用	1,094,965	1,097,191
流動負債合計	160,287,392	149,795,757
負債合計	160,287,392	149,795,757
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 31,520,778,793	1 34,566,355,532
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,644,867,113	19,149,754,424
（分配準備積立金）	16,009,844,543	12,812,314,874
元本等合計	56,165,645,906	53,716,109,956
純資産合計	56,165,645,906	53,716,109,956
負債純資産合計	56,325,933,298	53,865,905,713

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
営業収益				
受取利息		156		3
有価証券売買等損益		16,226,297,449		7,521,490,805
営業収益合計		16,226,297,605		7,521,490,802
営業費用				
支払利息		31,386		31,407
受託者報酬		10,754,065		13,175,173
委託者報酬		207,017,164		253,623,681
その他費用		2,200,605		2,195,959
営業費用合計		220,003,220		269,026,220
営業利益又は営業損失（ ）		16,006,294,385		7,790,517,022
経常利益又は経常損失（ ）		16,006,294,385		7,790,517,022
当期純利益又は当期純損失（ ）		16,006,294,385		7,790,517,022
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		2,100,573,268		384,653,426
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,333,669,055		24,644,867,113
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,248,391,372		8,428,972,546
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,248,391,372		8,428,972,546
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,842,914,431		5,748,914,787
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,842,914,431		5,748,914,787
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		24,644,867,113		19,149,754,424

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	33,035,419,266円	31,520,778,793円
期中追加設定元本額	7,978,557,364円	10,317,685,523円
期中一部解約元本額	9,493,197,837円	7,272,108,784円
2. 計算期間末日における受益権の総数	31,520,778,793口	34,566,355,532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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(13,905,717,834円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,635,049,638円)及び分配準備積立金(2,104,126,709円)より分配対象額は24,644,894,181円(1万口当たり7,818.62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(9,401,109,949円)及び分配準備積立金(12,812,314,874円)より分配対象額は22,213,424,823円(1万口当たり6,426.31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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	14,983,780,922	7,803,763,568
合計	14,983,780,922	7,803,763,568

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在



1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7819円 (17,819円)	1.5540円 (15,540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	22,230,689,928	53,707,123,797	
親投資信託受益証券 合計			53,707,123,797	
合計			53,707,123,797	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		161,762,026	404,940,853
コール・ローン		1,843,049,943	3,433,965,761
株式		69,671,218,917	69,571,750,406
投資証券		1,748,776,321	1,814,081,515
派生商品評価勘定		108,767,111	10,680,421
未収入金		990,365	529,873
未収配当金		76,236,982	96,596,727
差入委託証拠金		705,286,060	1,054,162,540
流動資産合計		74,316,087,725	76,386,708,096
資産合計		74,316,087,725	76,386,708,096
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		346,246,305	3,002,632,161
未払解約金		21,130,000	875,641,000
流動負債合計		367,376,305	3,878,273,161
負債合計		367,376,305	3,878,273,161
純資産の部			
元本等			
元本	1	26,814,400,442	30,012,407,804
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		47,134,310,978	42,496,027,131
元本等合計		73,948,711,420	72,508,434,935
純資産合計		73,948,711,420	72,508,434,935
負債純資産合計		74,316,087,725	76,386,708,096

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	27,661,024,245円	26,814,400,442円
期中追加設定元本額	6,399,270,276円	7,690,279,088円
期中一部解約元本額	7,245,894,079円	4,492,271,726円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	20,363,112,482円	22,230,689,928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）	1,111,188,228円	1,602,819,096円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,222,163,129円	1,997,899,403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	347,331円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	4,117,936,603円	4,180,652,046円
計	26,814,400,442円	30,012,407,804円
2. 期末日における受益権の総数	26,814,400,442口	30,012,407,804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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	6,733,279,694	15,576,344,404
投資証券	346,735,230	409,358,772
合計	7,080,014,924	15,985,703,176

（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6月15日まで、及び2022年1月12日から2022年6月15日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	2,657,529,237	-	2,735,854,506	78,325,269	4,371,032,936	-	4,355,210,136	15,822,800
合計	2,657,529,237	-	2,735,854,506	78,325,269	4,371,032,936	-	4,355,210,136	15,822,800

（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6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外 の取引								
為替予約取引								
売 建	70,650,034,812	-	70,965,839,275	315,804,463	78,471,595,651	-	81,447,724,591	2,976,128,940
アメリカ・ドル	50,399,360,536	-	50,723,337,204	323,976,668	57,084,762,068	-	59,792,034,943	2,707,272,875
イギリス・ ポンド	3,347,763,278	-	3,341,746,511	6,016,767	3,665,929,412	-	3,659,681,027	6,248,385
イスラエル・ シケル	87,605,733	-	88,444,830	839,097	120,784,186	-	121,141,353	357,167
オーストラリ ア・ドル	1,655,400,035	-	1,658,293,852	2,893,817	1,954,293,253	-	1,962,013,730	7,720,477
カナダ・ドル	2,598,983,801	-	2,597,496,092	1,487,709	3,123,263,866	-	3,193,486,217	70,222,351
シンガポー ル・ドル	257,321,092	-	257,609,565	288,473	288,140,606	-	296,982,245	8,841,639
スイス・ フラン	2,161,493,853	-	2,172,767,450	11,273,597	2,334,037,965	-	2,345,227,523	11,189,558
スウェーデ ン・クローナ	886,941,117	-	888,501,224	1,560,107	898,452,039	-	900,982,985	2,530,946
デンマーク・ クローネ	587,514,896	-	586,078,270	1,436,626	651,333,114	-	663,013,785	11,680,671
ニュージー ランド・ドル	50,962,181	-	50,334,431	627,750	42,825,720	-	42,754,677	71,043
ノルウェー・ クローネ	154,512,827	-	155,140,666	627,839	196,892,418	-	193,173,815	3,718,603
ユーロ	7,698,269,652	-	7,677,522,994	20,746,658	7,402,471,078	-	7,535,508,267	133,037,189
香港・ドル	763,905,811	-	768,566,186	4,660,375	708,409,926	-	741,724,024	33,314,098
合計	70,650,034,812	-	70,965,839,275	315,804,463	78,471,595,651	-	81,447,724,591	2,976,128,940

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7578円 (27,578円)	2.4159円 (24,159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	1,295	134.420	174,073.900	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,166	481.630	561,580.580	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,063	135.170	278,855.710	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	82.020	130,739.880	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	143.060	106,722.760	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,330	29.510	186,798.300	
	ABBOTT LABORATORIES	20,445	102.940	2,104,608.300	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	32.200	127,190.000	
	VERISK ANALYTICS INC	2,140	158.230	338,612.200	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,880	32.270	125,207.600	
AMPHENOL CORP-CL A	6,905	65.530	452,484.650		



MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	500	407.160	203,580.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,934	95.250	660,463.500	
QORVO INC	1,283	96.660	124,014.780	
AFLAC INC	7,340	53.710	394,231.400	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,506	114.030	171,729.180	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	84.940	155,864.900	
ADOBE INC	5,515	370.820	2,045,072.300	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,429	93.250	226,504.250	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,407	280.500	394,663.500	
GARMIN LTD	1,724	96.720	166,745.280	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,466	239.220	589,916.520	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,105	183.280	1,485,484.400	
WR BERKLEY CORP	2,656	66.740	177,261.440	
AUTOZONE INC	232	2,033.580	471,790.560	
DOLLAR TREE INC	2,566	156.020	400,347.320	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	7.850	97,065.250	
CELANESE CORP	1,211	136.210	164,950.310	
DR HORTON INC	3,792	65.720	249,210.240	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	35.590	87,195.500	
AUTODESK INC	2,507	171.590	430,176.130	
MOODY'S CORP	1,884	257.680	485,469.120	
DEVON ENERGY CORP	7,276	70.590	513,612.840	
ALBEMARLE CORP	1,324	223.330	295,688.920	
ATMOS ENERGY CORP	1,985	105.540	209,496.900	
ALLIANT ENERGY CORP	2,870	55.610	159,600.700	
CITIGROUP INC	23,548	45.960	1,082,266.080	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,058	204.130	1,032,489.540	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,649	90.440	510,895.560	
ALLEGHANY CORP	146	832.000	121,472.000	
DOMINO'S PIZZA INC	407	377.130	153,491.910	
HESS CORP	3,231	120.070	387,946.170	
DAVITA INC	709	89.970	63,788.730	
DANAHER CORP	7,826	242.420	1,897,178.920	
FORTIVE CORP	3,794	56.070	212,729.580	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	6,376	94.050	599,662.800	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,303	82.670	521,069.010	
BUNGE LTD	1,693	104.350	176,664.550	
TE CONNECTIVITY LTD	3,750	118.390	443,962.500	
APPLE INC	188,224	132.760	24,988,618.240	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,387	91.840	311,062.080	
BOEING CO/THE	6,267	122.160	765,576.720	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,741	116.420	202,687.220	
BECTON DICKINSON AND CO	3,452	236.320	815,776.640	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	97.910	137,074.000	
NISOURCE INC	6,299	27.600	173,852.400	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	106.350	149,315.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,905	40.600	361,543.000	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	47,895	49.160	2,354,518.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	14,859	277.640	4,125,452.760	
ANSYS INC	993	229.760	228,151.680	
TRUIST FINANCIAL CORP	14,934	46.240	690,548.160	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	8,822	95.420	841,795.240	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,785	72.870	1,806,082.950	
JPMORGAN CHASE & CO	33,697	114.060	3,843,479.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,988	107.680	321,747.840	
LKQ CORP	3,300	48.520	160,116.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,665	65.160	238,811.400	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,149	143.390	451,535.110	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,269	243.070	308,455.830	
DOLLAR GENERAL CORP	2,646	230.020	608,632.920	
SERVICENOW INC	2,412	444.750	1,072,737.000	
CATERPILLAR INC	6,068	206.690	1,254,194.920	
BROWN & BROWN INC	2,752	54.660	150,424.320	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,767	41.840	115,771.280	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	209.500	120,253.000	
CMS ENERGY CORP	3,384	62.520	211,567.680	
MOSAIC CO/THE	4,285	52.730	225,948.050	
DELTA AIR LINES INC	1,358	31.380	42,614.040	
CORNING INC	9,115	32.100	292,591.500	
CISCO SYSTEMS INC	47,334	42.910	2,031,101.940	
MORGAN STANLEY	15,047	74.960	1,127,923.120	
MSCI INC	938	391.000	366,758.000	
FAIR ISAAC CORP	325	379.410	123,308.250	

LENNOX INTERNATIONAL INC	322	195.490	62,947.780
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,780	57.060	158,626.800
BROADCOM INC	4,746	520.170	2,468,726.820
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,416	133.520	189,064.320
ARAMARK	3,173	30.330	96,237.090
DTE ENERGY COMPANY	2,162	119.110	257,515.820
CENTENE CORP	6,539	76.230	498,467.970
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,231	107.520	132,357.120
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,682	35.660	238,280.120
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,334	153.230	357,638.820
GARTNER INC	935	234.600	219,351.000
SPLUNK INC	1,921	86.470	166,108.870
DOMINION ENERGY INC	9,190	74.600	685,574.000
MONSTER BEVERAGE CORP	4,342	88.060	382,356.520
SMITH (A.O.) CORP	1,400	55.640	77,896.000
DEERE & CO	3,311	326.580	1,081,306.380
QUANTA SERVICES INC	1,657	123.550	204,722.350
POOL CORP	438	349.440	153,054.720
GLOBAL PAYMENTS INC	3,297	112.150	369,758.550
VMWARE INC-CLASS A	2,485	121.320	301,480.200
CABLE ONE INC	60	1,223.850	73,431.000
BURLINGTON STORES INC	766	158.430	121,357.380
NASDAQ INC	1,328	145.870	193,715.360
VAIL RESORTS INC	492	230.860	113,583.120
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	6,360	11.920	75,811.200
TARGA RESOURCES CORP	2,816	66.300	186,700.800
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	132.010	115,376.740
WESTLAKE CORP	572	114.370	65,419.640
CONSOLIDATED EDISON INC	3,999	88.780	355,031.220
COGNEX CORP	1,994	43.020	85,781.880
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,200	45.060	99,132.000
TELEFLEX INC	563	252.510	142,163.130
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	979	161.420	158,030.180
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	852	280.610	239,079.720
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	469.960	113,260.360
CATALENT INC	1,863	104.290	194,292.270
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,660	179.320	297,671.200

MOLINA HEALTHCARE INC	690	261.690	180,566.100
IDEX CORP	869	179.410	155,907.290
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,891	74.270	660,334.570
ROLLINS INC	2,685	32.780	88,014.300
AMETEK INC	2,597	111.340	289,149.980
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,707	82.000	221,974.000
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,644	45.170	74,259.480
HEICO CORP	535	133.390	71,363.650
GENERAC HOLDINGS INC	716	240.150	171,947.400
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	399	350.720	139,937.280
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,045	97.480	296,826.600
TYLER TECHNOLOGIES INC	467	310.580	145,040.860
COSTCO WHOLESALE CORP	5,111	454.800	2,324,482.800
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	71.230	80,347.440
EPAM SYSTEMS INC	624	278.360	173,696.640
RPM INTERNATIONAL INC	1,587	77.740	123,373.380
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	318	1,204.010	382,875.180
UGI CORP	2,085	39.710	82,795.350
CUMMINS INC	1,604	196.610	315,362.440
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,874	74.640	662,355.360
CDW CORP/DE	1,567	162.500	254,637.500
SIGNATURE BANK	692	178.060	123,217.520
COSTAR GROUP INC	4,691	55.170	258,802.470
SVB FINANCIAL GROUP	677	406.390	275,126.030
AMERCO	119	464.380	55,261.220
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,077	239.470	257,909.190
MERCADOLIBRE INC	536	616.400	330,390.400
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	177.110	148,241.070
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,186	119.140	379,580.040
DEXCOM INC	4,416	69.310	306,072.960
NORDSON CORP	595	200.820	119,487.900
COPART INC	2,384	103.590	246,958.560
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,952	149.630	292,077.760
SEAGEN INC	1,545	144.640	223,468.800
ALIGN TECHNOLOGY INC	831	238.080	197,844.480
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	971	188.530	183,062.630
TRANSDIGM GROUP INC	587	527.650	309,730.550

BIO-TECHNE CORP	430	324.180	139,397.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,203	91.220	109,737.660	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,560	81.270	208,051.200	
KINDER MORGAN INC	23,108	17.890	413,402.120	
HCA HEALTHCARE INC	2,839	179.280	508,975.920	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	268.480	112,761.600	
COTERRA ENERGY INC	10,527	31.110	327,494.970	
T-MOBILE US INC	7,550	124.900	942,995.000	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	30.190	53,919.340	
COCA-COLA CO/THE	47,206	59.230	2,796,011.380	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	50.680	130,501.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	98.600	189,805.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	23.080	88,881.080	
CSX CORP	25,287	29.340	741,920.580	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,044	213.860	223,269.840	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	101.930	159,316.590	
AMAZON.COM INC	105,740	102.310	10,818,259.400	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,032	86.500	608,268.000	
EXXON MOBIL CORP	48,682	96.100	4,678,340.200	
AES CORP	7,455	18.910	140,974.050	
EVEREST RE GROUP LTD	433	272.670	118,066.110	
EOG RESOURCES INC	6,593	131.260	865,397.180	
EQT CORP	4,584	40.830	187,164.720	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,914	89.300	170,920.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	157	622.750	97,771.750	
ABIOMED INC	512	229.660	117,585.920	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,773	141.210	250,365.330	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,422	116.010	396,986.220	
FORD MOTOR CO	44,666	12.200	544,925.200	
EXACT SCIENCES CORP	2,219	37.140	82,413.660	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	21.450	51,823.200	
ENTEGRIS INC	1,700	98.760	167,892.000	
AERCAP HOLDINGS NV	1,700	39.630	67,371.000	
FORTINET INC	1,595	269.230	429,421.850	
MARKEL CORP	159	1,296.650	206,167.350	
NEXTERA ENERGY INC	22,973	71.480	1,642,110.040	
MASIMO CORP	693	123.060	85,280.580	

FREEMPORT-MCMORAN INC	16,520	36.820	608,266.400	
INSULET CORP	769	205.550	158,067.950	
US BANCORP	15,918	45.720	727,770.960	
UNITED RENTALS INC	826	260.120	214,859.120	
F5 NETWORKS INC	659	150.790	99,370.610	
FASTENAL CO	6,530	49.130	320,818.900	
FISERV INC	7,414	89.890	666,444.460	
GENERAL ELECTRIC CO	13,241	68.050	901,050.050	
GENERAL MOTORS CO	16,752	33.200	556,166.400	
ZENDESK INC	1,305	57.010	74,398.050	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,738	215.900	591,134.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,992	282.540	1,127,899.680	
ALPHABET INC-CL A	3,484	2,134.310	7,435,936.040	
ALPHABET INC-CL C	3,264	2,143.880	6,997,624.320	
OWENS CORNING	1,193	82.660	98,613.380	
GENERAL MILLS INC	6,911	66.450	459,235.950	
FIRSTENERGY CORP	5,840	38.390	224,197.600	
GENUINE PARTS CO	1,626	132.440	215,347.440	
FIFTH THIRD BANCORP	8,100	34.580	280,098.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,191	226.920	497,181.720	
HALLIBURTON CO	10,230	36.670	375,134.100	
HOME DEPOT INC	11,983	278.670	3,339,302.610	
ASSURANT INC	593	176.010	104,373.930	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	16,920	12.240	207,100.800	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	500	204.810	102,405.000	
HERSHEY CO/THE	1,616	206.790	334,172.640	
HUMANA INC	1,451	423.930	615,122.430	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,985	168.290	502,345.650	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	48.690	44,648.730	
HENRY SCHEIN INC	1,491	75.000	111,825.000	
HP INC	13,253	33.750	447,288.750	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,115	13.670	192,952.050	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	681	36.220	24,665.820	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	2,262	58.120	131,467.440	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	36.280	73,575.840	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,274	44.550	190,406.700	
KRAFT HEINZ CO/THE	9,336	36.140	337,403.040	
ENPHASE ENERGY INC	1,386	179.520	248,814.720	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,597	135.720	1,438,224.840	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	43.620	176,530.140	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	61.320	91,980.000	
ZOETIS INC	5,361	157.800	845,965.800	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,687	126.680	340,389.160	
CHENIERE ENERGY INC	2,836	130.520	370,154.720	
ALLEGION PLC	1,110	101.270	112,409.700	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	3,341	22.510	75,205.910	
WASTE CONNECTIONS INC	2,895	117.360	339,757.200	
JUNIPER NETWORKS INC	4,000	28.320	113,280.000	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	125.360	153,566.000	
JOHNSON & JOHNSON	29,974	168.190	5,041,327.060	
PLUG POWER INC	6,251	14.200	88,764.200	
ABBVIE INC	20,359	137.620	2,801,805.580	
HOLOGIC INC	2,801	67.870	190,103.870	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,765	123.310	464,262.150	
KROGER CO	8,090	50.390	407,655.100	
KLA CORP	1,719	316.470	544,011.930	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,802	416.170	1,166,108.340	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	840	227.040	190,713.600	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	32.800	94,201.600	
LOWE'S COS INC	7,929	177.940	1,410,886.260	
ELI LILLY & CO	9,367	290.790	2,723,829.930	
LAM RESEARCH CORP	1,600	449.770	719,632.000	
LOEWS CORP	2,365	58.540	138,447.100	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,981	48.320	95,721.920	
MCDONALD'S CORP	8,668	238.760	2,069,571.680	
3M CO	6,477	135.250	876,014.250	
META PLATFORMS INC CLASS A	26,549	163.730	4,346,867.770	
S&P GLOBAL INC	4,171	317.430	1,324,000.530	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	682	316.470	215,832.540	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	575	264.630	152,162.250	
ALCOA CORP	2,404	48.920	117,603.680	
PHILLIPS 66	5,402	104.130	562,510.260	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,519	29.400	132,858.600	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,821	83.800	236,399.800	
METLIFE INC	8,154	61.860	504,406.440	
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,088	48.520	537,989.760	
ARISTA NETWORKS INC	2,599	91.930	238,926.070	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,904	203.310	387,102.240	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	260	1,157.630	300,983.800	
BAKER HUGHES CO	11,687	32.930	384,852.910	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,340	200.420	268,562.800	
MERCK & CO. INC.	29,104	84.500	2,459,288.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,974	60.370	360,650.380	
MASCO CORP	2,731	51.210	139,854.510	
M & T BANK CORP	1,848	164.900	304,735.200	
MARSH & MCLENNAN COS	6,119	147.260	901,083.940	
BLACK KNIGHT INC	1,644	64.420	105,906.480	
HEICO CORP-CLASS A	754	108.060	81,477.240	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,157	152.220	480,558.540	
WORKDAY INC-CLASS A	2,275	139.380	317,089.500	
WAYFAIR INC- CLASS A	880	47.140	41,483.200	
BLOCK INC CLASS A	5,991	60.300	361,257.300	
TRANSUNION	2,293	77.330	177,317.690	
VISTRA CORP	4,285	22.960	98,383.600	
NOVOCURE LTD	1,054	59.870	63,102.980	
NETAPP INC	2,703	64.320	173,856.960	
NIKE INC -CL B	14,992	110.720	1,659,914.240	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,746	222.810	611,836.260	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,214	60.950	378,743.300	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,146	86.780	186,229.880	
ALLY FINANCIAL INC	4,351	34.080	148,282.080	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,691	454.460	768,491.860	
APTIV PLC	3,063	94.920	290,739.960	
NEWMONT CORP	9,913	63.090	625,411.170	
MCKESSON CORP	1,702	306.520	521,697.040	
XYLEM INC	1,972	76.500	150,858.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,138	98.970	1,795,117.860	
NUCOR CORP	3,207	113.720	364,700.040	
WESTERN UNION CO	4,350	16.460	71,601.000	



GODADDY INC - CLASS A	1,930	66.360	128,074.800	
NEWELL BRANDS INC	4,058	18.470	74,951.260	
EVERGY INC	2,654	61.320	162,743.280	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,488	62.090	651,199.920	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	173.040	46,547.760	
OKTA INC	1,634	81.470	133,121.980	
COUPA SOFTWARE INC	880	53.410	47,000.800	
LIBERTY BROADBAND-C	1,614	113.590	183,334.260	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	20.900	101,929.300	
LINDE PLC	5,288	295.620	1,563,238.560	
WIX.COM LTD	785	55.590	43,638.150	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,293	26.210	112,519.530	
KKR & CO INC	7,584	47.100	357,206.400	
PAYCHEX INC	3,657	117.470	429,587.790	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	756	596.690	451,097.640	
ALTRIA GROUP INC	20,646	46.290	955,703.340	
P G & E CORP	17,368	9.960	172,985.280	
PFIZER INC	64,911	47.920	3,110,535.120	
CIGNA CORP	3,711	245.710	911,829.810	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	47.350	155,118.600	
XCEL ENERGY INC	6,988	65.880	460,369.440	
STERIS PLC	1,173	203.670	238,904.910	
SEA LTD-ADR	5,100	70.950	361,845.000	
FOX CORP - CLASS B	1,530	29.650	45,364.500	
FOX CORP - CLASS A	3,831	32.030	122,706.930	
STRYKER CORP	3,815	200.580	765,212.700	
LYFT INC-A	3,191	14.160	45,184.560	
DOW INC	8,299	58.560	485,989.440	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,130	64.740	73,156.200	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,574	106.860	275,057.640	
PARKER HANNIFIN CORP	1,423	252.630	359,492.490	
UBER TECHNOLOGIES INC	17,253	21.090	363,865.770	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,589	264.550	684,919.950	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	27,598	133.840	3,693,716.320	
EXELON CORP	11,150	42.310	471,756.500	
TELADOC HEALTH INC	1,618	29.270	47,358.860	
INGERSOLL-RAND INC	5,897	43.770	258,111.690	

NVR INC	37	3,905.080	144,487.960	
CONOCOPHILLIPS	14,809	111.490	1,651,055.410	
TWILIO INC - A	2,053	81.860	168,058.580	
DOCUSIGN INC	2,333	57.280	133,634.240	
PAYCOM SOFTWARE INC	601	270.450	162,540.450	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	45.160	66,385.200	
PEPSICO INC	15,888	156.120	2,480,434.560	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	119.470	48,863.230	
DROPBOX INC-CLASS A	3,743	20.550	76,918.650	
MONGODB INC	712	241.000	171,592.000	
SNAP INC - A	12,910	11.910	153,758.100	
CORTEVA INC	8,198	56.390	462,285.220	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,285	94.140	403,389.900	
AMCOR PLC	17,457	12.090	211,055.130	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,336	159.260	372,031.360	
ROKU INC	1,417	74.290	105,268.930	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	133.470	279,219.240	
ACCENTURE PLC-CL A	7,342	275.120	2,019,931.040	
KORNIT DIGITAL LTD	600	33.950	20,370.000	
PENTAIR PLC	1,575	45.860	72,229.500	
QUALCOMM INC	13,095	130.260	1,705,754.700	
INVESCO LTD	3,700	16.240	60,088.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	664	171.480	113,862.720	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	63.940	204,160.420	
DATADOG INC - CLASS A	2,587	87.110	225,353.570	
PINTEREST INC- CLASS A	6,763	17.190	116,255.970	
AVALARA INC	1,047	69.760	73,038.720	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,277	548.350	700,242.950	
REPUBLIC SERVICES INC	2,468	123.060	303,712.080	
BOOKING HOLDINGS INC	461	1,951.510	899,646.110	
ROSS STORES INC	4,110	74.000	304,140.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	147.230	146,935.540	
RESMED INC	1,660	202.010	335,336.600	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	127.070	168,621.890	
ROBERT HALF INTL INC	1,209	81.430	98,448.870	
MODERNA INC	3,910	121.560	475,299.600	
HUBSPOT INC	564	295.850	166,859.400	

PERKINELMER INC	1,760	138.140	243,126.400
CARRIER GLOBAL CORP	11,161	35.940	401,126.340
OTIS WORLDWIDE CORP	4,520	69.210	312,829.200
BILL.COM HOLDINGS INC	900	105.970	95,373.000
AVANTOR INC	6,686	29.720	198,707.920
CARLYLE GROUP INC/THE	1,836	33.190	60,936.840
DYNATRACE INC	2,339	38.820	90,799.980
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,191	45.400	235,671.400
REGIONS FINANCIAL CORP	10,825	19.350	209,463.750
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	3,364	31.070	104,519.480
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,176	38.200	159,523.200
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	78.840	80,495.640
MATCH GROUP INC	3,162	73.070	231,047.340
CHEVRON CORP	22,404	167.550	3,753,790.200
PELTON INTERACTIVE INC-A	3,174	9.580	30,406.920
ZSCALER INC	985	142.110	139,978.350
EDISON INTERNATIONAL	4,365	60.980	266,177.700
ETSY INC	1,409	71.610	100,898.490
TESLA INC	10,152	662.670	6,727,425.840
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,502	113.870	284,902.740
NORTONLIFELOCK INC	6,767	21.990	148,806.330
UNITY SOFTWARE INC	2,986	33.760	100,807.360
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,895	106.770	202,329.150
SYNOPSYS INC	1,716	295.160	506,494.560
CARVANA CO	964	20.920	20,166.880
CHEWY INC - CLASS A	856	27.050	23,154.800
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,113	40.790	126,979.270
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,427	451.970	644,961.190
VIATRIS INC	13,745	10.320	141,848.400
DOORDASH INC - A	2,683	58.460	156,848.180
ROBLOX CORP -CLASS A	4,945	26.120	129,163.400
AIRBNB INC-CLASS A	4,329	98.870	428,008.230
CBRE GROUP INC - A	3,849	70.580	271,662.420
TWITTER INC	9,007	37.220	335,240.540
SOUTHERN CO/THE	11,875	66.780	793,012.500
SYSCO CORP	5,747	80.140	460,564.580
TRAVELERS COS INC/THE	2,780	166.310	462,341.800
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	43.830	26,298.000

SEI INVESTMENTS COMPANY	956	52.860	50,534.160	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	71.020	163,346.000	
SCHLUMBERGER LTD	15,794	43.220	682,616.680	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	43.540	88,212.040	
AFFIRM HOLDINGS INC	2,035	17.700	36,019.500	
AT&T INC	83,615	19.450	1,626,311.750	
APA CORP	4,354	46.000	200,284.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,008	37.220	37,517.760	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,137	56.650	291,011.050	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,388	39.390	94,063.320	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,830	229.480	649,428.400	
SEMPRA ENERGY	3,602	144.820	521,641.640	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	30.830	69,799.120	
CLARIVATE PLC	4,721	13.210	62,364.410	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,770	7.820	154,601.400	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,240	75.630	169,411.200	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,657	51.580	85,468.060	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,778	154.080	1,660,674.240	
SALESFORCE.COM INC	11,510	164.450	1,892,819.500	
WESTROCK CO	2,971	42.770	127,069.670	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,549	49.360	273,898.640	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,932	49.600	393,427.200	
TERADYNE INC	1,827	90.910	166,092.570	
UNION PACIFIC CORP	7,220	208.490	1,505,297.800	
MARATHON OIL CORP	9,323	28.790	268,409.170	
MARATHON PETROLEUM CORP	6,855	102.670	703,802.850	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	17,523	91.320	1,600,200.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,580	174.160	1,494,292.800	
IQVIA HOLDINGS INC	2,141	200.880	430,084.080	
AMEREN CORPORATION	2,861	83.300	238,321.300	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,772	461.750	4,973,971.000	
APPLOVIN CORP CLASS A	2,144	32.350	69,358.400	
VERISIGN INC	1,210	161.180	195,027.800	
LUCID GROUP INC	5,100	16.600	84,660.000	

RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO)	2,200	27.300	60,060.000	
VALERO ENERGY CORP	4,584	133.750	613,110.000	
UPSTART HOLDINGS INC	200	34.270	6,854.000	
ULTA BEAUTY INC	550	392.670	215,968.500	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	37.380	112,439.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	104.870	80,435.290	
ANTHEM INC	2,719	460.400	1,251,827.600	
WALT DISNEY CO/THE	21,190	94.220	1,996,521.800	
WELLS FARGO & CO	44,785	37.430	1,676,302.550	
WASTE MANAGEMENT INC	4,670	145.620	680,045.400	
WILLIAMS COS INC	13,622	32.340	440,535.480	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,249	192.170	240,020.330	
WHIRLPOOL CORP	686	155.360	106,576.960	
WALMART INC	17,841	119.460	2,131,285.860	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,348	105.270	247,173.960	
WYNN RESORTS LTD	1,145	58.010	66,421.450	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	13,900	2.450	34,055.000	
WABTEC CORP	1,898	86.320	163,835.360	
TJX COMPANIES INC	13,504	57.330	774,184.320	
WATERS CORP	699	321.490	224,721.510	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	571	300.740	171,722.540	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,988	40.200	321,117.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,400	194.870	272,818.000	
WESTERN DIGITAL CORP	3,531	49.240	173,866.440	
WEC ENERGY GROUP INC	3,650	92.050	335,982.500	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,855	60.970	356,979.350	
VISA INC-CLASS A SHARES	19,079	193.520	3,692,168.080	
PPL CORP	8,360	26.030	217,610.800	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	3,696	54.440	201,210.240	
PULTEGROUP INC	2,795	39.880	111,464.600	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	25,013	13.980	349,681.740	
PPG INDUSTRIES INC	2,680	111.510	298,846.800	
NORTHERN TRUST CORP	2,260	93.600	211,536.000	
NVIDIA CORP	28,863	158.360	4,570,744.680	

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,869	155.660	757,908.540	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	1,177	49.950	58,791.150	
TYSON FOODS INC-CL A	3,322	83.920	278,782.240	
NETFLIX INC	4,977	167.540	833,846.580	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,547	507.450	2,307,375.150	
NRG ENERGY INC	3,000	39.420	118,260.000	
GLOBE LIFE INC	1,215	89.450	108,681.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,067	136.960	283,096.320	
TEXTRON INC	2,388	60.190	143,733.720	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	15.550	58,296.950	
OMNICOM GROUP	2,546	64.950	165,362.700	
ORACLE CORP	18,458	70.720	1,305,349.760	
MASTERCARD INC - A	10,048	322.140	3,236,862.720	
ONEOK INC	5,033	60.390	303,942.870	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	11,062	10.590	117,146.580	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,195	380.660	454,888.700	
YUM! BRANDS INC	3,275	110.230	361,003.250	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,069	121.410	251,197.290	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,206	51.360	113,300.160	
BANK OF AMERICA CORP	84,745	31.460	2,666,077.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	523	364.830	190,806.090	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,263	71.480	161,759.240	
AMERICAN EXPRESS CO	7,447	144.600	1,076,836.200	
ANALOG DEVICES INC	6,005	147.170	883,755.850	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,080	86.990	1,659,769.200	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,209	52.020	479,052.180	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,940	92.760	179,954.400	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,609	39.490	103,029.410	
AVERY DENNISON CORP	929	161.090	149,652.610	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,954	67.870	404,097.980	
EMERSON ELECTRIC CO	6,786	84.700	574,774.200	
AON PLC-CLASS A	2,500	251.130	627,825.000	
AMGEN INC	6,617	235.700	1,559,626.900	
EATON CORP PLC	5,005	130.520	653,252.600	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,859	231.500	430,358.500	
APPLIED MATERIALS INC	10,147	96.620	980,403.140	
CME GROUP INC	4,078	196.110	799,736.580	
ECOLAB INC	2,918	150.280	438,517.040	
EQUIFAX INC	1,357	172.020	233,431.140	
GILEAD SCIENCES INC	14,313	57.790	827,148.270	
KEURIG DR PEPPER INC	9,975	34.400	343,140.000	
HORMEL FOODS CORP	3,315	45.120	149,572.800	
STATE STREET CORP	4,152	62.180	258,171.360	
SCHWAB (CHARLES) CORP	17,313	61.110	1,057,997.430	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,665	67.480	382,274.200	
CAMPBELL SOUP CO	2,166	45.440	98,423.040	
CROWN HOLDINGS INC	1,597	94.020	150,149.940	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	51.110	169,634.090	
FEDEX CORP	2,831	229.950	650,988.450	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,873	106.580	519,364.340	
FMC CORP	1,360	107.920	146,771.200	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,748	117.170	321,983.160	
CITRIX SYSTEMS INC	1,412	92.410	130,482.920	
INTEL CORP	47,282	37.930	1,793,406.260	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,318	27.780	119,954.040	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,970	66.600	264,402.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,567	185.930	663,212.310	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,227	5.930	60,646.110	
ILLUMINA INC	1,689	189.410	319,913.490	
SEALED AIR CORP	1,450	58.580	84,941.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,334	191.100	828,227.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,330	121.450	161,528.500	
SNAP-ON INC	623	205.570	128,070.110	
CARMAX INC	1,834	89.790	164,674.860	
DUKE ENERGY CORP	8,625	100.940	870,607.500	
TARGET CORP	5,373	142.700	766,727.100	
DOVER CORP	1,713	123.000	210,699.000	
WW GRAINGER INC	475	469.900	223,202.500	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,462	124.320	181,755.840	
CINTAS CORP	1,040	352.440	366,537.600	
CONAGRA BRANDS INC	5,567	31.800	177,030.600	

CLOROX COMPANY	1,384	124.640	172,501.760	
ENERGY CORP	2,243	107.290	240,651.470	
MICROSOFT CORP	82,166	244.490	20,088,765.340	
INCYTE CORP	2,006	66.180	132,757.080	
CVS HEALTH CORP	15,528	90.640	1,407,457.920	
MEDTRONIC PLC	15,769	88.480	1,395,241.120	
MICRON TECHNOLOGY INC	12,493	58.700	733,339.100	
BLACKROCK INC	1,718	591.230	1,015,733.140	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,914	27.600	190,826.400	
HASBRO INC	1,449	80.750	117,006.750	
KELLOGG CO	2,914	68.340	199,142.760	
KEYCORP	10,389	17.540	182,223.060	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	16,695	58.470	976,156.650	
COOPER COS INC/THE	547	314.920	172,261.240	
CHUBB LTD	4,839	197.940	957,831.660	
ARROW ELECTRONICS INC	737	114.040	84,047.480	
ALLSTATE CORP	3,242	121.990	395,491.580	
EBAY INC	7,068	42.580	300,955.440	
PAYPAL HOLDINGS INC	12,499	72.460	905,677.540	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,492	96.240	143,590.080	
DISH NETWORK CORP-A	2,984	17.630	52,607.920	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,615	240.780	629,639.700	
TRIMBLE INC	2,938	59.160	173,812.080	
LENNAR CORP-A	2,992	69.140	206,866.880	
LEAR CORP	600	126.340	75,804.000	
PROGRESSIVE CORP	6,601	112.410	742,018.410	
PACCAR INC	3,919	84.160	329,823.040	
BIOGEN INC	1,699	194.180	329,911.820	
IDEXX LABORATORIES INC	962	328.990	316,488.380	
STARBUCKS CORP	13,172	72.310	952,467.320	
PTC INC	1,200	99.890	119,868.000	
EVERSOURCE ENERGY	3,906	80.740	315,370.440	
INTUIT INC	3,206	364.780	1,169,484.680	
BORGWARNER INC	2,741	35.060	96,099.460	
BEST BUY CO INC	2,570	70.590	181,416.300	
BALL CORP	3,630	66.500	241,395.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,199	35.240	570,852.760	
ELECTRONIC ARTS INC	3,221	127.370	410,258.770	



	VULCAN MATERIALS CO	1,425	151.040	215,232.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,856	249.080	711,372.480	
	VF CORP	3,636	45.420	165,147.120	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	6,779	25.410	172,254.390	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	628	123.610	77,627.080	
	CARNIVAL CORP	9,986	9.520	95,066.720	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	6,361	17.640	112,208.040	
	COMCAST CORP-CLASS A	52,864	39.840	2,106,101.760	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	53.680	150,304.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	4.860	63,666.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 374,164,813.850 (50,515,991,517)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	89,251	23.080	2,059,913.080	
	BP PLC	223,025	4.349	970,047.230	
	UNILEVER PLC	30,542	36.095	1,102,413.490	
	BARCLAYS PLC	183,869	1.567	288,233.040	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	91,245	0.879	80,222.600	
	PRUDENTIAL PLC	31,421	9.736	305,914.850	
	NATWEST GROUP PLC	66,275	2.214	146,732.850	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	19.885	34,957.830	
	BAE SYSTEMS PLC	36,445	7.748	282,375.860	
	AVIVA PLC	34,002	4.041	137,402.080	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	23.650	26,961.000	
	GSK	60,183	17.122	1,030,453.320	
	INFORMA PLC	16,200	5.018	81,291.600	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	49,422	1.510	74,651.930	
	AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	5.134	54,353.650	
	DCC PLC	938	52.020	48,794.760	
	OCADO GROUP PLC	5,149	7.846	40,399.050	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	92.840	68,701.600	
	HALMA PLC	3,978	19.365	77,033.970	
	ENTAIN PLC	5,823	13.415	78,115.540	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,055	1.117	35,821.460	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	6,857	6.070	41,621.990	
	M&G PLC	25,964	2.018	52,395.350	
	RELX PLC	22,083	20.810	459,547.230	

DIAGEO PLC	27,848	34.480	960,199.040	
RIO TINTO PLC	13,800	55.550	766,590.000	
STANDARD CHARTERED PLC	29,593	5.996	177,439.620	
TESCO PLC	84,703	2.467	208,962.300	
SMITH & NEPHEW PLC	9,237	11.640	107,518.680	
GLENCORE PLC	120,936	4.833	584,483.680	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	7.718	24,697.600	
SMITHS GROUP PLC	4,080	14.745	60,159.600	
PEARSON PLC	8,271	7.384	61,073.060	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.033	35,843.820	
NEXT PLC	1,685	59.380	100,055.300	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.247	40,198.290	
WHITBREAD PLC	1,785	25.660	45,803.100	
BUNZL PLC	3,954	26.230	103,713.420	
VODAFONE GROUP PLC	315,036	1.255	395,559.200	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,409	59.660	84,060.940	
KINGFISHER PLC	24,703	2.348	58,002.640	
WPP PLC	13,021	8.180	106,511.780	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.280	84,748.320	
SEVERN TRENT PLC	2,971	28.070	83,395.970	
RENTOKIL INITIAL PLC	22,242	4.524	100,622.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,964	59.880	536,764.320	
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	11.035	53,883.900	
SCHRODERS PLC	1,227	26.260	32,221.020	
SSE PLC	11,927	16.415	195,781.700	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	4.872	60,256.890	
ASTRAZENECA PLC	18,285	97.500	1,782,787.500	
FERGUSON PLC	2,479	91.860	227,720.940	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.415	164,780.280	
3I GROUP PLC	11,152	11.045	123,173.840	
ASHTED GROUP PLC	5,139	36.510	187,624.890	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	5.984	69,103.230	
NATIONAL GRID PLC	41,425	10.505	435,169.620	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	810,012	0.433	351,302.200	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,806	18.010	194,616.060	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,155	40.250	46,488.750	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,658	35.045	864,139.610	

	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,483	15.685	54,630.850	
	HSBC HOLDINGS PLC	239,877	5.204	1,248,319.900	
	ANGLO AMERICAN PLC	14,424	34.550	498,349.200	
	MONDI PLC	5,921	14.235	84,285.430	
	COMPASS GROUP PLC	20,176	16.700	336,939.200	
	PERSIMMON PLC	3,969	21.500	85,333.500	
	BT GROUP PLC	102,757	1.796	184,602.950	
	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	16.740	43,088.760	
	BURBERRY GROUP PLC	4,508	15.930	71,812.440	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,078	43.510	90,413.780	
	INTERTEK GROUP PLC	1,897	42.330	80,300.010	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,624	67.380	244,185.120	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	15.095	30,778.700	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	21.300	33,441.000	
	ANTOFAGASTA PLC	3,460	13.930	48,197.800	
	ABRDN PLC	27,775	1.694	47,050.850	
	EXPERIAN PLC	10,496	23.230	243,822.080	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 20,519,360.840 (3,328,445,521)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	12,000	18.030	216,360.000	
	AZRIELI GROUP LTD	530	231.500	122,695.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,859	161.200	299,670.800	
	ICL GROUP LTD	8,294	35.580	295,100.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	678.000	203,400.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	30.090	456,164.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,043	31.100	592,237.300	
	NICE LTD	800	657.000	525,600.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	110.500	208,071.500	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 2,919,299.520 (113,684,237)	
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	26,551	4.590	121,869.090	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	53,923	3.070	165,543.610	

BHP GROUP LTD	60,570	44.260	2,680,828.200	
SOUTH32 LTD	56,387	4.490	253,177.630	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	21,141	32.990	697,441.590	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	19,691	19.630	386,534.330	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	37,685	26.840	1,011,465.400	
WESTPAC BANKING CORP	42,401	20.070	850,988.070	
SANTOS LTD	37,003	8.100	299,724.300	
AUST AND NZ BANKING GROUP	32,892	22.000	723,624.000	
RIO TINTO LTD	4,169	111.050	462,967.450	
ORIGIN ENERGY LTD	20,968	5.920	124,130.560	
AURIZON HOLDINGS LTD	23,438	4.020	94,220.760	
XERO LTD	1,426	81.900	116,789.400	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	23.830	65,484.840	
COLES GROUP LTD	15,570	17.140	266,869.800	
WISETECH GLOBAL LTD	1,645	36.640	60,272.800	
IDP EDUCATION LTD	2,619	22.150	58,010.850	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	10,716	8.060	86,370.960	
EVOLUTION MINING LTD	17,017	3.330	56,666.610	
REECE LTD	3,762	13.880	52,216.560	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	7.150	99,427.900	
SEEK LTD	2,600	21.710	56,446.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	8,616	10.850	93,483.600	
NEWCREST MINING LTD	10,331	23.220	239,885.820	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	20,653	91.200	1,883,553.600	
AMPOL LTD	2,000	34.440	68,880.000	
ORICA LTD	4,783	15.670	74,949.610	
QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	11.500	176,502.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,836	33.830	468,071.880	
CROWN RESORTS LTD	3,000	13.050	39,150.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	4.840	30,845.320	
TELSTRA CORP LTD	50,710	3.750	190,162.500	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,796	32.470	155,726.120	
MACQUARIE GROUP LTD	4,502	163.350	735,401.700	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,462	34.250	221,323.500	
CSL LTD	5,905	264.050	1,559,215.250	
WESFARMERS LTD	12,917	42.000	542,514.000	

	COCHLEAR LTD	805	205.640	165,540.200	
	BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	16.470	82,745.280	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	10.480	152,001.920	
	ASX LTD	2,260	77.520	175,195.200	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	23.530	142,450.620	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	4.170	112,994.490	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	33.320	174,030.360	
	BRAMBLES LTD	18,337	10.500	192,538.500	
	MINERAL RESOURCES LTD	1,881	55.560	104,508.360	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	74.780	154,345.920	
	REA GROUP LTD	608	103.440	62,891.520	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	760	63.680	48,396.800	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 16,838,374.780 (1,567,652,692)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,662	54.350	525,129.700	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	69.000	158,700.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	229	1,859.470	425,818.630	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,136	62.020	194,494.720	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,270	50.400	265,608.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,997	175.610	350,693.170	
	BCE INC	900	63.450	57,105.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,200	179.440	394,768.000	
	SUNCOR ENERGY INC	16,365	51.000	834,615.000	
	METRO INC/CN	2,776	67.900	188,490.400	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,941	89.100	351,143.100	
	BANK OF NOVA SCOTIA	14,998	80.660	1,209,738.680	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,230	64.980	664,745.400	
	TORONTO-DOMINION BANK	21,488	89.350	1,919,952.800	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,900	31.850	124,215.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	16,746	126.010	2,110,163.460	
	TOURMALINE OIL CORP	3,656	70.360	257,236.160	
	TC ENERGY CORP	12,364	70.190	867,829.160	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,375	49.820	317,602.500	
	BARRICK GOLD CORP	20,369	25.210	513,502.490	
	CAE INC	3,752	30.780	115,486.560	

THOMSON REUTERS CORP	1,968	125.770	247,515.360	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	39.770	71,586.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,034	105.710	109,304.140	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	57.700	90,012.000	
HYDRO ONE LTD	3,986	33.800	134,726.800	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,086	112.520	234,716.720	
NORTHLAND POWER INC	3,003	37.140	111,531.420	
WSP GLOBAL INC	1,444	138.840	200,484.960	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	104.950	102,221.300	
PARKLAND CORP	1,621	37.220	60,333.620	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	27.480	63,204.000	
EMERA INC	2,731	59.380	162,166.780	
TFI INTERNATIONAL INC	1,100	97.740	107,514.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	38.440	38,440.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,306	59.390	255,733.340	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,017	81.190	82,570.230	
IVANHOE MINES LTD-CL A	8,850	9.190	81,331.500	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,212	62.890	327,782.680	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	11,888	17.100	203,284.800	
AIR CANADA	1,700	17.970	30,549.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	5.260	77,621.820	
BANK OF MONTREAL	8,079	128.400	1,037,343.600	
POWER CORP OF CANADA	6,300	33.920	213,696.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,305	393.050	512,930.250	
NUTRIEN LTD	6,533	113.000	738,229.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	44.930	68,832.760	
CAMECO CORP	5,021	28.860	144,906.060	
FIRSTSERVICE CORP	422	153.000	64,566.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	1,865	34.140	63,671.100	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,560	26.310	41,043.600	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,000	52.720	52,720.000	
TELUS CORP	600	29.300	17,580.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	51.160	274,933.840	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	743	163.570	121,532.510	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,269	78.480	1,041,351.120	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	659.210	197,763.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,167	74.150	234,833.050	
WESTON (GEORGE) LTD	901	146.210	131,735.210	

	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,615	27.050	70,735.750	
	BLACKBERRY LTD	6,400	6.680	42,752.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,671	59.320	395,723.720	
	ENBRIDGE INC	24,433	55.640	1,359,452.120	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,341	58.220	1,009,593.020	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	22,184	21.910	486,051.440	
	BAUSCH HEALTH COS INC	3,514	9.590	33,699.260	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	88.740	941,265.180	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,100	62.170	68,387.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,364	36.500	86,286.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,945	140.520	975,911.400	
	CGI INC - CLASS A	2,384	97.240	231,820.160	
	ONEX CORPORATION	1,104	68.710	75,855.840	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,172	34.070	176,210.040	
	IGM FINANCIAL INC	2,784	35.430	98,637.120	
	TMX GROUP LTD	794	133.260	105,808.440	
	OPEN TEXT CORP	3,210	48.280	154,978.800	
	SAPUTO INC	2,900	27.180	78,822.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	31.920	201,096.000	
	FORTIS INC	5,474	59.340	324,827.160	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	78.530	106,408.150	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	9.970	65,802.000	
	CENOVUS ENERGY INC	17,390	28.730	499,614.700	
	DOLLARAMA INC	3,529	72.280	255,076.120	
	ALTAGAS LTD	3,201	27.690	88,635.690	
	KEYERA CORP	2,200	33.470	73,634.000	
	ARC RESOURCES LTD	9,253	19.700	182,284.100	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 27,786,702.710 (2,895,374,422)	
シンガポール・ ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	33,400	3.650	121,910.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	14,900	27.090	403,641.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	22,300	29.820	664,986.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,750	5.130	91,057.500	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.690	115,737.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	7.200	21,600.000	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	7.920	41,184.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	40,700	11.430	465,201.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.750	33,750.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	17.040	54,528.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	103,400	2.520	260,568.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.980	56,118.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.640	113,752.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	4.060	64,148.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 2,508,180.500 (243,168,098)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	38,906	15.990	622,106.940	
	ROCHE HOLDING AG-BR	428	350.000	149,800.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	717.000	63,813.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	33.500	58,759.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	8,079	305.750	2,470,154.250	
	SIKA AG-REG	1,812	227.200	411,686.400	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	96,700.000	96,700.000	
	ABB LTD-REG	18,174	27.470	499,239.780	
	SWISS RE AG	3,310	76.000	251,560.000	
	NESTLE SA-REG	32,598	108.620	3,540,794.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	243	852.000	207,036.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	261	175.500	45,805.500	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,122	5.904	177,840.280	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	46.060	123,625.040	
	SGS SA-REG	94	2,123.000	199,562.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	171.000	79,857.000	
	TEMENOS AG - REG	793	72.060	57,143.580	
	VAT GROUP AG	339	241.000	81,699.000	
	ALCON INC	5,513	66.320	365,622.160	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	229.000	86,333.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,679	419.100	703,668.900	
	BALOISE HOLDING AG - REG	611	153.800	93,971.800	
	CLARIANT AG-REG	2,552	18.620	47,518.240	
	NOVARTIS AG-REG	24,242	80.720	1,956,814.240	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	2,076.000	85,116.000	



	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	68.550	26,734.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5,809	98.840	574,161.560	
	SWISSCOM AG-REG	276	530.200	146,335.200	
	GEBERIT AG-REG	389	472.000	183,608.000	
	GIVAUDAN-REG	104	3,124.000	324,896.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,709	102.300	174,830.700	
	SONOVA HOLDING AG-REG	637	314.400	200,272.800	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,730	51.840	89,683.200	
	LONZA GROUP AG-REG	829	502.200	416,323.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	43.240	19,458.000	
	HOLCIM LTD	5,805	45.630	264,882.150	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	349	513.000	179,037.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	233.700	149,568.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	88.550	83,768.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	9,350.000	130,900.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 15,440,686.080 (2,084,647,027)	
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	204.600	413,292.000	
	INVESTOR CLASS A	6,256	189.100	1,183,009.600	
	VOLVO CAR CLASS B	8,556	74.170	634,598.520	
	ERICSSON LM-B SHS	34,835	75.250	2,621,333.750	
	VOLVO AB-B SHS	19,333	164.540	3,181,051.820	
	SKF AB-B SHARES	4,000	166.750	667,000.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	134.040	348,504.000	
	SWEDISH MATCH AB	20,545	101.000	2,075,045.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	115.100	808,692.600	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	250.000	717,250.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	19,610	108.600	2,129,646.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,428	94.700	1,650,431.600	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	149.400	1,616,657.400	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,836	133.240	1,177,308.640	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	161.400	1,181,448.000	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	162.150	601,414.350	
	SANDVIK AB	13,538	189.100	2,560,035.800	
	INVESTOR AB-B SHS	23,446	170.880	4,006,452.480	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	31,712	100.360	3,182,616.320	
	VOLVO AB-A SHS	3,923	171.200	671,617.600	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,342	450.400	604,436.800	
	SECURITAS AB-B SHS	3,930	87.840	345,211.200	
	TELIA CO AB	33,269	39.050	1,299,154.450	
	ALFA LAVAL AB	3,803	244.000	927,932.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,252	87.700	1,688,400.400	
	ASSA ABLOY AB-B	11,997	220.600	2,646,538.200	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,638	236.800	387,878.400	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,420	54.760	351,559.200	
	INDUTRADE AB	3,600	206.000	741,600.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	3,295	217.000	715,015.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	428.100	405,838.800	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	209.100	428,236.800	
	LIFCO AB-B SHS	2,924	172.750	505,121.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,716	71.840	1,200,877.440	
	LUNDIN ENERGY AB	2,900	480.400	1,393,160.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,260	251.900	1,828,794.000	
	EMBRACER GROUP AB	7,090	80.750	572,517.500	
	BOLIDEN AB	3,171	357.100	1,132,364.100	
	EPIROC AB-A	8,660	177.200	1,534,552.000	
	EPIROC AB-B	4,015	151.450	608,071.750	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	77.680	419,472.000	
	NORDEA BANK ABP	42,656	98.140	4,186,259.840	
	EQT AB	3,365	218.500	735,252.500	
	EVOLUTION AB	2,064	905.500	1,868,952.000	
	SINCH AB	6,400	37.525	240,160.000	
	KINNEVIK AB - B	3,003	168.000	504,504.000	
	HEXAGON AB-B SHS	23,558	109.150	2,571,355.700	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	234.800	305,240.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クロー ナ 61,575,860.560 (815,880,152)	
デンマーク・ク ローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	21,187	755.400	16,004,659.800	
	DANSKE BANK A/S	9,236	109.600	1,012,265.600	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	18,340.000	715,260.000	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,049	160.280	1,931,213.720	
	GN STORE NORD A/S	2,159	237.100	511,898.900	
	CARLSBERG AS-B	1,232	847.600	1,044,243.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,464	400.800	987,571.200	
	COLOPLAST-B	1,519	749.600	1,138,642.400	
	DSV PANALPINA A/S	2,404	994.600	2,391,018.400	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	1,800.000	176,400.000	
	DEMANT A/S	1,314	273.300	359,116.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	18,555.000	1,224,630.000	
	TRYG A/S	4,074	155.450	633,303.300	
	PANDORA A/S	1,325	482.500	639,312.500	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	475.900	600,585.800	
	GENMAB A/S	778	1,968.500	1,531,493.000	
	ORSTED A/S	2,246	693.700	1,558,050.200	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 32,459,664.220 (614,461,444)	
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	4.430	66,450.000	
	MERCURY NZ LTD	3,294	5.360	17,655.840	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	27,503	4.530	124,588.590	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.270	96,611.030	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	19.500	141,141.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 446,446.460 (37,479,181)	
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	11,696	183.150	2,142,122.400	
	NORSK HYDRO ASA	16,615	64.040	1,064,024.600	
	ORKLA ASA	7,483	73.140	547,306.620	
	TELENOR ASA	8,746	127.600	1,115,989.600	
	EQUINOR ASA	11,789	353.700	4,169,769.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	472.000	996,864.000	
	MOWI ASA	4,677	239.300	1,119,206.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	194.000	388,000.000	
	AKER BP ASA	1,355	414.500	561,647.500	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,973	331.200	653,457.600	
	SALMAR ASA	943	680.500	641,711.500	
	ADEVINTA ASA	4,582	65.850	301,724.700	
ノルウェー・クローネ 小計				13,701,823.920 (184,837,604)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	8,930	19.726	176,153.180	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	5,055	27.360	138,304.800	
	BAYER AG-REG	10,607	63.610	674,711.270	
	EVONIK INDUSTRIES AG	4,431	24.730	109,578.630	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	24,343	9.256	225,318.800	
	COMMERZBANK AG	9,689	7.522	72,880.650	
	VOLKSWAGEN AG	420	191.450	80,409.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	1,970	144.160	283,995.200	
	SIEMENS AG-REG	8,886	109.220	970,528.920	
	E.ON SE	27,111	9.090	246,438.990	
	UNIPER SE	1,192	20.620	24,579.040	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,527	77.610	273,730.470	
	GEA GROUP AG	1,908	34.740	66,283.920	
	CONTINENTAL AG	1,474	70.620	104,093.880	
	BASF SE	9,978	48.390	482,835.420	
	ALLIANZ SE-REG	4,459	182.060	811,805.540	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,141	58.780	125,847.980	
	RHEINMETALL AG	625	206.700	129,187.500	
	RWE AG	7,526	38.170	287,267.420	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	5.712	37,773.450	
	BRENNTAG SE	1,893	70.780	133,986.540	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	29.630	143,261.050	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	28.590	27,417.810	
	SAP SE	11,987	87.010	1,042,988.870	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,544	219.400	338,753.600	
	ZALANDO SE	2,856	27.670	79,025.520	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,772	49.680	88,032.960	
	KION GROUP AG	600	39.310	23,586.000	
	COVESTRO AG	1,945	39.600	77,022.000	
	RATIONAL AG	74	580.000	42,920.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	310	314.900	97,619.000	

PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	68.460	119,120.400	
DELIVERY HERO SE	2,148	31.830	68,370.840	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	112.750	63,140.000	
BECHTLE AG	819	36.560	29,942.640	
NEMETSCHKE SE	789	57.460	45,335.940	
SCOUT24 AG	1,083	52.640	57,009.120	
AROUNDTOWN SA	10,412	3.608	37,566.490	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,461	49.760	172,219.360	
KNORR-BREMSE AG	926	58.180	53,874.680	
HELLOFRESH SE	1,814	28.920	52,460.880	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	15.605	73,842.860	
BEIERSDORF AG	1,275	93.040	118,626.000	
MERCK KGAA	1,564	163.450	255,635.800	
ADIDAS AG	2,045	164.540	336,484.300	
PUMA SE	1,295	66.100	85,599.500	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	58.450	76,627.950	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	34,987	17.818	623,398.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,561	50.460	129,228.060	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,301	62.290	579,359.290	
QIAGEN N.V.	2,521	40.830	102,932.430	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14,076	24.270	341,624.520	
HANNOVER RUECK SE	644	139.250	89,677.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	10,878	34.580	376,161.240	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,099	151.850	318,733.150	
MTU AERO ENGINES AG	666	168.750	112,387.500	
SYMRISE AG	1,656	95.720	158,512.320	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.780	17,347.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	733	71.900	52,702.700	
VONOVIA SE	8,041	31.620	254,256.420	
LEG IMMOBILIEN SE	869	83.160	72,266.040	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,301	20.910	215,393.910	
NN GROUP NV	3,100	44.580	138,198.000	
ARCELORMITTAL	7,477	25.935	193,915.990	
HEINEKEN NV	3,123	89.000	277,947.000	
AEGON NV	17,967	4.357	78,282.210	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11,069	25.200	278,938.800	

AKZO NOBEL N.V.	2,319	70.740	164,046.060	
KONINKLIJKE DSM NV	2,112	141.850	299,587.200	
WOLTERS KLUWER	3,158	84.960	268,303.680	
ING GROEP NV	42,686	9.624	410,810.060	
KONINKLIJKE KPN NV	37,607	3.316	124,704.810	
ASML HOLDING NV	4,467	471.200	2,104,850.400	
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	10.180	41,025.400	
IMCD NV	715	132.250	94,558.750	
ADYEN NV	256	1,155.400	295,782.400	
JUST EAT TAKEAWAY	2,381	17.108	40,734.140	
PROSUS NV	10,088	47.645	480,642.760	
JDE PEET'S NV	1,476	26.140	38,582.640	
ASM INTERNATIONAL NV	602	256.050	154,142.100	
RANDSTAD NV	1,490	47.200	70,328.000	
HEINEKEN HOLDING NV	1,285	69.900	89,821.500	
OCI NV	1,879	33.300	62,570.700	
TOTALENERGIES SE	28,113	54.080	1,520,351.040	
MICHELIN (CGDE)	2,146	108.600	233,055.600	
AIR LIQUIDE SA	6,069	134.980	819,193.620	
KERING	826	491.300	405,813.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,824	116.980	681,291.520	
BOUYGUES SA	2,721	30.280	82,391.880	
BNP PARIBAS	12,239	47.335	579,333.060	
THALES SA	1,306	113.500	148,231.000	
DANONE	6,956	51.740	359,903.440	
CARREFOUR SA	7,248	18.765	136,008.720	
VIVENDI	8,930	10.910	97,426.300	
L'OREAL	2,726	301.650	822,297.900	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,093	48.240	293,926.320	
LEGRAND SA	3,940	72.200	284,468.000	
PERNOD RICARD SA	2,302	169.300	389,728.600	
EURAZEO SE	400	64.350	25,740.000	
SOCIETE GENERALE SA	9,790	22.415	219,442.850	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,139	544.000	1,707,616.000	
ACCOR SA	1,850	27.240	50,394.000	
CAPGEMINI SE	1,919	165.750	318,074.250	
VALEO SA	2,867	18.880	54,128.960	
PUBLICIS GROUPE	2,918	46.090	134,490.620	

BUREAU VERITAS SA	3,227	25.050	80,836.350	
EIFFAGE	945	87.760	82,933.200	
SODEXO SA	1,085	65.780	71,371.300	
IPSEN	276	84.500	23,322.000	
AMUNDI SA	1,005	47.580	47,817.900	
TELEPERFORMANCE	701	279.300	195,789.300	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	44.060	43,046.620	
EURONEXT NV	1,095	73.780	80,789.100	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	77.840	115,203.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	314	296.300	93,038.200	
SEB SA	216	89.600	19,353.600	
ESSILORLUXOTTICA	3,030	134.500	407,535.000	
DASSAULT AVIATION SA	220	155.100	34,122.000	
WORLDLINE SA	3,135	32.540	102,012.900	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	878	32.100	28,183.800	
AXA SA	21,672	22.390	485,236.080	
EDENRED	3,007	42.720	128,459.040	
RENAULT SA	2,044	24.250	49,567.000	
HERMES INTERNATIONAL	339	980.800	332,491.200	
STMICROELECTRONICS NV	8,118	32.500	263,835.000	
REMY COINTREAU	253	152.700	38,633.100	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,165	33.495	273,486.670	
WENDEL	331	86.000	28,466.000	
ORANGE	24,119	10.862	261,980.570	
ALSTOM	3,668	25.010	91,736.680	
SANOFI	13,043	94.150	1,227,998.450	
VINCI SA	5,802	83.690	485,569.380	
AIRBUS SE	6,350	96.360	611,886.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,849	23.500	184,451.500	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	8.833	129,041.290	
BIOMERIEUX	457	85.580	39,110.060	
ENGIE	21,758	11.958	260,182.160	
EDF	6,760	8.160	55,161.600	
SAFRAN SA	3,641	88.700	322,956.700	
ARKEMA	731	97.340	71,155.540	
ADP	350	122.400	42,840.000	
GETLINK SE	4,973	16.920	84,143.160	
BOLLORE	7,300	4.750	34,675.000	
UCB SA	1,550	79.020	122,481.000	

KBC GROUP NV	3,011	54.020	162,654.220	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	79.740	90,823.860	
SOLVAY SA	873	86.740	75,724.020	
UMICORE	2,270	38.330	87,009.100	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,395	48.820	458,663.900	
AGEAS	2,172	40.510	87,987.720	
D' IETEREN GROUP	442	140.400	62,056.800	
PROXIMUS	2,269	15.145	34,364.000	
ELIA GROUP SA/NV	432	143.000	61,776.000	
SOFINA	146	198.500	28,981.000	
ARGENX SE	516	313.900	161,972.400	
PRYSMIAN SPA	2,949	27.680	81,628.320	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,944	15.515	200,826.160	
MEDIOBANCA SPA	8,345	8.958	74,754.510	
TENARIS SA	4,700	14.445	67,891.500	
UNICREDIT SPA	25,529	9.715	248,014.230	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.248	26,919.590	
INTESA SANPAOLO	176,198	1.770	311,870.460	
ATLANTIA SPA	6,027	22.230	133,980.210	
POSTE ITALIANE SPA	7,727	9.118	70,454.780	
MONCLER SPA	2,435	38.380	93,455.300	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	37.580	48,290.300	
ENI SPA	27,208	13.170	358,329.360	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5,546	9.026	50,058.190	
DIASORIN SPA	277	111.500	30,885.500	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	9.242	22,310.180	
NEXI SPA	6,511	7.310	47,595.410	
AMPLIFON SPA	1,440	26.370	37,972.800	
ENEL SPA	88,793	5.333	473,533.060	
SNAM SPA	24,300	5.084	123,541.200	
TERNA SPA	15,815	7.228	114,310.820	
EXOR NV	1,088	60.400	65,715.200	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	12.465	145,728.310	
FINECOBANK SPA	8,077	10.335	83,475.790	
STELLANTIS NV	26,495	12.478	330,604.610	
FERRARI NV	1,499	162.650	243,812.350	
TELEFONICA SA	64,491	4.409	284,340.810	
ENDESA SA	3,760	19.085	71,759.600	



BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	72,268	4.194	303,091.990	
IBERDROLA SA	63,868	9.872	630,504.890	
REPSOL SA	17,283	15.345	265,207.630	
GRIFOLS SA	2,795	17.615	49,233.920	
BANCO SANTANDER SA	185,913	2.623	487,649.790	
AMADEUS IT GROUP SA	5,400	50.680	273,672.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	2,721	27.070	73,657.470	
CAIXABANK SA	67,015	3.217	215,587.250	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,953	24.020	70,931.060	
AENA SME SA	866	131.150	113,575.900	
CELLNEX TELECOM SA	7,419	35.480	263,226.120	
ACCIONA SA	353	177.200	62,551.600	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,836	22.510	266,428.360	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	3,293	17.915	58,994.090	
ENAGAS SA	3,218	20.920	67,320.560	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,147	17.965	92,465.850	
FERROVIAL SA	6,055	23.270	140,899.850	
UPM-KYMMENE OYJ	6,525	30.610	199,730.250	
NOKIA OYJ	62,753	4.520	283,643.560	
WARTSILA OYJ ABP	4,116	7.224	29,733.980	
STORA ENSO OYJ-R SHS	6,984	15.585	108,845.640	
ELISA OYJ	1,734	52.520	91,069.680	
SAMPO OYJ-A SHS	5,826	40.600	236,535.600	
FORTUM OYJ	4,400	16.575	72,930.000	
KESKO OYJ-B SHS	3,470	21.900	75,993.000	
KONE OYJ-B	3,796	44.740	169,833.040	
NESTE OYJ	4,941	41.930	207,176.130	
ORION OYJ-CLASS B	1,763	36.530	64,402.390	
VERBUND AG	876	94.250	82,563.000	
OMV AG	2,056	48.690	100,106.640	
ERSTE GROUP BANK AG	3,489	26.430	92,214.270	
VOESTALPINE AG	1,323	25.560	33,815.880	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,055	32.310	98,707.050	
KINGSPAN GROUP PLC	1,744	70.000	122,080.000	
JERONIMO MARTINS	2,900	18.820	54,578.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	35,964	4.488	161,406.430	

	GALP ENERGIA SGPS SA	6,135	12.620	77,423.700	
	EDP RENOVAVEIS SA	3,029	21.640	65,547.560	
	KERRY GROUP PLC-A	1,822	91.440	166,603.680	
	CRH PLC	8,340	34.000	283,560.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,785	93.480	166,861.800	
ユーロ 小計				ユーロ 46,262,583.220 (6,513,771,717)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	51.150	895,125.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	29,000	41.250	1,196,250.000	
	MTR CORP	16,500	41.500	684,750.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	93.300	1,772,700.000	
	SINO LAND CO	34,000	11.200	380,800.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	32,552	53.000	1,725,256.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8,000	47.800	382,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	19,000	75.500	1,434,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	29.400	604,611.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	145,027	8.530	1,237,080.310	
	HANG SENG BANK LTD	10,000	137.000	1,370,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,500	29.200	511,000.000	
	WH GROUP LTD	113,500	5.590	634,465.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	15,400	341.600	5,260,640.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	20,000	14.380	287,600.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	26,000	17.520	455,520.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	19.080	152,640.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	51.950	1,223,526.400	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	51.350	282,425.000	
	AIA GROUP LTD	153,000	78.600	12,025,800.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	12,000	25.850	310,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	34.600	692,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	20.600	395,520.000	
	ESR CAYMAN LTD	28,000	21.100	590,800.000	
	SANDS CHINA LTD	29,000	15.040	436,160.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	26,000	13.560	352,560.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,000	93.200	1,491,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,000	30.550	1,374,750.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 38,160,278.710 (656,356,794)	
合計				69,571,750,406 [69,571,750,406]	

## (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	1,606	297,415.140	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,755	362,395.050	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	150,281.120	
		VORNADO REALTY TRUST	2,128	61,626.880	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,216	361,224.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,032	277,320.960	
		EQUINIX INC	1,021	631,498.710	
		AMERICAN TOWER CORP	5,381	1,261,790.690	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	10,529	180,888.220	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,335	142,794.900	
		KIMCO REALTY CORP	7,054	135,436.800	
		INVITATION HOMES INC	6,976	234,602.880	
		VICI PROPERTIES INC	12,524	352,300.120	
		VENTAS INC	4,401	213,140.430	
		WEYERHAEUSER CO	8,683	298,868.860	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,914	776,018.880	
		IRON MOUNTAIN INC	3,474	164,250.720	
		SUN COMMUNITIES INC	1,350	203,904.000	
		PROLOGIS INC	8,288	917,150.080	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,091	283,058.670	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	148,302.000	
		DUKE REALTY CORP	4,262	218,214.400	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	771	197,537.910	
		WELLTOWER INC	4,901	379,582.450	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	150,812.960	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,326	212,199.780	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	133,906.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	92,541.440	

	REALTY INCOME CORP	7,325	459,936.750	
	PUBLIC STORAGE	1,784	531,346.560	
	REGENCY CENTERS CORP	1,939	109,747.400	
	UDR INC	3,700	156,584.000	
	WP CAREY INC	2,131	172,547.070	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,174	395,385.180	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,575	250,015.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6,944	103,743.360	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 11,018,371.330 (1,487,590,313)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,969	65,617.200	
	SEGRO PLC	11,371	108,570.300	
	BRITISH LAND CO PLC	9,799	49,641.730	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 223,829.230 (36,307,340)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	13,949	126,517.430	
	LENDLEASE GROUP	8,477	81,718.280	
	TRANSURBAN GROUP	40,411	564,541.670	
	APA GROUP	14,243	163,794.500	
	SCENTRE GROUP	64,017	163,243.350	
	GPT GROUP	21,774	90,579.840	
	MIRVAC GROUP	43,513	89,201.650	
	STOCKLAND	18,729	67,424.400	
	GOODMAN GROUP	20,198	361,746.180	
	VICINITY CENTRES	50,371	87,897.390	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,796,664.690 (167,269,483)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	36,713.580	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	28,154.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 64,867.580 (6,759,202)	

シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	シンガポール・ドル	83,875.000
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56,826		120,471.120
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46,000		74,520.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,600		66,176.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル	345,042.120 (33,451,834)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	ユーロ	80,624.500
	GECINA SA	578		55,314.600
	KLEPIERRE	2,394		45,055.080
	COVIVIO	353		20,015.100
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,198		67,610.480
ユーロ 小計			ユーロ	268,619.760 (37,821,663)
香港・ドル	LINK REIT	26,000	香港・ドル	1,778,400.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	33,000		252,120.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	54,000		578,880.000
香港・ドル 小計			香港・ドル	2,609,400.000 (44,881,680)
投資証券 合計				1,814,081,515 [1,814,081,515]
合計				1,814,081,515 [1,814,081,515]

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	97.1%	2.9%	72.7%
	603銘柄			
	投資証券			
	36銘柄			

イギリス・ポンド	株式	78銘柄	98.9%	1.1%	4.7%
	投資証券	3銘柄			
イスラエル・シェケル	株式	9銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	90.4%	9.6%	2.4%
	投資証券	10銘柄			
カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.8%	0.2%	4.1%
	投資証券	2銘柄			
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	87.9%	12.1%	0.4%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	40銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	48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	223銘柄	99.4%	0.6%	9.2%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	28銘柄	93.6%	6.4%	1.0%
	投資証券	3銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】**

(1) 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

## (1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	18,750,868	24,571,481
親投資信託受益証券	9,291,443,580	10,844,049,164
未収入金	-	104,600
流動資産合計	9,310,194,448	10,868,725,245
資産合計	9,310,194,448	10,868,725,245
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	884,461	1,167,953
未払委託者報酬	17,026,770	22,483,930
その他未払費用	221,038	291,920
流動負債合計	18,132,269	23,943,803
負債合計	18,132,269	23,943,803
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,456,971,386	1 4,981,572,692
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,835,090,793	5,863,208,750
（分配準備積立金）	2,638,229,512	2,195,222,084
元本等合計	9,292,062,179	10,844,781,442
純資産合計	9,292,062,179	10,844,781,442
負債純資産合計	9,310,194,448	10,868,725,245



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		7		-
有価証券売買等損益		2,821,452,246		444,003,184
営業収益合計		2,821,452,253		444,003,184
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,640		4,061
受託者報酬		1,579,793		2,249,521
委託者報酬		30,412,868		43,304,986
その他費用		394,945		562,227
営業費用合計		32,391,246		46,120,795
<b>営業利益</b>		2,789,061,007		397,882,389
経常利益		2,789,061,007		397,882,389
<b>当期純利益</b>		2,789,061,007		397,882,389
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		311,381,791		197,678,752
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,699,882,838		4,835,090,793
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,198,464,468		2,231,017,892
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,198,464,468		2,231,017,892
剰余金減少額又は欠損金増加額		540,935,729		1,403,103,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		540,935,729		1,403,103,572
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,835,090,793		5,863,208,750

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	4,017,999,045円	4,456,971,386円
期中追加設定元本額	1,622,654,198円	1,798,628,403円
期中一部解約元本額	1,183,681,857円	1,274,027,097円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,456,971,386口	4,981,572,692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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,477,679,502円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,196,864,429円)及び分配準備積立金(160,550,010円)より分配対象額は4,835,093,941円(1万口当たり10,848.38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(200,204,820円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,667,990,228円)及び分配準備積立金(1,995,017,264円)より分配対象額は5,863,212,312円(1万口当たり11,769.80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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,583,387,308	279,150,390
合計	2,583,387,308	279,150,390

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0848円 (20,848円)	2.1770円 (21,770円)
---------------------------	----------------------	----------------------

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	2,749,365,946	10,844,049,164	
親投資信託受益証券 合計			10,844,049,164	
合計			10,844,049,164	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金	662,159,876	1,734,391,500
コール・ローン	8,158,697,235	3,211,057,221
株式	201,785,972,970	242,279,225,320
投資証券	5,049,312,781	6,260,515,772
派生商品評価勘定	391,639,689	66,752,670
未収入金	2,491,192	1,691,414
未収配当金	218,573,259	335,111,808
差入委託証拠金	3,528,706,733	3,743,259,264
流動資産合計	219,797,553,735	257,632,004,969
資産合計	219,797,553,735	257,632,004,969
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,280,730	30,826,108
未払解約金	32,017,600	110,728,500
流動負債合計	35,298,330	141,554,608
負債合計	35,298,330	141,554,608
純資産の部		
元本等		
元本	1 58,443,353,703	65,283,819,354
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	161,318,901,702	192,206,631,007
元本等合計	219,762,255,405	257,490,450,361
純資産合計	219,762,255,405	257,490,450,361
負債純資産合計	219,797,553,735	257,632,004,969

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	50,896,184,101円	58,443,353,703円
期中追加設定元本額	13,926,974,113円	13,080,204,385円
期中一部解約元本額	6,379,804,511円	6,239,738,734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	378,035,245円	351,632,044円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	4,553,077円	3,751,596円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	78,014,296円	45,554,421円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	9,555,264円	7,085,384円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	269,933,131円	200,924,115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）	27,694,930円	52,414,761円



ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	506,476,980円	519,977,583円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,470,931,463円	2,749,365,946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)	500,461,177円	642,893,627円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	12,196,484円	17,708,759円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	18,951,092円	41,779,373円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	3,126,181,449円	5,050,402,867円
i F r e e 8資産バランス	1,044,616,449円	1,256,126,097円
i F r e e 年金バランス	129,863,166円	219,932,241円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	35,907,675,092円	41,235,492,591円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	529,092,010円	525,142,755円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	938,183,739円	988,220,803円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	716,131,197円	794,945,647円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,633,383,245円	1,826,628,555円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,421,297円	12,452,171円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	8,707,246円	11,217,011円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	611,470,307円	1,026,950,890円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,807,454円	1,923,475円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,040,718円	2,153,578円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,696,909円	4,269,698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	275,123円
ダイワ世界バランスファンド40VA	123,939,186円	81,664,400円
ダイワ世界バランスファンド60VA	229,713,162円	153,538,731円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,753,739,188円	1,324,219,005円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	90,149,674円	68,591,146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）	234,082,341円	186,589,341円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	856,500,290円	1,064,643,760円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	240,351,471円	387,018,353円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	2,907,948,694円	1,552,370,293円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,741,850,536円	2,786,345,980円
ダイワライフスタイル25	14,046,221円	11,032,136円
ダイワライフスタイル50	54,532,158円	44,105,366円
ダイワライフスタイル75	44,797,112円	34,479,732円
計	58,443,353,703円	65,283,819,354円
2. 期末日における受益権の総数	58,443,353,703口	65,283,819,354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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	26,636,268,559	53,274,213,984

投資証券	828,971,804	1,311,383,962
合計	27,465,240,363	54,585,597,946

(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6月15日まで、及び2021年12月1日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	12,525,829,422	-	12,879,379,634	353,550,212	8,699,946,162	-	8,674,276,604	25,669,558
合計	12,525,829,422	-	12,879,379,634	353,550,212	8,699,946,162	-	8,674,276,604	25,669,558

(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6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	8,119,494,215	-	8,154,302,962	34,808,747	2,832,228,390	-	2,893,824,510	61,596,120
アメリカ・ドル	5,771,242,030	-	5,806,756,925	35,514,895	983,803,400	-	1,024,850,120	41,046,720
イギリス・ ポンド	320,530,562	-	320,043,042	487,520	211,045,900	-	210,682,290	363,610
オーストラリ ア・ドル	274,572,279	-	275,060,772	488,493	353,182,340	-	353,445,600	263,260
カナダ・ドル	360,916,227	-	360,789,786	126,441	254,487,500	-	260,206,750	5,719,250
スイス・フラン	330,269,958	-	331,884,757	1,614,799	268,806,800	-	270,078,600	1,271,800
ユーロ	1,061,963,159	-	1,059,767,680	2,195,479	760,902,450	-	774,561,150	13,658,700
合計	8,119,494,215	-	8,154,302,962	34,808,747	2,832,228,390	-	2,893,824,510	61,596,120

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.7603円	3.9442円
(1万口当たり純資産額)	(37,603円)	(39,442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	4,700	134.420	631,774.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	4,000	481.630	1,926,520.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,400	135.170	1,000,258.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	82.020	442,908.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,400	143.060	343,344.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	29.510	622,661.000	
	ABBOTT LABORATORIES	71,466	102.940	7,356,710.040	
	HOWMET AEROSPACE INC	14,983	32.200	482,452.600	
	VERISK ANALYTICS INC	6,500	158.230	1,028,495.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	32.270	448,553.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	24,300	65.530	1,592,379.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	407.160	732,888.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,700	95.250	2,352,675.000	
	QORVO INC	4,420	96.660	427,237.200	
	AFLAC INC	25,000	53.710	1,342,750.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	114.030	581,553.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,800	84.940	577,592.000	
	ADOBE INC	19,120	370.820	7,090,078.400	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,400	93.250	783,300.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	280.500	1,346,400.000	
	GARMIN LTD	6,300	96.720	609,336.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,000	239.220	2,152,980.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,800	183.280	5,095,184.000		
WR BERKLEY CORP	8,642	66.740	576,767.080		
AUTOZONE INC	820	2,033.580	1,667,535.600		
DOLLAR TREE INC	9,071	156.020	1,415,257.420		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	45,900	7.850	360,315.000		

CELANESE CORP	4,450	136.210	606,134.500	
DR HORTON INC	13,616	65.720	894,843.520	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	35.590	316,751.000	
AUTODESK INC	8,900	171.590	1,527,151.000	
MOODY'S CORP	6,800	257.680	1,752,224.000	
DEVON ENERGY CORP	25,600	70.590	1,807,104.000	
ALBEMARLE CORP	4,700	223.330	1,049,651.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,500	105.540	580,470.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	55.610	567,222.000	
CITIGROUP INC	80,473	45.960	3,698,539.080	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,000	204.130	3,470,210.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,400	90.440	1,844,976.000	
ALLEGHANY CORP	520	832.000	432,640.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	377.130	577,008.900	
HESS CORP	11,300	120.070	1,356,791.000	
DAVITA INC	2,750	89.970	247,417.500	
DANAHER CORP	27,650	242.420	6,702,913.000	
FORTIVE CORP	13,800	56.070	773,766.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	22,800	94.050	2,144,340.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,800	82.670	1,884,876.000	
BUNGE LTD	5,700	104.350	594,795.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	118.390	1,562,156.050	
APPLE INC	661,100	132.760	87,767,636.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,400	91.840	1,046,976.000	
BOEING CO/THE	22,500	122.160	2,748,600.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	116.420	723,550.300	
BECTON DICKINSON AND CO	11,499	236.320	2,717,443.680	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	97.910	528,714.000	
NISOURCE INC	16,500	27.600	455,400.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,100	106.350	542,385.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,771	40.600	1,249,302.600	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	170,304	49.160	8,372,144.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	52,350	277.640	14,534,454.000	
ANSYS INC	3,500	229.760	804,160.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	53,817	46.240	2,488,498.080	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	28,400	95.420	2,709,928.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	72.870	6,434,421.000	

JPMORGAN CHASE & CO	119,670	114.060	13,649,560.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	107.680	1,001,424.000	
LKQ CORP	10,800	48.520	524,016.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,612	65.160	821,797.920	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,200	143.390	1,605,968.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	243.070	1,093,815.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	230.020	2,162,188.000	
SERVICENOW INC	8,100	444.750	3,602,475.000	
CATERPILLAR INC	21,700	206.690	4,485,173.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	54.660	530,202.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,400	41.840	393,296.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,000	209.500	419,000.000	
CMS ENERGY CORP	11,700	62.520	731,484.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	52.730	785,677.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	31.380	194,556.000	
CORNING INC	32,600	32.100	1,046,460.000	
CISCO SYSTEMS INC	168,450	42.910	7,228,189.500	
MORGAN STANLEY	54,152	74.960	4,059,233.920	
MSCI INC	3,300	391.000	1,290,300.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	379.410	417,351.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	195.490	254,137.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	57.060	536,364.000	
BROADCOM INC	16,612	520.170	8,641,064.040	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,900	133.520	654,248.000	
ARAMARK	9,000	30.330	272,970.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	119.110	940,969.000	
CENTENE CORP	23,607	76.230	1,799,561.610	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,200	107.520	451,584.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	35.660	720,332.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,500	153.230	1,302,455.000	
GARTNER INC	3,350	234.600	785,910.000	
SPLUNK INC	6,300	86.470	544,761.000	
DOMINION ENERGY INC	32,941	74.600	2,457,398.600	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,100	88.060	1,417,766.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	55.640	294,892.000	
DEERE & CO	11,800	326.580	3,853,644.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	123.550	741,300.000	
POOL CORP	1,600	349.440	559,104.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,284	112.150	1,265,500.600	



VMWARE INC-CLASS A	8,500	121.320	1,031,220.000	
CABLE ONE INC	200	1,223.850	244,770.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	158.430	427,761.000	
NASDAQ INC	4,600	145.870	671,002.000	
VAIL RESORTS INC	1,600	230.860	369,376.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	11.920	249,128.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	66.300	596,700.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,800	132.010	369,628.000	
WESTLAKE CORP	1,600	114.370	182,992.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,400	88.780	1,278,432.000	
COGNEX CORP	6,900	43.020	296,838.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	45.060	328,938.000	
TELEFLEX INC	1,900	252.510	479,769.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,400	161.420	548,828.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,000	280.610	841,830.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	469.960	422,964.000	
CATALENT INC	6,900	104.290	719,601.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,600	179.320	1,004,192.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	261.690	628,056.000	
IDEX CORP	3,100	179.410	556,171.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,400	74.270	2,406,348.000	
ROLLINS INC	8,607	32.780	282,137.460	
AMETEK INC	9,400	111.340	1,046,596.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,800	82.000	803,600.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	45.170	291,346.500	
HEICO CORP	1,800	133.390	240,102.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	240.150	624,390.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,500	350.720	526,080.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,600	97.480	1,033,288.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	310.580	527,986.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	17,960	454.800	8,168,208.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	71.230	231,497.500	
EPAM SYSTEMS INC	2,300	278.360	640,228.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	77.740	412,022.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,100	1,204.010	1,324,411.000	
UGI CORP	8,500	39.710	337,535.000	

CUMMINS INC	5,800	196.610	1,140,338.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,600	74.640	2,358,624.000	
CDW CORP/DE	5,500	162.500	893,750.000	
SIGNATURE BANK	2,550	178.060	454,053.000	
COSTAR GROUP INC	16,000	55.170	882,720.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	406.390	975,336.000	
AMERCO	400	464.380	185,752.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	239.470	957,880.000	
MERCADOLIBRE INC	1,790	616.400	1,103,356.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	177.110	531,330.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,316	119.140	1,348,188.240	
DEXCOM INC	15,600	69.310	1,081,236.000	
NORDSON CORP	2,090	200.820	419,713.800	
COPART INC	8,700	103.590	901,233.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	6,800	149.630	1,017,484.000	
SEAGEN INC	5,600	144.640	809,984.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,000	238.080	714,240.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	188.530	622,149.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	527.650	1,102,788.500	
BIO-TECHNE CORP	1,580	324.180	512,204.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	91.220	355,758.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,700	81.270	707,049.000	
KINDER MORGAN INC	82,681	17.890	1,479,163.090	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	179.280	1,756,944.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,500	268.480	402,720.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	31.110	1,026,630.000	
T-MOBILE US INC	25,327	124.900	3,163,342.300	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	30.190	203,782.500	
COCA-COLA CO/THE	167,050	59.230	9,894,371.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,500	50.680	430,780.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	98.600	685,270.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,700	23.080	270,036.000	
CSX CORP	88,900	29.340	2,608,326.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	213.860	812,668.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,125	101.930	624,321.250	
AMAZON.COM INC	371,200	102.310	37,977,472.000	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,300	86.500	2,188,450.000	
EXXON MOBIL CORP	171,705	96.100	16,500,850.500	
AES CORP	27,100	18.910	512,461.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	272.670	436,272.000	
EOG RESOURCES INC	23,700	131.260	3,110,862.000	
EQT CORP	14,100	40.830	575,703.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	89.300	580,450.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	622.750	311,375.000	
ABIOMED INC	1,800	229.660	413,388.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,400	141.210	903,744.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,200	116.010	1,415,322.000	
FORD MOTOR CO	159,523	12.200	1,946,180.600	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	37.140	263,694.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	21.450	133,783.650	
ENTEGRIS INC	5,500	98.760	543,180.000	
AERCAP HOLDINGS NV	5,600	39.630	221,928.000	
FORTINET INC	5,500	269.230	1,480,765.000	
MARKEL CORP	550	1,296.650	713,157.500	
NEXTERA ENERGY INC	79,580	71.480	5,688,378.400	
MASIMO CORP	2,000	123.060	246,120.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	59,008	36.820	2,172,674.560	
INSULET CORP	2,800	205.550	575,540.000	
US BANCORP	57,200	45.720	2,615,184.000	
UNITED RENTALS INC	2,900	260.120	754,348.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	150.790	376,975.000	
FASTENAL CO	23,300	49.130	1,144,729.000	
FISERV INC	25,133	89.890	2,259,205.370	
GENERAL ELECTRIC CO	44,606	68.050	3,035,438.300	
GENERAL MOTORS CO	56,000	33.200	1,859,200.000	
ZENDESK INC	4,900	57.010	279,349.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,600	215.900	2,072,640.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,750	282.540	3,884,925.000	
ALPHABET INC-CL A	12,190	2,134.310	26,017,238.900	
ALPHABET INC-CL C	11,507	2,143.880	24,669,627.160	
OWENS CORNING	3,900	82.660	322,374.000	
GENERAL MILLS INC	24,500	66.450	1,628,025.000	
FIRSTENERGY CORP	22,018	38.390	845,271.020	
GENUINE PARTS CO	5,850	132.440	774,774.000	
FIFTH THIRD BANCORP	27,700	34.580	957,866.000	

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,850	226.920	1,781,322.000	
HALLIBURTON CO	36,400	36.670	1,334,788.000	
HOME DEPOT INC	42,350	278.670	11,801,674.500	
ASSURANT INC	2,250	176.010	396,022.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	58,300	12.240	713,592.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,610	204.810	329,744.100	
HERSHEY CO/THE	5,900	206.790	1,220,061.000	
HUMANA INC	5,100	423.930	2,162,043.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	168.290	1,834,361.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	48.690	161,650.800	
HENRY SCHEIN INC	5,600	75.000	420,000.000	
HP INC	47,300	33.750	1,596,375.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	52,700	13.670	720,409.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	36.220	247,310.160	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,900	58.120	459,148.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	36.280	107,026.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	44.550	686,070.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	29,803	36.140	1,077,080.420	
ENPHASE ENERGY INC	5,400	179.520	969,408.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,500	135.720	4,953,780.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	43.620	623,766.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	61.320	318,864.000	
ZOETIS INC	19,100	157.800	3,013,980.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,499	126.680	1,203,333.320	
CHENIERE ENERGY INC	9,400	130.520	1,226,888.000	
ALLEGION PLC	3,650	101.270	369,635.500	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	22.510	292,022.230	
WASTE CONNECTIONS INC	10,437	117.360	1,224,886.320	
JUNIPER NETWORKS INC	12,700	28.320	359,664.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	125.360	551,584.000	
JOHNSON & JOHNSON	106,600	168.190	17,929,054.000	
PLUG POWER INC	21,100	14.200	299,620.000	
ABBVIE INC	71,672	137.620	9,863,500.640	
HOLOGIC INC	10,100	67.870	685,487.000	

KIMBERLY-CLARK CORP	13,700	123.310	1,689,347.000	
KROGER CO	28,300	50.390	1,426,037.000	
KLA CORP	6,100	316.470	1,930,467.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	416.170	4,120,083.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	227.040	703,824.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	32.800	344,400.000	
LOWE'S COS INC	27,200	177.940	4,839,968.000	
ELI LILLY & CO	32,785	290.790	9,533,550.150	
LAM RESEARCH CORP	5,680	449.770	2,554,693.600	
LOEWS CORP	8,600	58.540	503,444.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	48.320	321,279.680	
MCDONALD'S CORP	30,150	238.760	7,198,614.000	
3M CO	23,190	135.250	3,136,447.500	
META PLATFORMS INC CLASS A	93,600	163.730	15,325,128.000	
S&P GLOBAL INC	14,439	317.430	4,583,371.770	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,500	316.470	791,175.000	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,120	264.630	561,015.600	
ALCOA CORP	7,700	48.920	376,684.000	
PHILLIPS 66	19,500	104.130	2,030,535.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	29.400	471,870.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,100	83.800	846,380.000	
METLIFE INC	28,400	61.860	1,756,824.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	34,200	48.520	1,659,384.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,000	91.930	919,300.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,798	203.310	1,382,101.380	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,157.630	1,041,867.000	
BAKER HUGHES CO	38,823	32.930	1,278,441.390	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,700	200.420	941,974.000	
MERCK & CO. INC.	102,521	84.500	8,663,024.500	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	60.370	1,252,737.870	
MASCO CORP	9,500	51.210	486,495.000	
M & T BANK CORP	7,299	164.900	1,203,605.100	
MARSH & MCLENNAN COS	20,370	147.260	2,999,686.200	
BLACK KNIGHT INC	6,350	64.420	409,067.000	
HEICO CORP-CLASS A	3,020	108.060	326,341.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,202	152.220	1,705,168.440	

WORKDAY INC-CLASS A	8,000	139.380	1,115,040.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	47.140	136,706.000	
BLOCK INC CLASS A	21,012	60.300	1,267,023.600	
TRANSUNION	7,800	77.330	603,174.000	
VISTRA CORP	17,600	22.960	404,096.000	
NOVOCURE LTD	3,850	59.870	230,499.500	
NETAPP INC	9,000	64.320	578,880.000	
NIKE INC -CL B	51,700	110.720	5,724,224.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,700	222.810	2,161,257.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,500	60.950	1,371,375.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,605	86.780	659,961.900	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	34.080	483,936.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,000	454.460	2,726,760.000	
APTIV PLC	11,000	94.920	1,044,120.000	
NEWMONT CORP	32,311	63.090	2,038,500.990	
MCKESSON CORP	6,100	306.520	1,869,772.000	
XYLEM INC	7,300	76.500	558,450.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,800	98.970	6,215,316.000	
NUCOR CORP	11,100	113.720	1,262,292.000	
WESTERN UNION CO	15,246	16.460	250,949.160	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	66.360	451,248.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	18.470	303,683.740	
EVERGY INC	9,350	61.320	573,342.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	37,924	62.090	2,354,701.160	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,050	173.040	181,692.000	
OKTA INC	6,000	81.470	488,820.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	53.410	154,889.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	113.590	636,104.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	20.900	361,674.500	
LINDE PLC	20,846	295.620	6,162,494.520	
WIX.COM LTD	2,310	55.590	128,412.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	26.210	414,118.000	
KKR & CO INC	22,600	47.100	1,064,460.000	
PAYCHEX INC	13,200	117.470	1,550,604.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	596.690	1,611,063.000	
ALTRIA GROUP INC	73,700	46.290	3,411,573.000	
P G & E CORP	60,400	9.960	601,584.000	
PFIZER INC	228,013	47.920	10,926,382.960	
CIGNA CORP	13,000	245.710	3,194,230.000	

DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	47.350	558,777.350	
XCEL ENERGY INC	22,100	65.880	1,455,948.000	
STERIS PLC	4,100	203.670	835,047.000	
SEA LTD-ADR	14,900	70.950	1,057,155.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	29.650	178,878.450	
FOX CORP - CLASS A	12,799	32.030	409,951.970	
STRYKER CORP	13,780	200.580	2,763,992.400	
LYFT INC-A	12,500	14.160	177,000.000	
DOW INC	29,818	58.560	1,746,142.080	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,100	64.740	265,434.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,800	106.860	940,368.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,200	252.630	1,313,676.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	59,400	21.090	1,252,746.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,400	264.550	2,486,770.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	97,167	133.840	13,004,831.280	
EXELON CORP	39,722	42.310	1,680,637.820	
TELADOC HEALTH INC	6,500	29.270	190,255.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,508	43.770	722,555.160	
NVR INC	130	3,905.080	507,660.400	
CONOCOPHILLIPS	52,702	111.490	5,875,745.980	
TWILIO INC - A	7,000	81.860	573,020.000	
DOCUSIGN INC	8,000	57.280	458,240.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	270.450	567,945.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,300	45.160	239,348.000	
PEPSICO INC	56,100	156.120	8,758,332.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,620	119.470	193,541.400	
DROPBOX INC-CLASS A	11,400	20.550	234,270.000	
MONGODB INC	2,700	241.000	650,700.000	
SNAP INC - A	44,400	11.910	528,804.000	
CORTEVA INC	29,468	56.390	1,661,700.520	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,200	94.140	1,430,928.000	
AMCOR PLC	61,400	12.090	742,326.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,000	159.260	1,274,080.000	
ROKU INC	4,800	74.290	356,592.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,400	133.470	987,678.000	

ACCENTURE PLC-CL A	25,600	275.120	7,043,072.000	
KORNIT DIGITAL LTD	1,900	33.950	64,505.000	
PENTAIR PLC	6,675	45.860	306,115.500	
QUALCOMM INC	45,700	130.260	5,952,882.000	
INVESCO LTD	14,100	16.240	228,984.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	171.480	437,274.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	63.940	677,764.000	
DATADOG INC - CLASS A	9,100	87.110	792,701.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,100	17.190	397,089.000	
AVALARA INC	3,650	69.760	254,624.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,300	548.350	2,357,905.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,000	123.060	1,107,540.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	1,951.510	3,317,567.000	
ROSS STORES INC	14,300	74.000	1,058,200.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	147.230	563,890.900	
RESMED INC	5,900	202.010	1,191,859.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	127.070	601,041.100	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	81.430	366,435.000	
MODERNA INC	13,900	121.560	1,689,684.000	
HUBSPOT INC	1,780	295.850	526,613.000	
PERKINELMER INC	5,100	138.140	704,514.000	
CARRIER GLOBAL CORP	34,687	35.940	1,246,650.780	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,338	69.210	1,199,962.980	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,800	105.970	402,686.000	
AVANTOR INC	24,800	29.720	737,056.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	33.190	265,520.000	
DYNATRACE INC	8,100	38.820	314,442.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,900	45.400	812,660.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	37,985	19.350	735,009.750	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	31.070	341,770.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,000	38.200	534,800.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	78.840	254,653.200	
MATCH GROUP INC	11,600	73.070	847,612.000	
CHEVRON CORP	79,018	167.550	13,239,465.900	
PELTON INTERACTIVE INC-A	11,700	9.580	112,086.000	
ZSCALER INC	3,400	142.110	483,174.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,400	60.980	939,092.000	
ETSY INC	5,200	71.610	372,372.000	
TESLA INC	35,550	662.670	23,557,918.500	



SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,700	113.870	990,669.000	
NORTONLIFELOCK INC	23,600	21.990	518,964.000	
UNITY SOFTWARE INC	7,900	33.760	266,704.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	106.770	704,895.540	
SYNOPSYS INC	6,200	295.160	1,829,992.000	
CARVANA CO	3,900	20.920	81,588.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,250	27.050	87,912.500	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,100	40.790	411,979.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,905	451.970	2,216,912.850	
VIATRIS INC	49,021	10.320	505,896.720	
DOORDASH INC - A	7,850	58.460	458,911.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	26.120	381,352.000	
AIRBNB INC-CLASS A	13,600	98.870	1,344,632.000	
CBRE GROUP INC - A	13,600	70.580	959,888.000	
TWITTER INC	32,500	37.220	1,209,650.000	
SOUTHERN CO/THE	43,000	66.780	2,871,540.000	
SYSCO CORP	20,600	80.140	1,650,884.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,803	166.310	1,630,336.930	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	43.830	109,575.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	52.860	243,156.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	71.020	557,507.000	
SCHLUMBERGER LTD	57,252	43.220	2,474,431.440	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	43.540	269,948.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	17.700	136,290.000	
AT&T INC	289,591	19.450	5,632,544.950	
APA CORP	14,400	46.000	662,400.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	37.220	225,181.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,500	56.650	991,375.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	39.390	342,693.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,000	229.480	2,294,800.000	
SEMPRA ENERGY	12,800	144.820	1,853,696.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	30.830	240,474.000	
CLARIVATE PLC	13,400	13.210	177,014.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	66,500	7.820	520,030.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	75.630	639,073.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	51.580	252,742.000	

TEXAS INSTRUMENTS INC	37,400	154.080	5,762,592.000	
SALESFORCE.COM INC	39,866	164.450	6,555,963.700	
WESTROCK CO	10,700	42.770	457,639.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,209	49.360	800,076.240	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,534	49.600	1,415,286.400	
TERADYNE INC	6,600	90.910	600,006.000	
UNION PACIFIC CORP	25,780	208.490	5,374,872.200	
MARATHON OIL CORP	29,900	28.790	860,821.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	102.670	2,462,847.960	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	60,479	91.320	5,522,942.280	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,700	174.160	5,172,552.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,704	200.880	1,547,579.520	
AMEREN CORPORATION	10,500	83.300	874,650.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,066	461.750	17,576,975.500	
APPLOVIN CORP CLASS A	4,900	32.350	158,515.000	
VERISIGN INC	4,000	161.180	644,720.000	
LUCID GROUP INC	16,800	16.600	278,880.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	7,000	27.300	191,100.000	
VALERO ENERGY CORP	16,642	133.750	2,225,867.500	
UPSTART HOLDINGS INC	2,800	34.270	95,956.000	
ULTA BEAUTY INC	2,200	392.670	863,874.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	37.380	406,993.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	104.870	296,782.100	
ANTHEM INC	9,800	460.400	4,511,920.000	
WALT DISNEY CO/THE	73,762	94.220	6,949,855.640	
WELLS FARGO & CO	155,022	37.430	5,802,473.460	
WASTE MANAGEMENT INC	16,800	145.620	2,446,416.000	
WILLIAMS COS INC	49,300	32.340	1,594,362.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	192.170	883,982.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	155.360	372,864.000	
WALMART INC	61,900	119.460	7,394,574.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,500	105.270	894,795.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	58.010	261,045.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	45,500	2.450	111,475.000	
WABTEC CORP	7,111	86.320	613,821.520	
TJX COMPANIES INC	48,400	57.330	2,774,772.000	

WATERS CORP	2,500	321.490	803,725.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	300.740	661,628.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	29,700	40.200	1,193,940.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	194.870	947,652.810	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	49.240	625,348.000	
WEC ENERGY GROUP INC	12,800	92.050	1,178,240.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	60.970	1,243,788.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	67,250	193.520	13,014,220.000	
PPL CORP	29,800	26.030	775,694.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,224	54.440	719,914.560	
PULTEGROUP INC	9,850	39.880	392,818.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	90,253	13.980	1,261,736.940	
PPG INDUSTRIES INC	9,600	111.510	1,070,496.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,000	93.600	748,800.000	
NVIDIA CORP	101,380	158.360	16,054,536.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,013	155.660	2,648,243.580	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	49.950	174,825.000	
TYSON FOODS INC-CL A	11,900	83.920	998,648.000	
NETFLIX INC	17,990	167.540	3,014,044.600	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,900	507.450	8,068,455.000	
NRG ENERGY INC	9,850	39.420	388,287.000	
GLOBE LIFE INC	3,655	89.450	326,939.750	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,200	136.960	986,112.000	
TEXTRON INC	8,600	60.190	517,634.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	15.550	237,712.850	
OMNICOM GROUP	8,300	64.950	539,085.000	
ORACLE CORP	64,933	70.720	4,592,061.760	
MASTERCARD INC - A	35,400	322.140	11,403,756.000	
ONEOK INC	18,100	60.390	1,093,059.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	10.590	395,557.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,300	380.660	1,636,838.000	
YUM! BRANDS INC	11,700	110.230	1,289,691.000	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,600	121.410	801,306.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	51.360	380,064.000	
BANK OF AMERICA CORP	294,401	31.460	9,261,855.460	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	364.830	693,177.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,500	71.480	536,100.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,200	144.600	3,788,520.000	
ANALOG DEVICES INC	21,191	147.170	3,118,679.470	
ADVANCED MICRO DEVICES	66,327	86.990	5,769,785.730	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	52.020	1,715,203.440	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	92.760	612,216.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	39.490	367,257.000	
AVERY DENNISON CORP	3,330	161.090	536,429.700	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,300	67.870	1,445,631.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,100	84.700	2,041,270.000	
AON PLC-CLASS A	8,700	251.130	2,184,831.000	
AMGEN INC	22,600	235.700	5,326,820.000	
EATON CORP PLC	16,236	130.520	2,119,122.720	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	231.500	1,551,050.000	
APPLIED MATERIALS INC	35,800	96.620	3,458,996.000	
CME GROUP INC	14,600	196.110	2,863,206.000	
ECOLAB INC	10,500	150.280	1,577,940.000	
EQUIFAX INC	4,900	172.020	842,898.000	
GILEAD SCIENCES INC	50,800	57.790	2,935,732.000	
KEURIG DR PEPPER INC	31,700	34.400	1,090,480.000	
HORMEL FOODS CORP	12,100	45.120	545,952.000	
STATE STREET CORP	14,813	62.180	921,072.340	
SCHWAB (CHARLES) CORP	58,840	61.110	3,595,712.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,400	67.480	1,376,592.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	45.440	390,784.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	94.020	468,219.600	
CARDINAL HEALTH INC	11,000	51.110	562,210.000	
FEDEX CORP	10,200	229.950	2,345,490.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	106.580	1,785,641.320	
FMC CORP	5,150	107.920	555,788.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,313	117.170	1,208,374.210	
CITRIX SYSTEMS INC	5,100	92.410	471,291.000	

INTEL CORP	165,100	37.930	6,262,243.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	27.780	444,480.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	66.600	895,770.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,700	185.930	2,361,311.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	5.930	228,898.000	
ILLUMINA INC	6,400	189.410	1,212,224.000	
SEALED AIR CORP	5,800	58.580	339,764.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,500	191.100	2,770,950.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	121.450	528,307.500	
SNAP-ON INC	2,200	205.570	452,254.000	
CARMAX INC	6,600	89.790	592,614.000	
DUKE ENERGY CORP	31,228	100.940	3,152,154.320	
TARGET CORP	19,400	142.700	2,768,380.000	
DOVER CORP	5,800	123.000	713,400.000	
WW GRAINGER INC	1,900	469.900	892,810.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,220	124.320	648,950.400	
CINTAS CORP	3,800	352.440	1,339,272.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,400	31.800	616,920.000	
CLOROX COMPANY	5,000	124.640	623,200.000	
ENTERGY CORP	8,200	107.290	879,778.000	
MICROSOFT CORP	288,600	244.490	70,559,814.000	
INCYTE CORP	7,600	66.180	502,968.000	
CVS HEALTH CORP	53,169	90.640	4,819,238.160	
MEDTRONIC PLC	54,398	88.480	4,813,135.040	
MICRON TECHNOLOGY INC	45,400	58.700	2,664,980.000	
BLACKROCK INC	6,200	591.230	3,665,626.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	25,500	27.600	703,800.000	
HASBRO INC	5,400	80.750	436,050.000	
KELLOGG CO	10,400	68.340	710,736.000	
KEYCORP	37,600	17.540	659,504.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	56,311	58.470	3,292,504.170	
COOPER COS INC/THE	2,000	314.920	629,840.000	
CHUBB LTD	17,299	197.940	3,424,164.060	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	114.040	307,908.000	
ALLSTATE CORP	11,200	121.990	1,366,288.000	
EBAY INC	24,900	42.580	1,060,242.000	

	PAYPAL HOLDINGS INC	44,950	72.460	3,257,077.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	96.240	500,448.000	
	DISH NETWORK CORP-A	9,600	17.630	169,248.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,400	240.780	2,263,332.000	
	TRIMBLE INC	10,200	59.160	603,432.000	
	LENNAR CORP-A	10,600	69.140	732,884.000	
	LEAR CORP	2,300	126.340	290,582.000	
	PROGRESSIVE CORP	23,700	112.410	2,664,117.000	
	PACCAR INC	14,137	84.160	1,189,769.920	
	BIOGEN INC	6,000	194.180	1,165,080.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,400	328.990	1,118,566.000	
	STARBUCKS CORP	46,600	72.310	3,369,646.000	
	PTC INC	4,400	99.890	439,516.000	
	EVERSOURCE ENERGY	14,000	80.740	1,130,360.000	
	INTUIT INC	10,880	364.780	3,968,806.400	
	BORGWARNER INC	9,700	35.060	340,082.000	
	BEST BUY CO INC	8,850	70.590	624,721.500	
	BALL CORP	13,004	66.500	864,766.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,897	35.240	2,040,290.280	
	ELECTRONIC ARTS INC	11,400	127.370	1,452,018.000	
	VULCAN MATERIALS CO	5,400	151.040	815,616.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,300	249.080	2,565,524.000	
	VF CORP	13,400	45.420	608,628.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	24,625	25.410	625,721.250	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	123.610	271,942.000	
	CARNIVAL CORP	34,000	9.520	323,680.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	17.640	384,552.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	183,390	39.840	7,306,257.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	53.680	467,016.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	4.860	217,728.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,314,532,753.010 (177,475,066,984)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	23.080	7,046,254.760	
	BP PLC	781,294	4.349	3,398,238.250	
	UNILEVER PLC	102,796	36.095	3,710,421.620	
	BARCLAYS PLC	672,697	1.567	1,054,519.810	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.879	295,754.080	
PRUDENTIAL PLC	110,258	9.736	1,073,471.880	
NATWEST GROUP PLC	225,536	2.214	499,336.700	
JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	19.885	140,467.640	
BAE SYSTEMS PLC	126,279	7.748	978,409.690	
AVIVA PLC	115,648	4.041	467,333.560	
AVEVA GROUP PLC	4,400	23.650	104,060.000	
GSK	204,162	17.122	3,495,661.760	
INFORMA PLC	60,095	5.018	301,556.710	
MELROSE INDUSTRIES PLC	169,100	1.510	255,425.550	
AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.134	195,102.260	
DCC PLC	3,964	52.020	206,207.280	
OCADO GROUP PLC	18,300	7.846	143,581.800	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	92.840	269,236.000	
HALMA PLC	15,260	19.365	295,509.900	
ENTAIN PLC	22,700	13.415	304,520.500	
JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.117	111,414.750	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	6.070	183,119.760	
M&G PLC	104,504	2.018	210,889.070	
RELX PLC	77,624	20.810	1,615,355.440	
DIAGEO PLC	92,930	34.480	3,204,226.400	
RIO TINTO PLC	45,102	55.550	2,505,416.100	
STANDARD CHARTERED PLC	104,659	5.996	627,535.360	
TESCO PLC	306,336	2.467	755,730.910	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	11.640	411,020.040	
GLENCORE PLC	396,950	4.833	1,918,459.350	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	7.718	102,263.500	
SMITHS GROUP PLC	15,383	14.745	226,822.330	
PEARSON PLC	28,363	7.384	209,432.390	
SAINSBURY (J) PLC	65,325	2.033	132,805.720	
NEXT PLC	5,311	59.380	315,367.180	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.247	182,901.230	
WHITBREAD PLC	8,127	25.660	208,538.820	
BUNZL PLC	13,562	26.230	355,731.260	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	1.255	1,357,307.360	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	59.660	334,155.660	
KINGFISHER PLC	78,711	2.348	184,813.420	
WPP PLC	45,847	8.180	375,028.460	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,400	10.280	271,392.000	
SEVERN TRENT PLC	9,733	28.070	273,205.310	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	4.524	337,969.940	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,699	59.880	1,718,496.120	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	11.035	239,812.620	
SCHRODERS PLC	4,650	26.260	122,109.000	
SSE PLC	42,791	16.415	702,414.260	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	4.872	192,444.000	
ASTRAZENECA PLC	62,204	97.500	6,064,890.000	
FERGUSON PLC	8,777	91.860	806,255.220	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.415	578,848.930	
3I GROUP PLC	39,073	11.045	431,561.280	
ASHTED GROUP PLC	17,854	36.510	651,849.540	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	5.984	240,042.170	
NATIONAL GRID PLC	146,368	10.505	1,537,595.840	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.433	1,236,050.630	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	18.010	687,279.610	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	40.250	170,338.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,395	35.045	3,062,757.770	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	15.685	216,453.000	
HSBC HOLDINGS PLC	812,875	5.204	4,230,201.500	
ANGLO AMERICAN PLC	51,015	34.550	1,762,568.250	
MONDI PLC	18,800	14.235	267,618.000	
COMPASS GROUP PLC	71,629	16.700	1,196,204.300	
PERSIMMON PLC	12,832	21.500	275,888.000	
BT GROUP PLC	345,300	1.796	620,331.450	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	16.740	130,572.000	
BURBERRY GROUP PLC	16,061	15.930	255,851.730	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,136	43.510	310,487.360	
INTERTEK GROUP PLC	6,481	42.330	274,340.730	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,211	67.380	890,157.180	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	15.095	99,627.000	
ADMIRAL GROUP PLC	7,500	21.300	159,750.000	
ANTOFAGASTA PLC	15,300	13.930	213,129.000	
ABRDN PLC	84,362	1.694	142,909.220	



	EXPERIAN PLC	37,016	23.230	859,881.680	
イギリス・ボンド 小計				イギリス・ボンド 70,994,686.900 (11,516,048,162)	
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	18.030	928,508.940	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	231.500	381,975.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	161.200	732,009.200	
	ICL GROUP LTD	28,100	35.580	999,798.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	678.000	745,800.000	
	BANK HAPOALIM BM	52,858	30.090	1,590,497.220	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	60,486	31.100	1,881,114.600	
	NICE LTD	2,628	657.000	1,726,596.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	110.500	707,973.500		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 9,694,272.460 (377,517,266)	
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	4.590	389,920.500	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	3.070	322,638.580	
	BHP GROUP LTD	192,410	44.260	8,516,066.600	
	SOUTH32 LTD	177,077	4.490	795,075.730	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,702	32.990	2,365,448.980	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,370	19.630	1,263,583.100	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,782	26.840	3,295,468.880	
	WESTPAC BANKING CORP	134,848	20.070	2,706,399.360	
	SANTOS LTD	122,304	8.100	990,662.400	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	106,511	22.000	2,343,242.000	
	RIO TINTO LTD	14,134	111.050	1,569,580.700	
	ORIGIN ENERGY LTD	64,700	5.920	383,024.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	4.020	271,752.000	
	XERO LTD	5,135	81.900	420,556.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	23.830	188,257.000	
	COLES GROUP LTD	50,794	17.140	870,609.160	
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	36.640	197,856.000		
IDP EDUCATION LTD	7,900	22.150	174,985.000		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	8.060	359,347.040		

EVOLUTION MINING LTD	65,600	3.330	218,448.000	
REECE LTD	10,500	13.880	145,740.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.150	366,509.000	
SEEK LTD	12,845	21.710	278,864.950	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	10.850	298,689.650	
NEWCREST MINING LTD	34,097	23.220	791,732.340	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	64,787	91.200	5,908,574.400	
AMPOL LTD	8,800	34.440	303,072.000	
ORICA LTD	14,900	15.670	233,483.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	11.500	647,093.500	
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,992	33.830	1,555,909.360	
CROWN RESORTS LTD	13,400	13.050	174,870.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	4.840	171,669.960	
TELSTRA CORP LTD	156,394	3.750	586,477.500	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	16,400	32.470	532,508.000	
MACQUARIE GROUP LTD	13,928	163.350	2,275,138.800	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	34.250	784,633.250	
CSL LTD	18,315	264.050	4,836,075.750	
WESFARMERS LTD	43,107	42.000	1,810,494.000	
COCHLEAR LTD	2,510	205.640	516,156.400	
BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	16.470	293,166.000	
SUNCORP GROUP LTD	48,015	10.480	503,197.200	
ASX LTD	7,365	77.520	570,934.800	
COMPUTERSHARE LTD	20,689	23.530	486,812.170	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	90,636	4.170	377,952.120	
SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	33.320	577,368.960	
BRAMBLES LTD	52,700	10.500	553,350.000	
MINERAL RESOURCES LTD	6,200	55.560	344,472.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	74.780	521,440.940	
REA GROUP LTD	2,023	103.440	209,259.120	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	63.680	140,096.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 54,438,662.700 (5,068,239,497)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	54.350	1,820,725.000	

IMPERIAL OIL LTD	9,100	69.000	627,900.000	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	1,859.470	1,487,576.000	
RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	62.020	724,827.740	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	50.400	902,160.000	
INTACT FINANCIAL CORP	7,050	175.610	1,238,050.500	
BCE INC	4,930	63.450	312,808.500	
FRANCO-NEVADA CORP	7,600	179.440	1,363,744.000	
SUNCOR ENERGY INC	56,730	51.000	2,893,230.000	
METRO INC/CN	9,600	67.900	651,840.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	89.100	1,193,940.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	80.660	3,887,812.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,700	64.980	2,319,786.000	
TORONTO-DOMINION BANK	72,200	89.350	6,451,070.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	10,700	31.850	340,795.000	
ROYAL BANK OF CANADA	56,150	126.010	7,075,461.500	
TOURMALINE OIL CORP	12,500	70.360	879,500.000	
TC ENERGY CORP	38,950	70.190	2,733,900.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	21,829	49.820	1,087,520.780	
BARRICK GOLD CORP	70,500	25.210	1,777,305.000	
CAE INC	12,600	30.780	387,828.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	125.770	856,745.240	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	39.770	258,505.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	105.710	369,985.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,850	57.700	337,545.000	
HYDRO ONE LTD	13,100	33.800	442,780.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,560	112.520	738,131.200	
NORTHLAND POWER INC	8,700	37.140	323,118.000	
WSP GLOBAL INC	4,700	138.840	652,548.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	104.950	346,335.000	
PARKLAND CORP	5,800	37.220	215,876.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	27.480	164,880.000	
EMERA INC	10,400	59.380	617,552.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	97.740	322,542.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	38.440	184,512.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,000	59.390	831,460.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	81.190	129,904.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500	9.190	206,775.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,117	62.890	1,139,378.130	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	17.100	456,570.000	
AIR CANADA	6,500	17.970	116,805.000	
KINROSS GOLD CORP	46,500	5.260	244,590.000	
BANK OF MONTREAL	25,700	128.400	3,299,880.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	33.920	753,024.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,500	393.050	1,768,725.000	
NUTRIEN LTD	22,019	113.000	2,488,147.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	44.930	211,171.000	
CAMECO CORP	15,800	28.860	455,988.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	153.000	229,500.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	34.140	242,394.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	26.310	139,443.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	52.720	137,072.000	
TELUS CORP	10,800	29.300	316,440.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	18,800	51.160	961,808.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	163.570	359,854.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	78.480	3,657,168.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	659.210	659,210.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	74.150	837,895.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,937	146.210	429,418.770	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	27.050	210,990.000	
BLACKBERRY LTD	19,400	6.680	129,592.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,200	59.320	1,376,224.000	
ENBRIDGE INC	80,300	55.640	4,467,892.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	55,925	58.220	3,255,953.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	77,000	21.910	1,687,070.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	9.590	108,367.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	36,820	88.740	3,267,406.800	
IA FINANCIAL CORP INC	4,100	62.170	254,897.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	36.500	273,750.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	27,150	140.520	3,815,118.000	
CGI INC - CLASS A	8,700	97.240	845,988.000	
ONEX CORPORATION	2,900	68.710	199,259.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	34.070	647,330.000	
IGM FINANCIAL INC	3,100	35.430	109,833.000	
TMX GROUP LTD	2,100	133.260	279,846.000	

	OPEN TEXT CORP	10,400	48.280	502,112.000	
	SAPUTO INC	9,500	27.180	258,210.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	31.920	743,736.000	
	FORTIS INC	18,700	59.340	1,109,658.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	78.530	345,532.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	9.970	245,262.000	
	CENOVUS ENERGY INC	55,500	28.730	1,594,515.000	
	DOLLARAMA INC	11,200	72.280	809,536.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	27.690	307,359.000	
	KEYERA CORP	8,800	33.470	294,536.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	19.700	563,420.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 93,764,847.160 (9,770,297,074)	
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	3.650	392,010.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,100	27.090	1,330,119.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	75,400	29.820	2,248,428.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.130	276,891.750	
	KEPPEL CORP LTD	59,300	6.690	396,717.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	7.200	123,120.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.920	127,512.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	141,000	11.430	1,611,630.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.750	178,500.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.040	190,848.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	343,850	2.520	866,502.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	3.980	249,546.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.640	344,148.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.060	324,800.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 8,660,771.750 (839,661,821)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	VIFOR N . LINIE AG	1,800	173.700	312,660.000	
	UBS GROUP AG-REG	138,062	15.990	2,207,611.380	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	350.000	413,000.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	717.000	200,760.000	

ADECCO GROUP AG-REG	6,360	33.500	213,060.000	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	27,580	305.750	8,432,585.000	
SIKA AG-REG	5,717	227.200	1,298,902.400	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	96,700.000	386,800.000	
ABB LTD-REG	64,447	27.470	1,770,359.090	
SWISS RE AG	11,842	76.000	899,992.000	
NESTLE SA-REG	110,493	108.620	12,001,749.660	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	852.000	766,800.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	175.500	280,975.500	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	5.904	614,305.290	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	46.060	401,090.480	
SGS SA-REG	252	2,123.000	534,996.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	171.000	159,714.000	
TEMENOS AG - REG	2,500	72.060	180,150.000	
VAT GROUP AG	1,050	241.000	253,050.000	
ALCON INC	19,611	66.320	1,300,601.520	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,090	229.000	249,610.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,905	419.100	2,474,785.500	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	153.800	276,840.000	
CLARIANT AG-REG	7,700	18.620	143,374.000	
NOVARTIS AG-REG	86,001	80.720	6,942,000.720	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	2,076.000	292,716.000	
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	68.550	85,687.500	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,490	98.840	2,025,231.600	
SWISSCOM AG-REG	1,000	530.200	530,200.000	
GEBERIT AG-REG	1,400	472.000	660,800.000	
GIVAUDAN-REG	360	3,124.000	1,124,640.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	102.300	448,994.700	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	314.400	663,384.000	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,600	51.840	342,144.000	
LONZA GROUP AG-REG	2,925	502.200	1,468,935.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	43.240	82,156.000	
HOLCIM LTD	21,829	45.630	996,057.270	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	513.000	634,581.000	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	233.700	498,949.500	
SWISS PRIME SITE-REG	3,025	88.550	267,863.750	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,350.000	392,700.000	

スイス・フラン 小計				スイス・フラン	
				53,230,812.860	
				(7,186,692,044)	
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	204.600	1,621,250.400	
	INVESTOR CLASS A	20,000	189.100	3,782,000.000	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	74.170	1,840,009.360	
	ERICSSON LM-B SHS	121,513	75.250	9,143,853.250	
	VOLVO AB-B SHS	62,823	164.540	10,336,896.420	
	SKF AB-B SHARES	15,400	166.750	2,567,950.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	134.040	1,152,744.000	
	SWEDISH MATCH AB	65,778	101.000	6,643,578.000	
	TELE2 AB-B SHS	20,200	115.100	2,325,020.000	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	250.000	2,300,000.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	67,756	108.600	7,358,301.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,723	94.700	5,750,468.100	
	SWEDBANK AB - A SHARES	37,702	149.400	5,632,678.800	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	29,300	133.240	3,903,932.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	24,400	161.400	3,938,160.000	
	SKANSKA AB-B SHS	13,650	162.150	2,213,347.500	
	SANDVIK AB	45,700	189.100	8,641,870.000	
	INVESTOR AB-B SHS	75,850	170.880	12,961,248.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,824	100.360	11,222,656.640	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	171.200	1,369,600.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,906	450.400	1,759,262.400	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	87.840	1,049,688.000	
	TELIA CO AB	110,667	39.050	4,321,546.350	
	ALFA LAVAL AB	12,700	244.000	3,098,800.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	64,981	87.700	5,698,833.700	
	ASSA ABLOY AB-B	41,727	220.600	9,204,976.200	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	236.800	1,241,542.400	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	54.760	1,438,435.680	
	INDUTRADE AB	11,371	206.000	2,342,426.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	217.000	1,525,944.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	428.100	1,284,300.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	209.100	1,191,870.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	172.750	1,641,125.000	

	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,092	71.840	4,532,529.280	
	LUNDIN ENERGY AB	8,050	480.400	3,867,220.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	25,354	251.900	6,386,672.600	
	EMBRACER GROUP AB	26,594	80.750	2,147,465.500	
	BOLIDEN AB	11,387	357.100	4,066,297.700	
	EPIROC AB-A	27,436	177.200	4,861,659.200	
	EPIROC AB-B	15,700	151.450	2,377,765.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	77.680	1,324,444.000	
	NORDEA BANK ABP	137,760	98.140	13,519,766.400	
	EQT AB	12,318	218.500	2,691,483.000	
	EVOLUTION AB	7,612	905.500	6,892,666.000	
	SINCH AB	21,300	37.525	799,282.500	
	KINNEVIK AB - B	9,300	168.000	1,562,400.000	
	HEXAGON AB-B SHS	81,032	109.150	8,844,642.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	234.800	1,455,760.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 205,834,367.780 (2,727,305,373)	
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	755.400	52,957,317.000	
	DANSKE BANK A/S	27,900	109.600	3,057,840.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	18,340.000	2,402,540.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	42,042	160.280	6,738,491.760	
	GN STORE NORD A/S	5,465	237.100	1,295,751.500	
	CARLSBERG AS-B	4,180	847.600	3,542,968.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,300	400.800	3,326,640.000	
	COLOPLAST-B	4,850	749.600	3,635,560.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	994.600	8,235,288.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,800.000	666,000.000	
	DEMANT A/S	4,275	273.300	1,168,357.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	18,555.000	4,267,650.000	
	TRYG A/S	14,990	155.450	2,330,195.500	
	PANDORA A/S	4,000	482.500	1,930,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	475.900	2,046,370.000	
	GENMAB A/S	2,737	1,968.500	5,387,784.500	
	ORSTED A/S	7,875	693.700	5,462,887.500	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 108,451,641.260 (2,052,989,569)	



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	4.430	232,575.000	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.360	160,800.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.530	329,734.170	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.270	378,861.510	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	19.500	471,900.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,573,870.680 (132,126,443)	
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	38,050	183.150	6,968,857.500	
	NORSK HYDRO ASA	54,200	64.040	3,470,968.000	
	ORKLA ASA	30,350	73.140	2,219,799.000	
	TELENOR ASA	29,131	127.600	3,717,115.600	
	EQUINOR ASA	40,687	353.700	14,390,991.900	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	472.000	3,143,520.000	
	MOWI ASA	17,800	239.300	4,259,540.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	194.000	1,561,700.000	
	AKER BP ASA	4,900	414.500	2,031,050.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	331.200	1,233,057.600	
	SALMAR ASA	2,452	680.500	1,668,586.000	
ADEVINTA ASA	12,000	65.850	790,200.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 45,455,385.600 (613,193,152)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	27,891	19.726	550,177.860	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	27.360	489,798.720	
	BAYER AG-REG	38,659	63.610	2,459,098.990	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	24.730	197,840.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	9.256	752,771.960	
	COMMERZBANK AG	42,031	7.522	316,157.180	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	191.450	229,740.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,300	144.160	1,052,368.000	
	SIEMENS AG-REG	29,700	109.220	3,243,834.000	
	E.ON SE	88,344	9.090	803,046.960	
UNIPER SE	6,650	20.620	137,123.000		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,027	77.610	1,011,025.470	
GEA GROUP AG	5,800	34.740	201,492.000	
CONTINENTAL AG	4,342	70.620	306,632.040	
BASF SE	36,141	48.390	1,748,862.990	
ALLIANZ SE-REG	15,900	182.060	2,894,754.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,800	58.780	399,704.000	
RHEINMETALL AG	1,813	206.700	374,747.100	
RWE AG	25,279	38.170	964,899.430	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	5.712	125,378.400	
BRENNTAG SE	6,090	70.780	431,050.200	
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	29.630	488,391.290	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	28.590	109,757.010	
SAP SE	40,592	87.010	3,531,909.920	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,514	219.400	1,209,771.600	
ZALANDO SE	8,783	27.670	243,025.610	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	49.680	283,573.440	
KION GROUP AG	2,700	39.310	106,137.000	
COVESTRO AG	7,300	39.600	289,080.000	
RATIONAL AG	190	580.000	110,200.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	314.900	381,029.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	68.460	413,156.100	
DELIVERY HERO SE	6,443	31.830	205,080.690	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	112.750	179,498.000	
BECHTLE AG	3,238	36.560	118,381.280	
NEMETSCHEK SE	2,284	57.460	131,238.640	
SCOUT24 AG	3,600	52.640	189,504.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	3.608	137,104.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	49.760	552,186.720	
KNORR-BREMSE AG	2,800	58.180	162,904.000	
HELLOFRESH SE	6,516	28.920	188,442.720	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	15.605	269,810.450	
BEIERSDORF AG	3,980	93.040	370,299.200	
MERCK KGAA	5,086	163.450	831,306.700	
ADIDAS AG	7,200	164.540	1,184,688.000	
PUMA SE	4,163	66.100	275,174.300	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	58.450	239,703.450	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	127,596	17.818	2,273,505.520	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	50.460	407,212.200	

MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	62.290	2,024,425.000	
QIAGEN N.V.	9,105	40.830	371,757.150	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,388	24.270	1,247,186.760	
HANNOVER RUECK SE	2,378	139.250	331,136.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,003	34.580	1,348,723.740	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,478	151.850	1,135,534.300	
MTU AERO ENGINES AG	2,104	168.750	355,050.000	
SYMRISE AG	5,228	95.720	500,424.160	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.780	114,847.360	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,200	71.900	158,180.000	
VONOVIA SE	28,000	31.620	885,360.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	83.160	232,848.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	20.910	729,759.000	
NN GROUP NV	11,292	44.580	503,397.360	
ARCELORMITTAL	25,700	25.935	666,529.500	
HEINEKEN NV	10,196	89.000	907,444.000	
AEGON NV	67,994	4.357	296,249.850	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,149	25.200	1,036,954.800	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	70.740	502,254.000	
KONINKLIJKE DSM NV	6,880	141.850	975,928.000	
WOLTERS KLUWER	10,328	84.960	877,466.880	
ING GROEP NV	153,619	9.624	1,478,429.250	
KONINKLIJKE KPN NV	127,800	3.316	423,784.800	
ASML HOLDING NV	15,979	471.200	7,529,304.800	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	10.180	170,006.000	
IMCD NV	2,246	132.250	297,033.500	
ADYEN NV	857	1,155.400	990,177.800	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	17.108	123,519.760	
PROSUS NV	35,480	47.645	1,690,444.600	
JDE PEET'S NV	3,700	26.140	96,718.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,800	256.050	460,890.000	
RANDSTAD NV	4,720	47.200	222,784.000	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	69.900	297,075.000	
OCI NV	4,386	33.300	146,053.800	
TOTALENERGIES SE	97,492	54.080	5,272,367.360	
MICHELIN (CGDE)	6,685	108.600	725,991.000	

AIR LIQUIDE SA	20,576	134.980	2,777,348.480	
KERING	2,942	491.300	1,445,404.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,274	116.980	2,488,632.520	
BOUYGUES SA	9,062	30.280	274,397.360	
BNP PARIBAS	43,684	47.335	2,067,782.140	
THALES SA	4,100	113.500	465,350.000	
DANONE	25,708	51.740	1,330,131.920	
CARREFOUR SA	24,454	18.765	458,879.310	
VIVENDI	29,591	10.910	322,837.810	
L'OREAL	9,500	301.650	2,865,675.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,572	48.240	944,153.280	
LEGRAND SA	10,524	72.200	759,832.800	
PERNOD RICARD SA	8,241	169.300	1,395,201.300	
EURAZEO SE	1,724	64.350	110,939.400	
SOCIETE GENERALE SA	30,800	22.415	690,382.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	10,921	544.000	5,941,024.000	
ACCOR SA	6,717	27.240	182,971.080	
CAPGEMINI SE	6,452	165.750	1,069,419.000	
VALEO SA	8,400	18.880	158,592.000	
PUBLICIS GROUPE	8,700	46.090	400,983.000	
BUREAU VERITAS SA	11,605	25.050	290,705.250	
EIFFAGE	3,285	87.760	288,291.600	
SODEXO SA	3,491	65.780	229,637.980	
IPSEN	1,400	84.500	118,300.000	
AMUNDI SA	2,250	47.580	107,055.000	
TELEPERFORMANCE	2,315	279.300	646,579.500	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	44.060	158,616.000	
EURONEXT NV	3,300	73.780	243,474.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	77.840	412,240.640	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	296.300	325,930.000	
SEB SA	997	89.600	89,331.200	
ESSILORLUXOTTICA	11,317	134.500	1,522,136.500	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	155.100	155,100.000	
WORLDLINE SA	9,114	32.540	296,569.560	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	32.100	133,632.300	
AXA SA	76,206	22.390	1,706,252.340	
EDENRED	9,500	42.720	405,840.000	
RENAULT SA	7,050	24.250	170,962.500	

HERMES INTERNATIONAL	1,246	980.800	1,222,076.800	
STMICROELECTRONICS NV	26,892	32.500	873,990.000	
REMY COINTREAU	900	152.700	137,430.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	26,247	33.495	879,143.260	
WENDEL	930	86.000	79,980.000	
ORANGE	78,504	10.862	852,710.440	
ALSTOM	12,525	25.010	313,250.250	
SANOFI	44,747	94.150	4,212,930.050	
VINCI SA	20,983	83.690	1,756,067.270	
AIRBUS SE	23,199	96.360	2,235,455.640	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	23.500	615,206.500	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	8.833	433,947.620	
BIOMERIEUX	1,520	85.580	130,081.600	
ENGIE	71,869	11.958	859,409.500	
EDF	22,120	8.160	180,499.200	
SAFRAN SA	13,449	88.700	1,192,926.300	
ARKEMA	2,220	97.340	216,094.800	
ADP	1,110	122.400	135,864.000	
GETLINK SE	17,345	16.920	293,477.400	
BOLLORE	32,400	4.750	153,900.000	
UCB SA	4,976	79.020	393,203.520	
KBC GROUP NV	9,843	54.020	531,718.860	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	79.740	334,908.000	
SOLVAY SA	2,800	86.740	242,872.000	
UMICORE	8,269	38.330	316,950.770	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,179	48.820	1,668,618.780	
AGEAS	6,290	40.510	254,807.900	
D' IETEREN GROUP	1,036	140.400	145,454.400	
PROXIMUS	6,035	15.145	91,400.070	
ELIA GROUP SA/NV	1,200	143.000	171,600.000	
SOFINA	600	198.500	119,100.000	
ARGENX SE	1,912	313.900	600,176.800	
PRYSMIAN SPA	10,040	27.680	277,907.200	
ASSICURAZIONI GENERALI	43,547	15.515	675,631.700	
MEDIOBANCA SPA	22,365	8.958	200,345.670	
TENARIS SA	18,608	14.445	268,792.560	
UNICREDIT SPA	83,217	9.715	808,453.150	
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.248	93,975.810	
INTESA SANPAOLO	649,877	1.770	1,150,282.290	

ATLANTIA SPA	19,531	22.230	434,174.130	
POSTE ITALIANE SPA	19,200	9.118	175,065.600	
MONCLER SPA	7,800	38.380	299,364.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	37.580	144,683.000	
ENI SPA	99,314	13.170	1,307,965.380	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	9.026	176,007.000	
DIASORIN SPA	1,000	111.500	111,500.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.242	118,297.600	
NEXI SPA	19,900	7.310	145,469.000	
AMPLIFON SPA	4,700	26.370	123,939.000	
ENEL SPA	320,036	5.333	1,706,751.980	
SNAM SPA	79,350	5.084	403,415.400	
TERNA SPA	55,464	7.228	400,893.790	
EXOR NV	4,273	60.400	258,089.200	
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	12.465	501,903.220	
FINECOBANK SPA	23,200	10.335	239,772.000	
STELLANTIS NV	86,643	12.478	1,081,131.350	
FERRARI NV	4,960	162.650	806,744.000	
TELEFONICA SA	204,487	4.409	901,583.180	
ENDESA SA	12,100	19.085	230,928.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	262,374	4.194	1,100,396.550	
IBERDROLA SA	227,905	9.872	2,249,878.160	
REPSOL SA	57,201	15.345	877,749.340	
GRIFOLS SA	11,830	17.615	208,385.450	
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.623	1,789,764.700	
AMADEUS IT GROUP SA	17,728	50.680	898,455.040	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	27.070	278,821.000	
CAIXABANK SA	174,927	3.217	562,740.150	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	24.020	213,201.520	
AENA SME SA	2,900	131.150	380,335.000	
CELLNEX TELECOM SA	21,460	35.480	761,400.800	
ACCIONA SA	1,028	177.200	182,161.600	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	42,920	22.510	966,129.200	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	17.915	168,651.810	
ENAGAS SA	9,884	20.920	206,773.280	

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	17.965	282,050.500	
	FERROVIAL SA	19,018	23.270	442,548.860	
	UPM-KYMMENE OYJ	21,001	30.610	642,840.610	
	NOKIA OYJ	212,980	4.520	962,669.600	
	WARTSILA OYJ ABP	17,000	7.224	122,808.000	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	15.585	333,519.000	
	ELISA OYJ	5,400	52.520	283,608.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	19,622	40.600	796,653.200	
	FORTUM OYJ	16,900	16.575	280,117.500	
	KESKO OYJ-B SHS	10,400	21.900	227,760.000	
	KONE OYJ-B	13,375	44.740	598,397.500	
	NESTE OYJ	16,646	41.930	697,966.780	
	ORION OYJ-CLASS B	4,000	36.530	146,120.000	
	VERBUND AG	2,600	94.250	245,050.000	
	OMV AG	5,650	48.690	275,098.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	13,546	26.430	358,020.780	
	VOESTALPINE AG	4,250	25.560	108,630.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,400	32.310	303,714.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,076	70.000	425,320.000	
	JERONIMO MARTINS	10,500	18.820	197,610.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.488	490,987.200	
	GALP ENERGIA SGPS SA	18,750	12.620	236,625.000	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,000	21.640	238,040.000	
	KERRY GROUP PLC-A	6,272	91.440	573,511.680	
	CRH PLC	30,126	34.000	1,024,284.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,569	93.480	614,070.120	
	ユーロ 小計			ユーロ 158,590,382.410 (22,329,525,844)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	51.150	2,966,700.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	88,000	41.250	3,630,000.000	
	MTR CORP	62,000	41.500	2,573,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	93.300	5,644,650.000	
	SINO LAND CO	142,000	11.200	1,590,400.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	53.000	5,918,457.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	47.800	884,300.000	

CLP HOLDINGS LTD	67,000	75.500	5,058,500.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	29.400	1,749,505.800	
HONG KONG & CHINA GAS	453,475	8.530	3,868,141.750	
HANG SENG BANK LTD	31,000	137.000	4,247,000.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	29.200	1,854,200.000	
WH GROUP LTD	361,000	5.590	2,017,990.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	50,100	341.600	17,114,160.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	14.380	1,121,640.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	17.520	1,208,880.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	19.080	858,600.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	51.950	4,736,229.550	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	51.350	1,360,775.000	
AIA GROUP LTD	503,600	78.600	39,582,960.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	25.850	1,395,900.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	67,000	34.600	2,318,200.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	20.600	1,398,740.000	
ESR CAYMAN LTD	80,000	21.100	1,688,000.000	
SANDS CHINA LTD	92,800	15.040	1,395,712.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	13.560	1,111,920.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	93.200	5,359,000.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	154,000	30.550	4,704,700.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 127,358,261.100 (2,190,562,091)	
合計			242,279,225,320 [242,279,225,320]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,737	1,062,435.030	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,307	1,284,258.570	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,000	543,840.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	182,361.120	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,400	1,307,064.000	



	EQUITY RESIDENTIAL	14,500	997,310.000	
	EQUINIX INC	3,708	2,293,435.080	
	AMERICAN TOWER CORP	18,500	4,338,065.000	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	498,958.740	
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	428,220.000	
	KIMCO REALTY CORP	25,000	480,000.000	
	INVITATION HOMES INC	24,700	830,661.000	
	VICI PROPERTIES INC	39,000	1,097,070.000	
	VENTAS INC	16,200	784,566.000	
	WEYERHAEUSER CO	30,314	1,043,407.880	
	CROWN CASTLE INTL CORP	17,500	2,763,600.000	
	IRON MOUNTAIN INC	11,800	557,904.000	
	SUN COMMUNITIES INC	4,700	709,888.000	
	PROLOGIS INC	30,002	3,320,021.320	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,200	839,294.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,000	504,000.000	
	DUKE REALTY CORP	15,500	793,600.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,600	666,146.000	
	WELLTOWER INC	18,100	1,401,845.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	513,336.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,700	752,141.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	494,424.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	63,400	375,328.000	
	REALTY INCOME CORP	23,995	1,506,646.050	
	PUBLIC STORAGE	6,400	1,906,176.000	
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	356,580.000	
	UDR INC	12,900	545,928.000	
	WP CAREY INC	7,700	623,469.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	11,500	1,432,555.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,400	857,196.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	361,548.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 38,453,277.790 (5,191,577,035)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	207,167.170	
	SEGRO PLC	48,274	460,920.150	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	179,311.070	

イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 847,398.390 (137,456,493)
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	40,978	371,670.460
	LENDLEASE GROUP	25,300	243,892.000
	TRANSURBAN GROUP	116,720	1,630,578.400
	APA GROUP	45,041	517,971.500
	SCENTRE GROUP	190,722	486,341.100
	GPT GROUP	73,031	303,808.960
	MIRVAC GROUP	144,900	297,045.000
	STOCKLAND	91,123	328,042.800
	GOODMAN GROUP	63,909	1,144,610.190
	VICINITY CENTRES	137,273	239,541.380
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,563,501.790 (517,962,017)
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	150,212.000
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	116,638.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 266,850.000 (27,805,770)
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134,500	369,875.000
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	466,548.400
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125,300	202,986.000
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	87,500	154,000.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,193,409.400 (115,701,042)
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	246,100.000
	GECINA SA	1,817	173,886.900
	KLEPIERRE	8,527	160,478.140
	COVIVIO	2,000	113,400.000
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	190,465.920
ユーロ 小計			ユーロ

			884,330.960 (124,513,799)
香港・ドル	LINK REIT	87,900	香港・ドル 6,012,360.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	817,480.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	152,000	1,629,440.000
	香港・ドル 小計		香港・ドル 8,459,280.000 (145,499,616)
投資証券 合計			6,260,515,772 [6,260,515,772]
合計			6,260,515,772 [6,260,515,772]

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	603銘柄	97.2%	73.6%
	投資証券	36銘柄		
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	98.8%	4.7%
	投資証券	3銘柄		
イスラエル・シケル	株式	9銘柄	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	90.7%	2.2%
	投資証券	10銘柄		
カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.7%	3.9%
	投資証券	2銘柄		
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	87.9%	0.4%
	投資証券	4銘柄		
スイス・フラン	株式	41銘柄	100%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	48銘柄	100%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	100%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	100%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	100%	0.2%

ユーロ	株式	223銘柄	99.4%	0.6%	9.0%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	28銘柄	93.8%	6.2%	0.9%
	投資証券	3銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 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）】**

(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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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）

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	24,088,606	27,920,770
親投資信託受益証券	2,383,595,652	2,584,206,878
流動資産合計	2,407,684,258	2,612,127,648
資産合計	2,407,684,258	2,612,127,648
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	164,756
未払受託者報酬	245,953	289,801
未払委託者報酬	4,858,472	5,724,585
その他未払費用	61,410	72,368
流動負債合計	5,165,835	6,251,510
負債合計	5,165,835	6,251,510
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,212,032,415	1,270,536,081
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,190,486,008	1,335,340,057
（分配準備積立金）	755,982,103	687,265,661
元本等合計	2,402,518,423	2,605,876,138
純資産合計	2,402,518,423	2,605,876,138
負債純資産合計	2,407,684,258	2,612,127,648

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		49		3
有価証券売買等損益		809,087,408		101,006,226
営業収益合計		809,087,457		101,006,229
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,691		5,812
受託者報酬		458,829		568,463
委託者報酬		9,063,652		11,228,943
その他費用		114,677		141,954
営業費用合計		9,642,849		11,945,172
<b>営業利益</b>		799,444,608		89,061,057
経常利益		799,444,608		89,061,057
<b>当期純利益</b>		799,444,608		89,061,057
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		91,055,145		25,645,091
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		474,079,974		1,190,486,008
剰余金増加額又は欠損金減少額		122,817,426		315,973,490
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		122,817,426		315,973,490
剰余金減少額又は欠損金増加額		114,800,855		234,535,407
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		114,800,855		234,535,407
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,190,486,008		1,335,340,057

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,326,765,507円	1,212,032,415円
期中追加設定元本額	193,724,602円	295,982,191円
期中一部解約元本額	308,457,694円	237,478,525円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,212,032,415口	1,270,536,081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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日



1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(678,071,762円)、投資信託約款に規定される収益調整金(434,508,797円)及び分配準備積立金(77,910,341円)より分配対象額は1,190,490,900円(1万口当たり9,822.27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(63,417,139円)、投資信託約款に規定される収益調整金(648,079,610円)及び分配準備積立金(623,848,522円)より分配対象額は1,335,345,271円(1万口当たり10,510.09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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	725,092,232	74,827,931
合計	725,092,232	74,827,931

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.9822円	2.0510円

(1万口当たり純資産額)	(19,822円)	(20,510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	274,421,785	533,311,296	
	外国株式インデックスマザーファンド	519,977,583	2,050,895,582	
親投資信託受益証券 合計			2,584,206,878	
合計			2,584,206,878	

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

前記「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）」に記載のとおりであります。

## 「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6月15日現在	2022年6月15日現在
--	--------------	--------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	215,560,322	478,079,764
コール・ローン	29,208,827	305,393,118
株式	14,656,168,910	17,028,113,216
新株予約権証券	-	71,968
投資証券	1,302,514,974	1,951,173,701
派生商品評価勘定	12,402,243	15,659,858
未収入金	152,656	370,364
未収配当金	65,398,260	136,616,328
差入委託証拠金	89,131,789	385,117,969
流動資産合計	16,370,537,981	20,300,596,286
資産合計	16,370,537,981	20,300,596,286
負債の部		
流動負債		
未払金	50,855,559	-
未払解約金	3,452,183	3,476,653
流動負債合計	54,307,742	3,476,653
負債合計	54,307,742	3,476,653
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,358,825,192	10,444,109,018
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,957,405,047	9,853,010,615
元本等合計	16,316,230,239	20,297,119,633
純資産合計	16,316,230,239	20,297,119,633
負債純資産合計	16,370,537,981	20,300,596,286

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	6,523,403,479円	8,358,825,192円
期中追加設定元本額	2,642,668,944円	3,258,238,518円
期中一部解約元本額	807,247,231円	1,172,954,692円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファ	28,715,778円	52,406,713円
ンド（F0Fs用）（適格機関投		
資家専用）		
ダイワファンドラップ 外国	245,435,587円	274,421,785円
株式インデックス エマー		
ジ		
ングプラス（為替ヘッジな		
し）		

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替 ヘッジなし）	243,719,004円	339,301,678円
D - I ' s 新興国株式イン デックス	130,288,094円	130,108,187円
i F r e e 新興国株式イン デックス	3,303,850,091円	4,289,135,305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）	2,065,810,609円 - 円	2,688,023,683円 4,922,731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）	717,200,752円	936,576,597円
D Cダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	1,154,722,036円	1,280,905,400円
ダイワ・インデックスセレクト ト 新興国株式	371,361,028円	355,144,693円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	97,722,213円	93,162,246円
計	8,358,825,192円	10,444,109,018円
2. 期末日における受益権の総数	8,358,825,192口	10,444,109,018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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
--	--------------	--------------



種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	2,450,796,020	3,082,245,571
新株予約権証券	-	2,909
投資証券	68,541,024	236,846,601
合計	2,519,337,044	3,319,089,263

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年7月7日から2021年6月15日まで、及び2021年7月6日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 株式関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	337,878,040	-	350,046,295	12,168,255	1,225,261,653	-	1,230,515,568	5,253,915
合計	337,878,040	-	350,046,295	12,168,255	1,225,261,653	-	1,230,515,568	5,253,915

(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6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)

		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	55,907,169	-	56,141,157	233,988	272,371,780	-	282,777,723	10,405,943
アメリカ・ドル	55,907,169	-	56,141,157	233,988	272,371,780	-	282,777,723	10,405,943
合計	55,907,169	-	56,141,157	233,988	272,371,780	-	282,777,723	10,405,943

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.9520円	1.9434円
(1万口当たり純資産額)	(19,520円)	(19,434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	3,400	31.080	105,672.000
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	13,700	21.270	291,399.000
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PRAF	29,000	0.000	0.000
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	30,900	10.800	333,720.000
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	46,900	4.440	208,236.000
	CANADIAN SOLAR INC	4,400	29.370	129,228.000
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	35,350	0.000	0.000
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	29,300	6.110	179,023.000
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	3,000	57.530	172,590.000
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	16,700	22.180	370,406.000
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	191,217	0.000	0.000
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	9,608	0.000	0.000
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	36,075	0.000	0.000
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	18,293	0.000	0.000
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	23,394	0.000	0.000
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	174,677	0.000	0.000
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,698	0.000	0.000
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	23,088	0.000	0.000
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	97,499	0.000	0.000
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	426,739	0.000	0.000
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000
	TATNEFT PJSC - PRAF	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 1,790,274.000 (241,704,892)
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー

TATA STEEL LTD	42,577	996.150	42,413,078.550
AXIS BANK LTD	52,655	650.750	34,265,241.250
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,350	7,811.650	18,357,377.500
TATA POWER CO LTD	55,646	220.400	12,264,378.400
BANK OF BARODA	87,329	100.550	8,780,930.950
HINDUSTAN UNILEVER LTD	9,166	2,171.000	19,899,386.000
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	52,485	214.000	11,231,790.000
STATE BANK OF INDIA	75,156	448.100	33,677,403.600
NTPC LTD	182,905	151.400	27,691,817.000
JSW STEEL LTD	30,041	561.900	16,880,037.900
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	133,250	223.950	29,841,337.500
INDIAN OIL CORP LTD	145,795	110.250	16,073,898.750
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	71,540	314.300	22,485,022.000
JINDAL STEEL & POWER LTD	26,088	348.250	9,085,146.000
ULTRATECH CEMENT LTD	1,597	5,428.600	8,669,474.200
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4,617	1,598.600	7,380,736.200
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,020	1,139.450	10,277,839.000
TECH MAHINDRA LTD	11,702	1,030.150	12,054,815.300
YES BANK LTD	17,640	12.700	224,028.000
TATA MOTORS LTD-A-DVR	28,175	197.600	5,567,380.000
REC LTD	72,516	113.500	8,230,566.000
COAL INDIA LTD	165,798	192.200	31,866,375.600
INDUS TOWERS LTD	41,172	201.400	8,292,040.800
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	78,703	101.750	8,008,030.250
GAIL INDIA LTD	129,403	146.950	19,015,770.850
HINDALCO INDUSTRIES LTD	65,918	358.300	23,618,419.400
GRASIM INDUSTRIES LTD	13,711	1,309.350	17,952,497.850
WIPRO LTD	15,583	445.900	6,948,459.700
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	13,539	3,210.550	43,467,636.450
INFOSYS LTD	50,275	1,440.550	72,423,651.250
LARSEN & TOUBRO LTD	18,947	1,544.650	29,266,483.550
TATA MOTORS LTD	128,911	405.150	52,228,291.650
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	35,093	2,109.500	74,028,683.500
ICICI BANK LTD	26,764	685.500	18,346,722.000
RELIANCE INDUSTRIES LTD	70,002	2,628.100	183,972,256.200
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	231,658	155.950	36,127,065.100
ITC LTD	90,971	265.450	24,148,251.950

	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	36,370	1,019.250	37,070,122.500	
	HERO MOTOCORP LTD	5,806	2,557.600	14,849,425.600	
	BHARTI AIRTEL LTD	41,367	682.050	28,214,362.350	
	UPL LTD	17,176	715.700	12,292,863.200	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,416	825.050	12,718,970.800	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	18,004	996.900	17,948,187.600	
	VEDANTA LTD	79,458	291.150	23,134,196.700	
インド・ルピー	小計			インド・ルピー 1,151,290,448.950 (2,003,245,381)	
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	482,900	6,975.000	3,368,227,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,256,300	4,110.000	5,163,393,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	315,500	8,275.000	2,610,762,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	701,600	7,400.000	5,191,840,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	444,100	8,200.000	3,641,620,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,507,200	4,360.000	6,571,392,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	850,400	3,260.000	2,772,304,000.000	
インドネシア・ルピア	小計			インドネシア・ルピア 29,319,539,000.000 (269,739,759)	
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	104,400	20.230	2,112,012.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	186,000	4.500	837,000.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO- A	51,800	45.220	2,342,396.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	301,200	4.720	1,421,664.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	13,000	17.970	233,610.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	2,900	41.230	119,567.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	1,871.000	1,122,600.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	15,900	36.180	575,262.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD- A	56,400	15.140	853,896.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK- A	271,900	7.870	2,139,853.000	

CITIC SECURITIES CO-A	21,500	21.110	453,865.000	
CHINA MERCHANTS BANK-A	51,200	39.240	2,009,088.000	
PING AN BANK CO LTD-A	78,600	14.120	1,109,832.000	
GF SECURITIES CO LTD-A	14,800	19.200	284,160.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	480,400	5.380	2,584,552.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	10,100	24.100	243,410.000	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	87,100	18.280	1,592,188.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	3.950	173,405.000	
CHINA COAL ENERGY CO-A	26,200	11.400	298,680.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	17,160	14.630	251,050.800	
METALLURGICAL CORP OF CHINA	107,900	3.510	378,729.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	70,400	4.970	349,888.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	13,500	18.810	253,935.000	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	4,100	43.350	177,735.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	6.010	183,906.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,081,300	3.020	3,265,526.000	
BANK OF CHINA LTD-A	314,400	3.230	1,015,512.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	284,900	4.240	1,207,976.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	369,900	4.980	1,842,102.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	34,400	34.510	1,187,144.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	67,400	17.750	1,196,350.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	33,300	21.810	726,273.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	48,700	4.730	230,351.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	429,400	3.890	1,670,366.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	392,800	3.190	1,253,032.000	
CRRC CORP LTD-A	118,700	5.120	607,744.000	
CHINA UNITED NETWORK-A	249,500	3.470	865,765.000	
CGN POWER CO LTD-A	18,900	2.810	53,109.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21,300	14.410	306,933.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	33,500	9.810	328,635.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	206,400	6.210	1,281,744.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	123,100	6.630	816,153.000	

	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	10,200	29.830	304,266.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	158,300	5.140	813,662.000	
	BYD CO LTD -A	1,000	343.590	343,590.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	7,100	17.180	121,978.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	23,700	12.840	304,308.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,900	10.010	269,269.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	45,600	6.150	280,440.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA	95,300	5.200	495,560.000	
オフショア・人民元 小計				オフショア・人民元 42,890,071.800 (858,419,054)	
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	12,808	58.000	742,864.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	23,324	107.600	2,509,662.400	
	SAUDI TELECOM CO	16,445	102.000	1,677,390.000	
	AL RAJHI BANK	25,422	90.100	2,290,522.200	
	RIYAD BANK	23,111	35.550	821,596.050	
	ETIHAD ETISALAT CO	14,462	34.500	498,939.000	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,259	53.800	390,534.200	
	ALINMA BANK	18,842	35.750	673,601.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	27,087	66.900	1,812,120.300	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	56,161	39.050	2,193,087.050	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	27,576	16.100	443,973.600	
	SAUDI ELECTRICITY CO	36,517	23.240	848,655.080	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 14,902,945.380 (537,102,151)	
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	0.485	61,110.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	126,000	0.965	121,590.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 182,700.000	

				(17,712,765)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	165,300		107.500	17,769,750.000	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100		134.500	3,644,950.000	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,300		359.000	18,057,700.000	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500		147.500	5,678,750.000	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	67,500		147.500	9,956,250.000	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,168,300		1.240	3,928,692.000	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	98,300		51.250	5,037,875.000	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	38,900		209.000	8,130,100.000	
KRUNG THAI BANK - NVDR	696,300		15.700	10,931,910.000	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	496,400		13.400	6,651,760.000	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	206,100		24.600	5,070,060.000	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	77,200		173.500	13,394,200.000	
IRPC PCL - NVDR	1,120,200		3.420	3,831,084.000	
PTT PCL-NVDR	934,000		36.500	34,091,000.000	
THAI OIL PCL-NVDR	124,200		54.500	6,768,900.000	
CP ALL PCL-NVDR	171,800		62.250	10,694,550.000	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	47,400		134.500	6,375,300.000	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	467,200		8.350	3,901,120.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	374,600		26.250	9,833,250.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	196,600		46.250	9,092,750.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 192,839,951.000 (742,433,812)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	241		70,748.000	17,050,268.000	
CENCOSUD SA	67,112		1,305.000	87,581,160.000	
BANCO SANTANDER CHILE	4,268,255		38.800	165,608,294.000	
ENEL AMERICAS SA	1,363,294		90.300	123,105,448.200	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,872		80,877.000	151,401,744.000	
FALABELLA SA	55,841		2,100.000	117,266,100.000	
BANCO DE CHILE	2,059,872		84.100	173,235,235.200	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ	



				835,248,249.400	
				(129,816,788)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	426,852	15.010	6,407,048.520	
	AKBANK T.A.S.	578,132	8.430	4,873,652.760	
	TURKIYE IS BANKASI-C	810,236	4.800	3,889,132.800	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	195,633	17.800	3,482,267.400	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,407	270.400	5,518,052.800	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,293	30.420	3,537,633.060	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	208,202	19.620	4,084,923.240	
	TURKIYE HALK BANKASI	335,645	5.730	1,923,245.850	
	YAPI VE KREDI BANKASI	421,052	4.620	1,945,260.240	
	KOC HOLDING AS	122,698	39.540	4,851,478.920	
	TURK HAVA YOLLARI AO	121,946	46.860	5,714,389.560	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	35,699	83.650	2,986,221.350	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 49,213,306.500 (385,108,887)	
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	26,500	6.300	166,950.000	
	ENERGISA SA-UNITS	14,700	42.130	619,311.000	
	RUMO SA	50,900	17.060	868,354.000	
	VIBRA ENERGIA SA	113,400	17.020	1,930,068.000	
	VIA SA	226,500	2.290	518,685.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	41,200	13.990	576,388.000	
	TIM SA	52,626	12.460	655,719.960	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	55,500	5.700	316,350.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	376,300	29.600	11,138,480.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	31,200	9.370	292,344.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	470,159	18.640	8,763,763.760	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	415,936	23.650	9,836,886.400	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,700	18.130	556,591.000	
	VALE SA	178,590	81.720	14,594,374.800	
	GERDAU SA-PREF	63,400	25.410	1,610,994.000	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	249,100	32.700	8,145,570.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	99,173	10.840	1,075,035.320	
ITAUSA SA	132,320	8.720	1,153,830.400	
BRASKEM SA-PREF A	16,600	41.390	687,074.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	24,500	40.310	987,595.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	127,700	33.520	4,280,504.000	
COSAN SA	39,200	18.370	720,104.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	55,900	41.450	2,317,055.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	108,400	6.900	747,960.000	
EMBRAER SA	48,900	11.290	552,081.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	119,200	10.830	1,290,936.000	
CCR SA	78,600	12.310	967,566.000	
BRF SA	79,700	13.160	1,048,852.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,600	42.090	1,119,594.000	
LOJAS RENNER S.A.	27,775	22.930	636,880.750	
JBS SA	80,100	33.000	2,643,300.000	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	11,500	9.290	106,835.000	
SUZANO SA	15,845	50.700	803,341.500	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	138,000	11.490	1,585,620.000	
CIELO SA	293,128	3.780	1,108,023.840	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	41,100	23.410	962,151.000	
SUL AMERICA SA - UNITS	34,318	23.950	821,916.100	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	27,630	15.170	419,147.100	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	40,700	30.160	1,227,512.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	34,000	46.350	1,575,900.000	
KLABIN SA - UNIT	32,500	20.920	679,900.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	110,600	12.210	1,350,426.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	39,300	20.280	797,004.000	
COGNA EDUCACAO	401,400	2.250	903,150.000	
BANCO BRADESCO S.A.	138,121	15.540	2,146,400.340	
AMBEV SA	191,000	13.150	2,511,650.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 97,818,174.270 (2,579,895,655)	

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	76,300	8.680	662,284.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	168,600	4.510	760,386.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	80,700	9.660	779,562.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	110,400	4.990	550,896.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 2,753,128.000 (84,071,994)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,073,600	19.940	21,407,584.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	111,300	33.150	3,689,595.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,110,519	7.490	8,317,787.310	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	88,100	141.700	12,483,770.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	19,700	127.920	2,520,024.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	68,800	90.370	6,217,456.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	160,300	66.640	10,682,392.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	82,000	118.780	9,739,960.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 75,058,568.310 (492,797,030)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	29,000	5.420	157,180.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	569,000	4.970	2,827,930.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	193,000	14.620	2,821,660.000	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	217,000	4.470	969,990.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	106,000	12.180	1,291,080.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	136,800	12.020	1,644,336.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,195,800	3.630	11,600,754.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	38,500	17.060	656,810.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	61,400	376.000	23,086,400.000	

SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	544,000	4.420	2,404,480.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	176,000	14.600	2,569,600.000	
PETROCHINA CO LTD-H	2,228,000	4.320	9,624,960.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	20,000	58.600	1,172,000.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	228,000	3.270	745,560.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	428,000	3.520	1,506,560.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	69,500	32.750	2,276,125.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP- H	62,000	15.900	985,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,147,000	5.540	22,974,380.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	592,000	3.810	2,255,520.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	75,500	13.260	1,001,130.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	50,000	10.160	508,000.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	66,600	11.580	771,228.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	36.700	935,850.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI- H	606,000	5.800	3,514,800.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	235,500	26.750	6,299,625.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	143,120	7.150	1,023,308.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	52,000	18.360	954,720.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	166,000	32.400	5,378,400.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	96,000	28.600	2,745,600.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	188,500	4.110	774,735.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	32,000	35.150	1,124,800.000	
BYD CO LTD-H	6,000	303.800	1,822,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA- H	3,445,000	2.910	10,024,950.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	142,000	5.130	728,460.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C- H	67,000	20.950	1,403,650.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU- H	711,000	2.520	1,791,720.000	
CITIC LTD	160,000	8.510	1,361,600.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	145,000	9.280	1,345,600.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,478,000	4.520	20,240,560.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,570,000	0.950	1,491,500.000	

XIAOMI CORP-CLASS B	332,800	11.540	3,840,512.000	
MEITUAN-CLASS B	17,700	194.400	3,440,880.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	333,200	101.200	33,719,840.000	
JD.COM INC - CL A	28,595	241.200	6,897,114.000	
NETEASE INC	25,600	163.100	4,175,360.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	287,000	1.910	548,170.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	67,200	25.250	1,696,800.000	
BAIDU INC-CLASS A	64,650	136.200	8,805,330.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	300,000	21.550	6,465,000.000	
CRRC CORP LTD - H	286,000	3.060	875,160.000	
CGN POWER CO LTD-H	557,000	1.920	1,069,440.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	404,000	46.800	18,907,200.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	152,000	7.830	1,190,160.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	746,000	4.580	3,416,680.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	65,550	12.500	819,375.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,116,580	3.130	3,494,895.400	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	429,000	4.190	1,797,510.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,000	87.200	872,000.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	187,400	16.660	3,122,084.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	114,000	7.710	878,940.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	10,400	98.100	1,020,240.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	48,000	36.700	1,761,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	242,000	8.130	1,967,460.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	57,000	16.320	930,240.000	
WEICHAI POWER CO LTD-H	98,000	12.920	1,266,160.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	397,000	4.650	1,846,050.000	
SUNNY OPTICAL TECH	6,000	114.700	688,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	264,000	3.230	852,720.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	190,200	16.960	3,225,792.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	84,500	12.380	1,046,110.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	333,000	12.000	3,996,000.000	

	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	19,900	121.700	2,421,830.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	178,000	6.420	1,142,760.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	104,000	10.420	1,083,680.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	256,000	8.240	2,109,440.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	968,100	5.190	5,024,439.000	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	142,000	1.650	234,300.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	304,000	2.820	857,280.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	133,000	46.950	6,244,350.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,522,000	3.060	13,837,320.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	70,000	17.180	1,202,600.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	424,000	2.550	1,081,200.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,000	5.720	983,840.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	94,000	5.475	514,650.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	83,500	32.450	2,709,575.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 320,894,447.400 (5,519,384,495)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	26,000	129.500	3,367,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	18,000	160.500	2,889,000.000	
	TAIWAN CEMENT	147,145	40.100	5,900,514.500	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	163,000	102.000	16,626,000.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	25,000	107.500	2,687,500.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,112	64.000	4,167,168.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	113,600	106.500	12,098,400.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	92,140	82.900	7,638,406.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	41,390	81.400	3,369,146.000	
	CHINA STEEL CORP	466,686	34.000	15,867,324.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	54,616	60.900	3,326,114.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	52,000	228.500	11,882,000.000	
	YAGEO CORPORATION	14,000	377.000	5,278,000.000	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	57,000	58.000	3,306,000.000	
	ACER INC	177,000	27.350	4,840,950.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	63,000	56.400	3,553,200.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	428.500	3,428,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	106,000	79.900	8,469,400.000	
AU OPTRONICS CORP	667,000	17.000	11,339,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	97,400	124.500	12,126,300.000	
MEDIATEK INC	21,003	880.000	18,482,640.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	29,000	168.000	4,872,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,000	131.500	3,550,500.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	219,434	62.000	13,604,908.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	271,838	53.400	14,516,149.200	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	582,000	15.550	9,050,100.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	200,124	29.450	5,893,651.800	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	213,381	23.100	4,929,101.100	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	203,993	36.900	7,527,341.700	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	234,000	16.900	3,954,600.000	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,040,231	9.220	9,590,929.820	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	218,000	17.050	3,716,900.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	423,028	26.000	10,998,728.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	172,214	26.500	4,563,671.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	1,730.000	6,920,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	11,000	379.000	4,169,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	14,000	201.500	2,821,000.000	
WISTRON CORP	138,110	28.800	3,977,568.000	
INNOLUX CORP	723,000	13.600	9,832,800.000	
PEGATRON CORP	64,000	68.600	4,390,400.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	24,794	217.500	5,392,695.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	152,000	27.000	4,104,000.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	48,400	98.600	4,772,240.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	96.900	3,488,400.000	
COMPAL ELECTRONICS	174,000	22.800	3,967,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	303,000	513.000	155,439,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	288,902	111.500	32,212,573.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	14,000	263.500	3,689,000.000	
ASUSTEK COMPUTER INC	27,760	325.000	9,022,000.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	310,000	49.600	15,376,000.000	

台湾・ドル	小計			台湾・ドル	
				526,984,519.520	
				(2,397,199,881)	
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	23,782	150.230	3,572,769.860	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,113	2,050.900	2,282,651.700	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	971,870	2.530	2,458,831.100	
	OLD MUTUAL LTD	153,577	11.450	1,758,456.650	
	VODACOM GROUP LTD	15,379	133.890	2,059,094.310	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,454	209.200	3,232,976.800	
	NEDBANK GROUP LTD	16,294	213.220	3,474,206.680	
	BIDVEST GROUP LTD	8,912	210.990	1,880,342.880	
	BID CORP LTD	8,649	316.000	2,733,084.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	30,884	159.290	4,919,512.360	
	SASOL LTD	30,610	403.320	12,345,625.200	
	REMGRO LTD	13,567	131.950	1,790,165.650	
	DISCOVERY LTD	13,047	130.100	1,697,414.700	
	EXXARO RESOURCES LTD	10,192	199.530	2,033,609.760	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,667	538.050	1,434,979.350	
	SANLAM LTD	45,273	54.550	2,469,642.150	
	FIRSTRAND LTD	117,995	64.860	7,653,155.700	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	45,423	52.500	2,384,707.500	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	14,347	125.320	1,797,966.040	
	ABSA GROUP LTD	23,700	162.430	3,849,591.000	
	NASPERS LTD-N SHS	3,559	1,740.000	6,192,660.000	
	MTN GROUP LTD	51,177	140.050	7,167,338.850	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,250	169.760	1,909,800.000	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	13,742	138.970	1,909,725.740	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	13,952	253.890	3,542,273.280	
	MR PRICE GROUP LTD	8,172	188.820	1,543,037.040	
	SIBANYE STILLWATER LTD	79,807	41.270	3,293,634.890	
南アフリカ・ランド	小計			南アフリカ・ランド	
				91,387,253.190	
				(769,480,672)	
合計				17,028,113,216	
				[17,028,113,216]	



## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約 権証券	タイ・パーツ	TMBTHANACHA-CW25	31,683.000	タイ・パーツ 18,692.970	
		タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 18,692.970 (71,968)	
新株予約権証券 合計				71,968 [71,968]	
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	771,600	アメリカ・ドル 14,452,068.000	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 14,452,068.000 (1,951,173,701)	
投資証券 合計				1,951,173,701 [1,951,173,701]	
合計				1,951,245,669 [1,951,245,669]	

新株予約権証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 新株予約権 証券時価比 率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式	28銘柄	11.0%	-	89.0%
	投資証券	1銘柄			
インド・ルピー	株式	44銘柄	100%	-	10.6%
インドネシア・ルピア	株式	7銘柄	100%	-	1.4%
オフショア・人民元	株式	50銘柄	100%	-	4.5%
サウジアラビア・リアル	株式	12銘柄	100%	-	2.8%
シンガポール・ドル	株式	2銘柄	100%	-	0.1%
タイ・パーツ	株式	20銘柄	100%	0.0%	-
	新株予約権 証券	1銘柄			
チリ・ペソ	株式	7銘柄	100%	-	0.7%

トルコ・リラ	株式	12銘柄	100%	-%	-%	2.0%
ブラジル・リアル	株式	46銘柄	100%	-%	-%	13.6%
マレーシア・リングgit	株式	4銘柄	100%	-%	-%	0.4%
メキシコ・ペソ	株式	8銘柄	100%	-%	-%	2.6%
香港・ドル	株式	85銘柄	100%	-%	-%	29.1%
台湾・ドル	株式	50銘柄	100%	-%	-%	12.6%
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	100%	-%	-%	4.1%

## 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 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	67,944,514	98,374,797
親投資信託受益証券	36,560,857,918	36,804,825,787
未収入金	-	3,379,614
流動資産合計	36,628,802,432	36,906,580,198
<b>資産合計</b>		
36,628,802,432		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,389,480	36,381,084
未払受託者報酬	1,933,961	2,041,413
未払委託者報酬	24,175,021	25,518,115
その他未払費用	966,909	1,020,637
流動負債合計	31,465,371	64,961,249
<b>負債合計</b>		
31,465,371		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 36,644,197,981	<sub>1</sub> 38,196,306,569
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sub>2</sub> 46,860,920	<sub>2</sub> 1,354,687,620
（分配準備積立金）	397,268,712	314,955,207
元本等合計	36,597,337,061	36,841,618,949
<b>純資産合計</b>		
36,597,337,061		
<b>負債純資産合計</b>		
36,628,802,432		

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		316		12
有価証券売買等損益		67,706,595		1,234,719,668
営業収益合計		67,706,279		1,234,719,656
<b>営業費用</b>				
支払利息		25,268		18,182
受託者報酬		3,801,882		4,088,095
委託者報酬		47,524,469		51,102,181
その他費用		1,901,797		2,043,911
営業費用合計		53,253,416		57,252,369
営業損失( )		120,959,695		1,291,972,025
経常損失( )		120,959,695		1,291,972,025
当期純損失( )		120,959,695		1,291,972,025
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		36,318,275		55,506,276
期首剰余金又は期首欠損金( )		81,334,431		46,860,920
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,624,450
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		13,624,450
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,553,931		84,985,401
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,257,358		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		26,296,573		84,985,401
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		46,860,920		1,354,687,620

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	33,258,556,611円	36,644,197,981円
期中追加設定元本額	12,736,682,056円	10,246,997,124円
期中一部解約元本額	9,351,040,686円	8,694,888,536円
2. 計算期間末日における受益権の総数	36,644,197,981口	38,196,306,569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46,860,920円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,354,687,620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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(582,239,657円)及び分配準備積立金(397,268,712円)より分配対象額は979,508,369円(1万口当たり267.30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(706,038,113円)及び分配準備積立金(314,955,207円)より分配対象額は1,020,993,320円(1万口当たり267.30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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	50,795,169	1,203,382,293
合計	50,795,169	1,203,382,293

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.9987円	0.9645円



(1万口当たり純資産額)	(9,987円)	(9,645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	26,819,810,382	36,804,825,787	
親投資信託受益証券 合計			36,804,825,787	
合計			36,804,825,787	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	304,913,534	302,073,691

国債証券	81,001,185,060	92,613,356,150
地方債証券	3,815,467,800	3,235,573,500
特殊債券	2,888,176,200	2,139,540,000
社債券	2,683,079,000	3,011,147,700
未収利息	215,492,780	224,306,352
前払費用	3,779,003	7,247,473
流動資産合計	90,912,093,377	101,533,244,866
資産合計	90,912,093,377	101,533,244,866
負債の部		
流動負債		
未払解約金	16,874,656	38,930,233
流動負債合計	16,874,656	38,930,233
負債合計	16,874,656	38,930,233
純資産の部		
元本等		
元本	1 64,064,308,423	73,960,042,577
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,830,910,298	27,534,272,056
元本等合計	90,895,218,721	101,494,314,633
純資産合計	90,895,218,721	101,494,314,633
負債純資産合計	90,912,093,377	101,533,244,866

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	69,278,918,714円	64,064,308,423円
期中追加設定元本額	15,470,151,442円	17,973,852,132円
期中一部解約元本額	20,684,761,733円	8,078,117,978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)	59,409,262円	54,565,427円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	477,014,134円	315,564,639円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	56,254,222円	48,652,428円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	695,670,689円	613,503,159円
DCダイワ日本債券インデッ クス	9,122,815,494円	10,111,102,726円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	- 円	174,707,253円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	10,384,022,114円	9,361,547,593円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,740,356,884円	1,608,085,232円

ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	230,835,703円	206,246,835円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	324,077,667円	265,114,893円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	63,627,153円	64,583,321円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	25,768,859,542円	26,819,810,382円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	4,066,279,575円	13,587,022,794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	2,048,833,424円	2,204,813,322円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,025,561,005円	914,338,515円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,819,991,193円	6,497,025,332円
ダイワライフスタイル25	475,535,380円	437,731,133円
ダイワライフスタイル50	552,857,495円	536,978,217円
ダイワライフスタイル75	152,307,487円	138,649,376円
計	64,064,308,423円	73,960,042,577円
2. 期末日における受益権の総数	64,064,308,423口	73,960,042,577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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	303,600,170	3,528,371,060
地方債証券	10,120,400	77,752,400
特殊債券	6,333,600	58,493,700
社債券	7,647,600	64,962,000
合計	312,406,570	3,729,579,160

（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6月15日まで、及び2021年12月1日から2022年6月15日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4188円	1.3723円
（1万口当たり純資産額）	（14,188円）	（13,723円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 2 6 2年国債	390,000,000	390,425,100	
	4 2 7 2年国債	166,000,000	166,185,920	
	4 2 8 2年国債	450,000,000	450,517,500	
	4 2 9 2年国債	40,000,000	40,046,400	
	4 3 0 2年国債	303,000,000	303,354,510	
	4 3 1 2年国債	900,000,000	901,116,000	
	4 3 3 2年国債	900,000,000	901,098,000	
	4 3 4 2年国債	100,000,000	100,128,000	
	4 3 5 2年国債	100,000,000	100,134,000	
	4 3 6 2年国債	500,000,000	500,700,000	
	1 3 7 5年国債	800,000,000	801,864,000	
	1 3 8 5年国債	1,200,000,000	1,203,168,000	
	1 3 9 5年国債	950,000,000	952,840,500	
	1 4 0 5年国債	1,120,000,000	1,123,606,400	
	1 4 1 5年国債	1,210,000,000	1,214,101,900	
	1 4 2 5年国債	1,040,000,000	1,043,785,600	
	1 4 3 5年国債	800,000,000	802,976,000	
	1 4 4 5年国債	1,090,000,000	1,094,098,400	
	1 4 5 5年国債	1,250,000,000	1,254,687,500	
	1 4 6 5年国債	780,000,000	782,870,400	
	1 4 7 5年国債	1,120,000,000	1,119,787,200	
	1 4 8 5年国債	1,100,000,000	1,099,109,000	
	1 4 9 5年国債	780,000,000	778,837,800	
	1 5 0 5年国債	1,250,000,000	1,247,175,000	
	1 5 1 5年国債	1,140,000,000	1,136,477,400	
	1 4 0年国債	70,000,000	89,980,800	
	2 4 0年国債	110,000,000	136,567,200	
	3 4 0年国債	150,000,000	187,479,000	
	4 4 0年国債	180,000,000	224,730,000	
	5 4 0年国債	185,000,000	221,583,750	

6	40年国債	105,000,000	123,453,750	
7	40年国債	121,000,000	136,322,230	
8	40年国債	230,000,000	241,099,800	
9	40年国債	220,000,000	170,150,200	
10	40年国債	275,000,000	249,559,750	
11	40年国債	320,000,000	280,598,400	
12	40年国債	380,000,000	298,444,400	
13	40年国債	360,000,000	281,358,000	
14	40年国債	430,000,000	358,878,000	
15	40年国債	500,000,000	457,085,000	
330	10年国債	612,000,000	618,842,160	
331	10年国債	365,000,000	368,160,900	
332	10年国債	250,000,000	252,552,500	
333	10年国債	700,000,000	708,253,000	
334	10年国債	900,000,000	911,952,000	
335	10年国債	690,000,000	698,597,400	
336	10年国債	275,000,000	278,767,500	
337	10年国債	400,000,000	403,468,000	
338	10年国債	580,000,000	586,965,800	
339	10年国債	590,000,000	597,552,000	
340	10年国債	760,000,000	770,290,400	
341	10年国債	500,000,000	505,355,000	
342	10年国債	880,000,000	882,974,400	
343	10年国債	780,000,000	782,340,000	
344	10年国債	780,000,000	781,989,000	
345	10年国債	950,000,000	951,919,000	
346	10年国債	780,000,000	781,107,600	
347	10年国債	600,000,000	600,294,000	
348	10年国債	550,000,000	549,708,500	
349	10年国債	1,300,000,000	1,297,855,000	
350	10年国債	550,000,000	548,427,000	
351	10年国債	1,000,000,000	995,530,000	
352	10年国債	700,000,000	695,884,000	
353	10年国債	930,000,000	923,127,300	
354	10年国債	600,000,000	594,408,000	
355	10年国債	690,000,000	682,161,600	
356	10年国債	710,000,000	702,147,400	
357	10年国債	940,000,000	925,166,800	
358	10年国債	800,000,000	786,672,000	

359	10年国債	880,000,000	865,216,000	
360	10年国債	900,000,000	883,701,000	
361	10年国債	1,070,000,000	1,049,616,500	
362	10年国債	760,000,000	745,430,800	
363	10年国債	770,000,000	755,493,200	
364	10年国債	910,000,000	898,042,600	
365	10年国債	1,130,000,000	1,114,767,600	
366	10年国債	800,000,000	796,184,000	
1	30年国債	16,000,000	18,930,560	
2	30年国債	24,000,000	27,794,880	
3	30年国債	30,000,000	34,671,900	
4	30年国債	36,000,000	43,695,720	
5	30年国債	28,000,000	32,624,760	
6	30年国債	24,000,000	28,727,280	
7	30年国債	55,000,000	65,666,150	
8	30年国債	27,000,000	30,925,800	
9	30年国債	43,000,000	47,505,540	
10	30年国債	45,000,000	48,298,950	
11	30年国債	40,000,000	45,460,000	
12	30年国債	60,000,000	70,840,200	
13	30年国債	75,000,000	87,819,750	
14	30年国債	82,000,000	99,857,140	
15	30年国債	50,000,000	61,609,500	
16	30年国債	250,000,000	308,662,500	
17	30年国債	130,000,000	159,272,100	
18	30年国債	80,000,000	97,154,400	
19	30年国債	57,000,000	69,321,690	
21	30年国債	60,000,000	73,206,000	
22	30年国債	170,000,000	212,129,400	
24	30年国債	92,000,000	115,193,200	
25	30年国債	150,000,000	183,796,500	
26	30年国債	180,000,000	223,322,400	
27	30年国債	150,000,000	188,793,000	
28	30年国債	170,000,000	214,342,800	
29	30年国債	200,000,000	249,642,000	
30	30年国債	220,000,000	271,777,000	
31	30年国債	300,000,000	366,483,000	
32	30年国債	285,000,000	353,397,150	
33	30年国債	280,000,000	333,275,600	



34	30年国債	270,000,000	330,577,200
35	30年国債	250,000,000	297,835,000
36	30年国債	350,000,000	418,092,500
37	30年国債	450,000,000	528,930,000
38	30年国債	250,000,000	289,352,500
39	30年国債	230,000,000	270,399,500
40	30年国債	180,000,000	208,170,000
41	30年国債	210,000,000	238,772,100
42	30年国債	205,000,000	233,142,400
43	30年国債	260,000,000	295,497,800
44	30年国債	200,000,000	227,354,000
45	30年国債	250,000,000	274,227,500
46	30年国債	180,000,000	197,416,800
47	30年国債	370,000,000	413,071,700
48	30年国債	260,000,000	279,362,200
49	30年国債	120,000,000	128,892,000
50	30年国債	310,000,000	293,864,500
51	30年国債	270,000,000	226,816,200
52	30年国債	280,000,000	246,173,200
53	30年国債	250,000,000	224,350,000
54	30年国債	310,000,000	290,770,700
55	30年国債	260,000,000	243,269,000
56	30年国債	240,000,000	223,994,400
57	30年国債	230,000,000	214,120,800
58	30年国債	400,000,000	371,440,000
59	30年国債	300,000,000	271,338,000
60	30年国債	210,000,000	198,607,500
61	30年国債	200,000,000	179,704,000
62	30年国債	230,000,000	195,801,300
63	30年国債	300,000,000	247,755,000
64	30年国債	220,000,000	181,238,200
65	30年国債	200,000,000	164,690,000
66	30年国債	200,000,000	164,626,000
67	30年国債	260,000,000	224,702,400
68	30年国債	290,000,000	250,107,600
69	30年国債	350,000,000	309,858,500
70	30年国債	235,000,000	207,657,750
71	30年国債	260,000,000	229,309,600
72	30年国債	320,000,000	281,987,200

7 3	3 0 年国債	363,000,000	319,610,610	
7 4	3 0 年国債	259,000,000	245,754,740	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	92,258,100	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	180,232,500	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	190,250,300	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	56,907,950	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	124,796,400	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	114,203,100	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	87,110,160	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	130,687,500	
7 2	2 0 年国債	105,000,000	110,113,500	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	126,171,600	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	76,938,350	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	84,716,000	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	53,724,930	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	137,304,700	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	64,538,000	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	53,050,500	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	56,393,590	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	93,006,480	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	99,876,420	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	62,554,740	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	86,883,200	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	59,525,400	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	109,115,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	84,797,700	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	21,838,400	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	338,532,400	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	109,154,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	142,516,400	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	55,526,000	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	60,529,700	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	44,386,000	
9 8	2 0 年国債	320,000,000	353,414,400	
9 9	2 0 年国債	100,000,000	110,812,000	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	173,240,400	
1 0 1	2 0 年国債	350,000,000	395,188,500	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	191,601,900	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	11,151,600	

105	20年国債	126,000,000	140,938,560	
106	20年国債	150,000,000	168,712,500	
107	20年国債	90,000,000	100,960,200	
108	20年国債	300,000,000	332,676,000	
109	20年国債	55,000,000	61,133,050	
110	20年国債	260,000,000	292,455,800	
111	20年国債	200,000,000	226,870,000	
112	20年国債	150,000,000	169,119,000	
113	20年国債	310,000,000	351,158,700	
114	20年国債	70,000,000	79,285,500	
115	20年国債	180,000,000	205,200,000	
116	20年国債	200,000,000	228,812,000	
117	20年国債	200,000,000	227,296,000	
118	20年国債	95,000,000	107,717,650	
119	20年国債	93,000,000	103,993,530	
120	20年国債	317,000,000	349,511,520	
121	20年国債	200,000,000	225,710,000	
122	20年国債	200,000,000	224,098,000	
123	20年国債	200,000,000	229,690,000	
124	20年国債	300,000,000	342,045,000	
125	20年国債	130,000,000	151,015,800	
126	20年国債	110,000,000	125,906,000	
127	20年国債	250,000,000	284,015,000	
128	20年国債	250,000,000	284,970,000	
129	20年国債	200,000,000	226,222,000	
130	20年国債	140,000,000	159,500,600	
131	20年国債	150,000,000	169,537,500	
132	20年国債	100,000,000	113,262,000	
133	20年国債	430,000,000	491,012,700	
134	20年国債	30,000,000	34,299,000	
135	20年国債	92,000,000	104,310,520	
136	20年国債	550,000,000	618,376,000	
138	20年国債	100,000,000	111,500,000	
139	20年国債	370,000,000	416,139,000	
140	20年国債	300,000,000	340,461,000	
141	20年国債	400,000,000	454,288,000	
142	20年国債	160,000,000	183,336,000	
143	20年国債	210,000,000	236,359,200	
144	20年国債	290,000,000	323,405,100	

145	20年国債	450,000,000	511,425,000	
146	20年国債	350,000,000	397,964,000	
147	20年国債	400,000,000	450,592,000	
148	20年国債	450,000,000	501,925,500	
149	20年国債	502,000,000	560,146,660	
150	20年国債	180,000,000	198,718,200	
151	20年国債	480,000,000	518,342,400	
152	20年国債	460,000,000	496,533,200	
153	20年国債	530,000,000	578,261,800	
154	20年国債	550,000,000	593,087,000	
155	20年国債	440,000,000	462,862,400	
156	20年国債	370,000,000	359,451,300	
157	20年国債	460,000,000	433,416,600	
158	20年国債	350,000,000	342,923,000	
159	20年国債	240,000,000	237,777,600	
160	20年国債	360,000,000	360,964,800	
161	20年国債	420,000,000	414,292,200	
162	20年国債	450,000,000	442,876,500	
163	20年国債	340,000,000	333,608,000	
164	20年国債	500,000,000	482,040,000	
165	20年国債	300,000,000	288,453,000	
166	20年国債	400,000,000	395,664,000	
167	20年国債	400,000,000	382,496,000	
168	20年国債	320,000,000	300,195,200	
169	20年国債	320,000,000	294,278,400	
170	20年国債	220,000,000	201,632,200	
171	20年国債	500,000,000	456,685,000	
172	20年国債	100,000,000	92,699,000	
173	20年国債	410,000,000	378,811,300	
174	20年国債	550,000,000	506,467,500	
175	20年国債	400,000,000	373,720,000	
176	20年国債	380,000,000	353,897,800	
177	20年国債	380,000,000	346,620,800	
178	20年国債	390,000,000	361,717,200	
179	20年国債	550,000,000	509,256,000	
180	20年国債	100,000,000	97,830,000	
27	メキシコ国債	100,000,000	97,368,100	
11	フィリピン共和国	100,000,000	99,872,200	
国債証券 合計			92,613,356,150	

地方債証券	7 5 1 東京都公債	100,000,000	100,884,900	
	1 6 東京都 2 0 年	100,000,000	110,806,800	
	3 - 5 北海道公債	100,000,000	97,498,200	
	2 2 2 神奈川県公債	100,000,000	99,621,300	
	3 1 神奈川県 2 0 年	100,000,000	103,921,200	
	4 2 0 大阪府公債	200,000,000	199,693,000	
	2 6 - 1 7 兵庫県公債	100,000,000	100,988,900	
	3 兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	202,595,600	
	1 9 兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	111,006,600	
	2 6 - 1 0 静岡県公債	100,000,000	101,057,900	
	2 1 - 5 愛知県公債	100,000,000	113,072,700	
	2 9 - 5 広島県公債	100,000,000	99,955,700	
	4 埼玉県 3 0 年	100,000,000	104,170,600	
	9 埼玉県 2 0 年	100,000,000	113,253,300	
	2 9 - 1 福岡県公債	100,000,000	100,009,900	
	2 2 - 1 福岡県 1 5 年	100,000,000	105,332,100	
	1 6 千葉県 2 0 年	100,000,000	110,876,000	
	2 8 - 2 新潟県公債	100,000,000	100,010,000	
	1 2 6 共同発行地方	100,000,000	100,987,700	
	1 3 1 共同発行地方	100,000,000	101,014,100	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,138,200	
	2 7 - 1 滋賀県公債	100,000,000	101,234,300	
	2 5 - 6 大阪市公債	200,000,000	201,842,400	
	1 1 名古屋市 2 0 年	100,000,000	112,452,400	
	2 0 - 1 神戸市 2 0 年	100,000,000	112,308,700	
	4 川崎市公債 3 0 年	100,000,000	119,781,200	
	2 3 - 4 福岡市 2 0 年	100,000,000	113,747,900	
2 - 2 岡山県公債	100,000,000	97,311,900		
地方債証券 合計			3,235,573,500	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	104,353,200	
	2 4 7 道路機構	200,000,000	180,947,800	
	8 6 政保道路機構	100,000,000	111,941,100	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	109,994,600	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	100,825,700	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	202,373,800	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	185,435,800	
	2 9 8 政保道路機構	100,000,000	97,749,800	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	105,792,300	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	105,927,400	

	5 1 地方公共団体	100,000,000	100,977,700	
	3 1 地方公共団体 2 0	100,000,000	112,677,700	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,090,300	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	101,058,400	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,551,000	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	106,000,900	
	1 2 3 住宅支援機構	100,000,000	113,370,900	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,471,600	
特殊債券 合計			2,139,540,000	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,644,300	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	101,495,000	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	101,045,900	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	99,909,200	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	101,389,900	
	5 野村不動産HD	100,000,000	101,879,100	
	2 3 森ビル	100,000,000	95,962,300	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	99,846,700	
	2 0 ZHD	100,000,000	98,102,800	
	1 8 楽天グループ	100,000,000	96,399,400	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,540,800	
	1 5 デンソー	100,000,000	99,580,200	
	6 楽天カード	100,000,000	98,264,200	
	1 日生2021基金	100,000,000	99,363,600	
	7 凸版印刷	100,000,000	103,826,200	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	100,901,100	
	1 6 NTTファイナンス	100,000,000	99,707,600	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	99,623,700	
	1 7 5 オリックス	100,000,000	101,319,400	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,291,600	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	103,896,100	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	104,109,800	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	110,908,200	
	1 5 ソフトバンク	100,000,000	97,689,300	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	99,804,700	
	4 8 2 九州電力	100,000,000	99,920,200	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	97,937,900	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	100,016,100	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	96,986,800	
	4 ファーストリテイリング	100,000,000	101,785,600	

社債券 合計		3,011,147,700	
合計		100,999,617,350	

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 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	520,149,779	552,806,888
親投資信託受益証券	98,120,406,888	97,222,728,050
未収入金	-	19,061,932
流動資産合計	98,640,556,667	97,794,596,870
資産合計	98,640,556,667	97,794,596,870
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,857,251	57,641,186
未払受託者報酬	10,352,968	11,465,229
未払委託者報酬	186,354,286	206,374,869
その他未払費用	1,109,428	1,112,301
流動負債合計	230,673,933	276,593,585
負債合計	230,673,933	276,593,585
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 96,502,550,747	<sup>1</sup> 110,985,788,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 1,907,331,987	<sup>2</sup> 13,467,784,787
（分配準備積立金）	4,583,852,279	3,855,821,932
元本等合計	98,409,882,734	97,518,003,285
純資産合計	98,409,882,734	97,518,003,285
負債純資産合計	98,640,556,667	97,794,596,870

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		512		52
有価証券売買等損益		1,907,275,683		15,000,440,171
<b>営業収益合計</b>		<b>1,907,275,171</b>		<b>15,000,440,119</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		96,032		121,962
受託者報酬		20,328,859		22,902,954
委託者報酬		365,921,063		412,254,910
その他費用		2,200,807		2,197,210
<b>営業費用合計</b>		<b>388,546,761</b>		<b>437,477,036</b>
<b>営業損失（ ）</b>		<b>2,295,821,932</b>		<b>15,437,917,155</b>
経常損失（ ）		2,295,821,932		15,437,917,155
<b>当期純損失（ ）</b>		<b>2,295,821,932</b>		<b>15,437,917,155</b>
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		70,718,013		483,613,656
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>3,782,818,302</b>		<b>1,907,331,987</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,233,842,598		-
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>1,233,842,598</b>		<b>-</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		884,224,994		420,813,275
<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>884,224,994</b>		<b>348,902,488</b>
<b>当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>-</b>		<b>71,910,787</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>1,907,331,987</b>		<b>13,467,784,787</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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	83,945,786,338円	96,502,550,747円
期中追加設定元本額	31,995,491,437円	32,610,525,682円
期中一部解約元本額	19,438,727,028円	18,127,288,357円
2. 計算期間末日における受益権の総数	96,502,550,747口	110,985,788,072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13,467,784,787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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,703,148,135円)及び分配準備積立金(4,583,852,279円)より分配対象額は8,287,000,414円(1万口当たり858.73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(5,674,879,117円)及び分配準備積立金(3,855,821,932円)より分配対象額は9,530,701,049円(1万口当たり858.73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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,912,936,443	14,779,310,489
合計	1,912,936,443	14,779,310,489

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0198円 (10,198円)	0.8787円 (8,787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	108,109,338,430	97,222,728,050	
親投資信託受益証券 合計			97,222,728,050	
合計			97,222,728,050	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金		585,273,779	508,189,860
コール・ローン		749,846,397	516,355,179
国債証券		116,454,613,580	122,375,149,528
派生商品評価勘定		134,796,464	4,087,089
未収利息		691,495,343	810,738,948
前払費用		29,810,030	30,000,154
差入委託証拠金		237,113,427	251,030,114
流動資産合計		118,882,949,020	124,495,550,872
資産合計		118,882,949,020	124,495,550,872
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		374,559,238	4,353,912,676
未払金		568,829,600	1,785,041
未払解約金		21,672,582	19,061,932
流動負債合計		965,061,420	4,374,759,649
負債合計		965,061,420	4,374,759,649
純資産の部			
元本等			
元本	1	113,403,229,819	133,574,429,591
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	4,514,657,781	13,453,638,368
元本等合計		117,917,887,600	120,120,791,223
純資産合計		117,917,887,600	120,120,791,223
負債純資産合計		118,882,949,020	124,495,550,872

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首 期首元本額	2020年6月16日 107,167,679,077円	2021年6月16日 113,403,229,819円



期中追加設定元本額	34,627,106,696円	33,395,160,755円
期中一部解約元本額	28,391,555,954円	13,223,960,983円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	94,364,692,141円	108,109,338,430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)	4,709,710,877円	4,161,900,030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)	- 円	1,564,129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)	3,199,296,043円	3,239,349,686円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	7,844,177,230円	18,062,277,316円
計	113,403,229,819円	133,574,429,591円
2. 期末日における受益権の総数	113,403,229,819口	133,574,429,591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13,453,638,368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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してしております。</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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	4,298,639,986	21,108,565,524
合計	4,298,639,986	21,108,565,524

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年6月16日から2021年6月15日まで、及び2021年6月16日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買 建	-	-	-	-	285,387,931	-	280,388,348	4,999,583
合計	-	-	-	-	285,387,931	-	280,388,348	4,999,583

### (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6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売 建	116,938,071,741	-	117,178,715,915	240,644,174	125,705,971,494	-	130,050,797,498	4,344,826,004
アメリカ・ドル	51,747,944,458	-	52,088,205,785	340,261,327	62,486,482,287	-	65,593,509,200	3,107,026,913
イギリス・ポンド	7,719,962,066	-	7,714,590,918	5,371,148	6,668,473,595	-	6,674,090,820	5,617,225
イスラエル・ シケル	498,198,315	-	502,113,444	3,915,129	499,134,353	-	503,544,291	4,409,938
オーストラリア・ ドル	2,491,004,803	-	2,497,789,516	6,784,713	1,991,754,084	-	2,009,245,224	17,491,140
オフショア・ 人民元	-	-	-	-	2,511,215,504	-	2,611,465,402	100,249,898
カナダ・ドル	2,399,964,713	-	2,403,422,009	3,457,296	2,587,204,274	-	2,651,819,030	64,614,756
シンガポール・ ドル	544,529,471	-	545,715,484	1,186,013	591,989,018	-	611,881,241	19,892,223
スウェーデン・ クローナ	433,970,644	-	434,658,191	687,547	345,879,122	-	348,455,165	2,576,043
デンマーク・ クローネ	591,353,762	-	590,124,200	1,229,562	529,967,949	-	541,416,930	11,448,981
ノルウェー・ クローネ	219,958,872	-	221,197,040	1,238,168	288,564,147	-	284,477,058	4,087,089
ポーランド・ ズロチ	746,507,359	-	736,314,451	10,192,908	587,238,162	-	588,348,105	1,109,943
マレーシア・ リングギット	520,856,000	-	531,630,960	10,774,960	671,860,800	-	710,242,536	38,381,736
メキシコ・ペソ	891,123,406	-	896,401,917	5,278,511	1,048,434,526	-	1,057,297,731	8,863,205
ユーロ	48,132,697,872	-	48,016,552,000	116,145,872	44,897,773,673	-	45,865,004,765	967,231,092
買 建	172,604,900	-	173,486,300	881,400	-	-	-	-
ユーロ	172,604,900	-	173,486,300	881,400	-	-	-	-
合計	117,110,676,641	-	117,352,202,215	239,762,774	125,705,971,494	-	130,050,797,498	4,344,826,004

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1,0398円	0.8993円
(1万口当たり純資産額)	(10,398円)	(8,993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	2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	13,310,000.000	13,205,915.800	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	27,905,000.000	27,704,363.050	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	15,000,000.000	14,848,800.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	16,580,000.000	16,300,129.600	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,300,000.000	3,421,407.000	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	8,950,000.000	10,032,323.500	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,050,612.000	

6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,661,940.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	716,870.700	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	354,327.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	428,047.800	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,555,399.200	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,581,875.600	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	2,611,725.800	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	602,856.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	614,195.700	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,287,885.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	4,500,000.000	3,921,660.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,080,750.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	2,536,152.480	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	982,260.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,200,000.000	2,076,580.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	2,940,000.000	2,662,287.600	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	12,810,000.000	12,432,617.400	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	1,100,000.000	889,361.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	15,300,000.000	14,681,880.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	327,738.600	

2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	14,107,306.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	19,800,000.000	18,930,582.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,400,000.000	1,242,276.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	11,179,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,358,157.050	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	864,688.400	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	11,750,000.000	10,772,282.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	383,435.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	12,000,000.000	11,718,720.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	14,850,000.000	13,854,456.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,330,000.000	2,026,004.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,670,000.000	4,393,442.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	803,178.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	8,050,000.000	7,595,899.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	847,124.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	13,094,340.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	14,700,000.000	14,301,924.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,810,000.000	2,395,721.700	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	6,759,900.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	15,800,000.000	15,378,456.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,435,725.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	4,150,170.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	7,300,000.000	7,013,694.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	12,000,000.000	11,520,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,350,810.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	9,300,000.000	9,047,133.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,793,482.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	13,000,000.000	12,270,700.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	2,902,240.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	1,772,800.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,800,000.000	3,522,714.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	7,000,000.000	6,545,490.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	1,633,569.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	4,783,590.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,300,000.000	1,041,417.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,894,570.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	1,832,500.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	2,035,478.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	11,300,000.000	7,488,849.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	6,300,000.000	5,016,816.000	



1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	3,700,000.000	2,292,520.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	4,900,000.000	3,971,450.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	2,520,160.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	3,832,380.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	5,300,000.000	4,528,161.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	2,903,128.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,041,912.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	1,800,552.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	4,825,370.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,946,110.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	4,400,000.000	3,512,916.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,275,616.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	5,700,000.000	4,704,495.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,845,440.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,750,000.000	4,177,720.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	6,700,000.000	5,570,380.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	3,500,000.000	2,476,775.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,517,960.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	3,800,000.000	3,300,186.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,000,000.000	777,960.000	

	2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	810,230.000	
	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	2,400,000.000	2,278,680.000	
	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	800,000.000	717,120.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 460,256,503.680 (62,139,230,562)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,342,575.000	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	806,735.700	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,875,000.000	1,825,218.750	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,150,000.000	893,055.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	717,910.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	721,926.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	620,041.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	770,392.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	394,016.040	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,500,000.000	1,470,405.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000	654,304.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	660,569.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	720,440.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,200,000.000	929,748.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	338,696.000	

0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	422,254.500	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	220,079.700	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,450,000.000	1,114,832.500	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,200,000.000	979,164.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	338,420.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	200,000.000	142,016.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	100,000.000	75,607.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	200,000.000	123,578.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,175,957.820	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,600,000.000	1,838,080.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,367,743.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	1,075,756.350	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	697,207.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,152,685.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	974,627.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,300,000.000	1,431,209.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,157,225.080	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,069,842.670	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	701,653.740	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,363,684.000	

	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	356,919.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	709,194.440	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,214,400.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	855,652.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	675,000.000	728,122.500	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,390,000.000	1,392,071.100	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	638,900.000	809,920.750	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,000,000.000	1,012,330.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	740,000.000	831,071.800	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 38,197,337.940 (6,195,990,187)	
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	1,507,152.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	1,650,000.000	1,683,825.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	481,980.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,815,240.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,194,228.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,449,199.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	765,420.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 10,897,044.000 (424,355,957)	

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	931,805.350	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,156,000.000	1,149,329.880	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	308,659.200	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,800,000.000	1,790,406.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	375,496.050	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,453,154.000	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	697,725.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	695,488.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	611,126.640	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,238,094.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	605,044.160	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	575,000.000	470,781.250	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,174,675.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	1,901,445.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	416,149.800	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,468,062.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,350,000.000	1,832,060.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,300,000.000	1,816,655.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	538,182.000	

オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 20,474,338.830 (1,906,160,945)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,711,380.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	3,000,000.000	3,110,820.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	2,800,000.000	2,862,132.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	14,000,000.000	14,204,120.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	3,000,000.000	2,969,100.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	19,000,000.000	19,193,990.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	4,000,000.000	4,072,360.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	8,500,000.000	8,780,160.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	4,000,000.000	4,136,400.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	3,000,000.000	3,255,390.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	1,600,000.000	1,713,104.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	1,800,000.000	1,823,814.000	
	2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,094,570.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	10,000,000.000	10,075,800.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,826,300.000	
	4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	3,400,000.000	3,841,082.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	1,800,000.000	1,966,968.000		
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	10,000,000.000	10,419,800.000		

	3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	1,100,000.000	1,113,134.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,532,235.000	
	3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	3,429,822.000	
	2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,323,638.000	
	2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	1,400,000.000	1,398,922.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 127,855,041.000 (2,558,941,933)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 860,000.000	カナダ・ドル 736,512.600	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,025,590.250	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,249,006.500	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	349,698.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	660,610.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	140,334.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	4,038,000.000	3,971,211.480	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	730,000.000	717,210.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	700,000.000	617,379.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,442,032.920	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,777,881.600	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	822,650.100	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	549,426.000	

2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,126,958.400	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	275,106.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	981,060.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,342,404.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,421,659.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	818,415.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,700,000.000	1,313,454.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,676,220.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	750,000.000	514,260.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	700,000.000	582,386.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 24,111,465.850 (2,512,414,742)	
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	206,572.800	
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	150,645.000	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	588,600.000	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	223,983.630	
2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	700,000.000	701,757.000	
3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	427,140.000	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	494,000.000	
2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	394,400.000	



	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	308,055.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	193,820.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	231,545.600	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	782,800.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	500,000.000	494,920.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	268,200.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	274,050.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	134,750.500	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 5,875,239.530 (569,604,472)	
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	3,045,924.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,142,530.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,820,000.000	3,874,473.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,576,563.200	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,373,565.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	513,400.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,750,880.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,409,000.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 24,686,335.900 (327,093,951)	

デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 6,740,000.000	デンマーク・クローネ 9,008,347.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	670,000.000	674,971.400	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,830,000.000	2,840,669.100	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	2,975,008.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	4,226,240.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,408,536.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,651,020.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	3,000,000.000	2,895,660.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 25,680,451.500 (486,130,947)	
ノルウェー・クローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	ノルウェー・クローネ 6,300,000.000	ノルウェー・クローネ 6,329,925.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	145,015.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,352,265.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,826,240.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	3,763,560.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,822,700.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,187,100.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,698,220.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 20,125,025.700	

			(271,486,597)	
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	2,152,788.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,410,708.750	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,900,000.000	2,653,152.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	1,675,090.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	2,000,000.000	1,779,000.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,106,730.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	655,335.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	700,000.000	418,285.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	543,870.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	682,317.100	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,384,056.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	4,230,000.000	3,712,544.100		
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 18,173,875.950 (546,920,988)		
マレーシア・リ ンギット		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	1,773,147.200	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	985,680.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,937,091.000	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,315,118.000		

	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,460,340.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,157,210.500	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	478,080.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,600,000.000	1,616,224.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,361,041.600	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,700,000.000	2,729,754.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	493,900.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	997,510.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,498,965.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,164,732.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,187,576.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,400,000.000	1,216,530.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,197,308.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 22,570,207.300 (689,224,163)	
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	21,337,624.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	10,025,734.500	
	8% Mexican Bonos 20240905	27,900,000.000	27,048,771.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,594,820.400	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	6,399,532.600	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,263,712.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,922,920.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,241,300.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,685,600.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	20,701,038.000	

	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	12,082,719.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,195,222.000	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 146,498,993.500 (961,839,142)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	168,883.400	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	782,056.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	172,094.400	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	219,985.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	186,568.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	131,139.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	456,660.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	269,004.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	257,299.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	101,995.500	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	104,684.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	165,536.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	371,192.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	540,000.000	534,070.800	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	469,924.700	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	225,784.800	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	186,188.800	

0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	940,410.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	150,000.000	121,531.500	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	562,368.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	632,730.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	382,275.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	393,492.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	40,689.000	
Austria Government Bond 20310220	500,000.000	412,610.000	
Austria Government Bond 20250420	400,000.000	383,696.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	147,222.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	74,586.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	177,258.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,170,000.000	1,143,616.500	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	269,703.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	419,004.800	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	578,756.500	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	614,000.000	484,838.960	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	470,000.000	390,447.800	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	396,492.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	694,011.000	

0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	490,160.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	272,124.200	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	344,596.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	880,000.000	823,900.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	448,850.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,100,000.000	1,018,138.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	276,850.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	400,000.000	340,040.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	406,806.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	271,653.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,800,000.000	1,453,824.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	270,000.000	116,472.600	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	200,000.000	163,506.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	300,000.000	212,412.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	564,286.450	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	973,472.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	947,232.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	2,096,000.000	2,785,458.240	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,170,101.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	4,340,598.000	

4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,090,000.000	1,394,644.100	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,378,927.800	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	2,613,712.400	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	814,056.640	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,240,399.620	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	760,000.000	772,182.800	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	4,300,000.000	4,356,158.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,575,000.000	1,801,878.750	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,990,000.000	2,005,243.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	1,991,080.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,165,712.100	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,800,000.000	3,758,732.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	1,883,000.000	1,822,442.720	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	3,850,000.000	3,625,814.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,550,000.000	1,464,440.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	2,939,296.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,460,000.000	1,298,509.400	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	989,425.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,800,000.000	1,659,672.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,648,656.000	



GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	967,536.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	618,674.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	237,942.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,600,000.000	1,401,296.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,100,000.000	954,899.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	155,552.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	243,032.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,300,000.000	1,115,998.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	600,000.000	348,108.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	991,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	490,820.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,415,000.000	3,906,657.550	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,418,298.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,520,195.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	1,565,342.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,516,988.000	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,255,284.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	2,739,139.740	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,291,660.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,640,000.000	3,886,355.200	

2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,910,000.000	4,082,626.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,481,638.000	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,500,000.000	3,567,550.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,986,000.000	2,048,300.820	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,360,000.000	3,387,921.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	4,400,000.000	4,269,848.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,250,000.000	2,124,157.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,240,676.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,150,000.000	1,837,755.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,100,000.000	832,623.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,070,000.000	1,933,524.900	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,800,000.000	1,614,510.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,343,580.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,800,000.000	1,586,916.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	2,500,000.000	2,333,325.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,580,184.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,543,117.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,200,000.000	2,157,056.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,650,000.000	1,279,822.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,400,000.000	3,065,950.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,400,000.000	2,057,784.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,100,000.000	666,787.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,300,000.000	910,312.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	2,497,680.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	200,000.000	80,816.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,200,000.000	1,780,152.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	900,000.000	825,615.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	300,000.000	177,405.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	600,000.000	476,904.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	694,097.600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,400,000.000	1,724,940.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	980,000.000	1,224,186.600	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	890,000.000	925,003.700	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	758,077.500	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	1,026,061.400	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	980,000.000	994,631.400	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	664,683.900	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,596,536.700	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,470,000.000	1,399,689.900	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	393,344.000	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	845,271.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	624,498.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	189,000.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	642,660.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	800,000.000	433,856.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	900,000.000	754,110.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	265,044.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,700,000.000	3,153,384.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,310,595.850	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	3,100,000.000	3,087,972.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	780,933.550	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	884,276.400	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,218,315.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	870,039.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,400,000.000	1,087,310.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,250,000.000	996,600.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	3,700,000.000	3,650,827.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	1,000,000.000	727,680.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,448,060.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,611,770.000	

3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	840,294.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,451,838.500	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	600,292.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,500,000.000	2,317,100.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,400,000.000	1,337,532.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,279,044.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	644,518.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	470,085.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,100,000.000	1,051,358.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,341,690.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	417,320.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	150,000.000	106,768.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	360,405.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,591,080.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	502,290.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	600,000.000	415,050.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	773,990.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	100,000.000	58,777.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	130,324.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,600,000.000	1,186,416.000	

1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	200,000.000	122,916.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	268,978.500	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	404,865.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	500,000.000	321,575.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	354,868.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,540,000.000	1,698,512.200	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,719,711.360	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,482,702.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,786,752.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,250,670.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,252,278.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	1,870,000.000	1,937,993.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,900,000.000	3,071,361.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,714,000.000	1,883,326.060	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	4,250,000.000	4,465,645.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,215,740.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,025,000.000	1,106,672.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,830,000.000	2,946,058.300	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,166,611.300	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,349,751.400	

5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,201,000.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	956,467.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,180,648.550	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	773,976.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	344,316.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	500,000.000	507,860.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	457,629.900	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	821,400.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	316,704.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	761,320.160	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	300,000.000	311,919.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	697,244.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	410,000.000	366,146.400	
1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	507,769.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	515,194.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	752,368.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	133,689.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	1,026,674.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	282,459.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	300,000.000	230,334.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	161,320.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	139,272.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	463,436.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	800,000.000	972,168.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	784,833.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	223,852.600	

3.15% Austria Government Bond 20440620	630,000.000	714,892.500	
1.75% Austria Government Bond 20231020	280,000.000	283,273.200	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	634,076.100	
1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	888,140.000	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	215,022.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	125,673.600	
2.625% Finland Government Bond 20420704	460,000.000	470,115.400	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	355,624.500	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,714,990.800	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	3,100,000.000	3,064,040.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	854,408.100	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,565,000.000	2,566,744.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,382,458.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	989,000.000	909,425.060	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,480,000.000	1,387,115.200	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,049,000.000	1,961,487.210	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,008,335.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,227,903.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,107,264.600	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,650,000.000	1,545,769.500	



2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	745,016.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	740,248.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,400,000.000	1,195,264.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	774,873.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	842,080.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	56,039.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,589,598.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	950,000.000	668,049.500	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	626,424.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	99,416.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	866,760.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	500,000.000	353,470.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	900,000.000	719,082.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	801,080.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	844,512.400	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	1,003,896.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	977,880.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,043,000.000	1,248,210.250	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,141,370.000	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	2,188,000.000	2,281,077.520	

	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,700,000.000	1,950,495.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,090,000.000	1,400,562.800	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	3,700,000.000	3,849,554.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,084,000.000	1,108,184.040	
	ユーロ 小計		ユーロ 303,876,100.440 (42,785,754,942)	
国債証券 合計			122,375,149,528 [122,375,149,528]	
合計			122,375,149,528 [122,375,149,528]	

- (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 90銘柄	100%	50.6%
イギリス・ポンド	国債証券 44銘柄	100%	5.1%
イスラエル・シェケル	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 23銘柄	100%	2.1%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
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%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.4%
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%	0.8%
ユーロ	国債証券 267銘柄	100%	35.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

### 【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

## (1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,249,021	38,924,876
親投資信託受益証券	6,631,853,812	7,597,619,489
流動資産合計	6,666,102,833	7,636,544,365
資産合計	6,666,102,833	7,636,544,365
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,868,031	-
未払受託者報酬	662,881	810,626
未払委託者報酬	11,932,630	14,591,973
その他未払費用	248,504	303,907
流動負債合計	14,712,046	15,706,506
負債合計	14,712,046	15,706,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 5,457,959,297	1 6,337,300,973
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,193,431,490	1,283,536,886
（分配準備積立金）	491,465,048	399,858,245
元本等合計	6,651,390,787	7,620,837,859
純資産合計	6,651,390,787	7,620,837,859
負債純資産合計	6,666,102,833	7,636,544,365

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
営業収益				
受取利息		22		3
有価証券売買等損益		325,176,479		66,393,444
営業収益合計		325,176,501		66,393,441
営業費用				
支払利息		5,035		7,505
受託者報酬		1,248,425		1,580,397
委託者報酬		22,473,183		28,448,512
その他費用		468,173		592,489
営業費用合計		24,194,816		30,628,903
営業利益又は営業損失（ ）		300,981,685		97,022,344
経常利益又は経常損失（ ）		300,981,685		97,022,344
当期純利益又は当期純損失（ ）		300,981,685		97,022,344
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（ ）		17,146,667		3,241,078
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		674,859,354		1,193,431,490
剰余金増加額又は欠損金減少額		361,453,509		450,727,556
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		361,453,509		450,727,556
剰余金減少額又は欠損金増加額		126,716,391		266,840,894
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		126,716,391		266,840,894
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,193,431,490		1,283,536,886

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	4,275,100,523円	5,457,959,297円
期中追加設定元本額	1,968,605,898円	2,102,589,183円
期中一部解約元本額	785,747,124円	1,223,247,507円
2. 計算期間末日における受益権の総数	5,457,959,297口	6,337,300,973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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(283,836,013円)、投資信託約款に規定される収益調整金(701,971,101円)及び分配準備積立金(207,629,035円)より分配対象額は1,193,436,149円(1万口当たり2,186.60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(883,689,097円)及び分配準備積立金(399,858,245円)より分配対象額は1,283,547,342円(1万口当たり2,025.38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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。



## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	314,855,184	66,796,077
合計	314,855,184	66,796,077

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.2187円	1.2025円

(1万口当たり純資産額)	(12,187円)	(12,025円)
--------------	-----------	-----------

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	2,451,240,358	7,597,619,489	
親投資信託受益証券 合計			7,597,619,489	
合計			7,597,619,489	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	495,178,014	864,834,913

コール・ローン		727,158,621	1,002,891,357
国債証券		223,326,922,595	230,597,354,794
派生商品評価勘定		705,830	35,378,522
未収入金		160,203	17,496,576
未収利息		1,188,153,611	1,328,578,121
前払費用		28,576,492	51,803,807
流動資産合計		225,766,855,366	233,898,338,090
資産合計		225,766,855,366	233,898,338,090
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,289,310	3,072
未払金		867,453	-
未払解約金		97,105,815	167,384,604
流動負債合計		99,262,578	167,387,676
負債合計		99,262,578	167,387,676
純資産の部			
元本等			
元本	1	72,148,022,911	75,409,227,916
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		153,519,569,877	158,321,722,498
元本等合計		225,667,592,788	233,730,950,414
純資産合計		225,667,592,788	233,730,950,414
負債純資産合計		225,766,855,366	233,898,338,090

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	65,627,347,601円	72,148,022,911円
期中追加設定元本額	14,118,327,282円	9,369,636,335円
期中一部解約元本額	7,597,651,972円	6,108,431,330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	520,301,299円	467,936,815円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	10,818,215円	9,719,452円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	93,079,264円	60,072,843円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	26,042,029円	21,864,771円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	319,990,353円	266,252,598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)	149,602,778円	262,983,175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)	498,273,800円	590,145,683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)	2,120,293,437円	2,451,240,358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)	806,617,119円	642,323,368円
D-I's 外国債券インデッ クス	956,364円	955,173円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,755,226円	11,074,320円
iFree 外国債券イン デックス	1,267,378,990円	1,955,184,846円
iFree 8資産バランス	1,236,583,986円	1,638,369,400円
iFree 年金バランス	154,784,016円	286,017,356円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,189,194,680円	49,808,996,532円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	888,919,026円	1,014,640,444円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	529,456,334円	638,800,912円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	334,179,542円	416,763,408円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	533,645,825円	613,972,044円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	401,196,099円	476,490,455円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	144,040,694円	180,112,794円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	24,114,337円	31,665,502円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,629,219円	12,404,666円
ダイワつみたてインデックス外国債券	319,659,293円	1,097,389,560円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,234,798円	3,775,192円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,161,957円	1,373,889円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,283,180円	2,283,447円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	-円	13,190,068円
ダイワ世界バランスファンド40VA	171,725,827円	126,843,591円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,407,366円	102,203,653円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,143,757,488円	3,551,269,117円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	245,616,231円	216,527,536円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,867,150円	147,565,497円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	36,827,523円	45,857,095円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,775,786,514円	2,543,603,718円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,792,216,256円	5,594,994,510円
ダイワライフスタイル25	33,312,755円	29,519,607円
ダイワライフスタイル50	63,756,331円	59,493,589円

ダイワライフスタイル75	17,557,610円	15,350,932円
計	72,148,022,911円	75,409,227,916円
2. 期末日における受益権の総数	72,148,022,911口	75,409,227,916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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	9,068,971,566	38,401,363,090
合計	9,068,971,566	38,401,363,090

(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6月15日まで、及び2021年12月1日から2022年6月15日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	776,940,680	-	776,357,200	583,480	959,572,179	-	994,947,629	35,375,450
アメリカ・ドル	287,813,070	-	288,428,722	615,652	492,309,221	-	515,256,882	22,947,661
イギリス・ポンド	10,565,595	-	10,564,976	619	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	20,163,888	-	20,120,991	42,897	-	-	-	-
オフショア・人民元	-	-	-	-	171,335,360	-	178,175,216	6,839,856
スウェーデン・クローナ	22,289,608	-	22,200,024	89,584	-	-	-	-



デンマーク・ クローネ	6,502,158	-	6,479,950	22,208	-	-	-	-
ユーロ	429,606,361	-	428,562,537	1,043,824	295,927,598	-	301,515,531	5,587,933
合計	776,940,680	-	776,357,200	583,480	959,572,179	-	994,947,629	35,375,450

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.1278円	3.0995円
(1万口当たり純資産額)	(31,278円)	(30,995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	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,532,278.240	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,984,899.010	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,176,291.680	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,829,085.440	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	678,060.660	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	924,195.150	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	794,739.370	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	807,932.880	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	847,589.400	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,720,694.990	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,324,834.560	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,000,383.230	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	607,595.000	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	583,506.510	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,044,237.540	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,222,058.150	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,189,426.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,334,775.200	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,149,420.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,847,360.540	

3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,123,217.230	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,583,993.320	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,442,777.160	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,493,924.250	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,524,220.920	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,331,274.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,487,820.330	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,212,937.440	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	1,915,514.290	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,395,296.300	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,389,029.760	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,002,661.040	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,157,755.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,084,412.840	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,248,333.820	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,140,355.300	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,021,876.120	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,746,786.660	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,746,567.340	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,430,841.580	

2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,515,290.050	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,072,211.130	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,554,164.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	2,511,186.300	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,466,819.130	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,623,497.670	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,583,565.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	584,757.060	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,533,360.240	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,543,961.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,158,367.930	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,281,322.760	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,465,225.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,945,970.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,950,666.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,131,898.600	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,721,675.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,349,552.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,446,282.800	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,944,688.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,444,225.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	869,530.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,448,466.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,459,550.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,424,439.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,436,773.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	2,092,724.900	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,252,643.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,449,399.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,038,976.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,783,420.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,923,800.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,157,960.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,333,040.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,518,329.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,918,760.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	2,515,081.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,931,400.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,426,350.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,130,895.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,134,550.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,398,815.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,094,976.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,711,380.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,075,616.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,530,632.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,642,193.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,695,290.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,825,441.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,504,588.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,245,070.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,861,696.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,479,816.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,491,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,486,800.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,927,790.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	3,832,097.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,432,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	3,800,278.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,447,350.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,578,328.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,507,156.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,452,050.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	2,986,860.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,451,750.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	3,978,400.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,599,397.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	4,381,914.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,927,340.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,988,900.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,386,250.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,473,025.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,229,740.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,945,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,415,425.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	4,262,665.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,402,925.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,245,847.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,378,900.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	4,121,760.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,615,417.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,426,290.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,675,736.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,834,520.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,383,765.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,618,196.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,308,765.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,333,975.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,133,415.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,578,294.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,555,868.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,811,840.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,303,700.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,867,340.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	953,980.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,757,180.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,182,222.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,604,905.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,836,860.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,856,780.000	



1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,306,050.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,391,400.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,607,554.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,327,300.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,917,990.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,958,200.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	268,005.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,875,156.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,377,480.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,390,864.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,451,628.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,464,155.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,068,104.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,352,552.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,313,650.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,006,150.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,719,920.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,345,725.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,875,350.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	2,998,765.000	

0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	967,960.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,063,978.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,311,350.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	7,963,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,246,850.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	4,151,320.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	3,946,380.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	2,982,350.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,925,300.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	5,823,545.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,375,600.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,144,925.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,029,690.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,376,292.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,942,900.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,573,400.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,394,040.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,509,760.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,497,070.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,566,489.000	

0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,258,200.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,859,600.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,250,350.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	892,730.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,801,840.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	5,980,590.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	4,177,672.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,826,216.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,739,450.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,452,300.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,365,200.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,526,081.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,677,020.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,894,280.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,509,360.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,595,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,838,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,463,295.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,801,752.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,034,160.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,249,040.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	5,109,696.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,029,588.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	972,140.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,491,240.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,935,228.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,877,260.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,453,815.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,356,600.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,484,750.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,162,465.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,806,380.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,501,105.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	5,034,240.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,688,272.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,415,025.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,315,100.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,281,600.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,892,180.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,305,850.000	

0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,442,150.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	6,995,475.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,070,820.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,120,740.000	
0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,442,985.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,871,860.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	2,000,000.000	1,871,700.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,482,600.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	5,600,000.000	3,962,840.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	3,035,920.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,843,720.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,240,100.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	4,000,000.000	3,598,120.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,612,160.000	
0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,800,350.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,923,576.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,066,790.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,402,050.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,489,680.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,606,560.000	

1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	940,150.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,881,980.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,400,000.000	6,426,678.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,503,863.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,836,374.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	3,034,044.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,500,000.000	1,215,345.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,498,000.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,876,240.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	925,620.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,762,500.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,781,420.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,758,950.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,959,440.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,948,280.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	3,000,000.000	2,848,350.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,930,250.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,000,000.000	1,792,800.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,402,260.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,424,760.000	

	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,870,610.000	
	2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,886,210.000	
	2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,420,980.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 872,910,372.380 (117,851,629,375)	
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	915,934.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,582,000.000	1,575,624.540	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,426,104.250	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,366,763.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,269,475.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,451,873.400	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,345,013.100	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,300,000.000	2,268,789.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,444,485.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	792,604.800	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,764,486.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	989,634.800	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	660,569.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	720,440.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,818,566.000	

1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	922,000.100	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	1,947,502.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,000,000.000	496,770.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,394,955.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,419,424.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	654,291.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,307,045.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,258,621.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,060,761.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	338,420.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	461,050.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	213,024.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	94,748.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	469,494.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	618,422.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	249,768.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	226,821.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	100,000.000	86,613.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	420,000.000	259,513.800	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,158,861.860	



4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,573,312.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,579,073.280	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	1,953,996.780	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,720,201.050	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,316,218.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,729,014.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,356,345.760	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,687,912.480	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,886,224.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,735,397.740	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,745,032.800	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,855,978.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,579,875.280	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,915,108.800	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,897,102.720	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	2,012,854.200	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,584,357.180	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,757,004.480	
2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,105,464.360	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,936,172.680	
イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド	

			71,375,115.040 (11,577,757,411)	
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	2,033,946.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,009,536.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,041,000.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,217,108.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,716,858.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,388,456.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,713,960.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,489,680.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,045,928.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,495,952.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,301,214.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	1,961,080.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,294.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	849,564.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	251,211.000	
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 23,697,787.000 (922,846,331)	
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	2,084,770.350	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,693.790	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,306,014.240	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,788,416.660	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,315,805.100	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,788,204.000	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,071,128.940	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,136,253.520	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	707,620.320	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,592,379.360	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,083,194.560	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,025,075.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,691,532.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,762,383.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,598,641.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,134,212.200	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,316,275.600	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,325,320.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,232,192.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,500,000.000	1,974,625.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	837,172.000	

	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,429,616.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,924,225.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,051,764.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	892,540.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,181,648.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 37,820,702.140 (3,521,107,369)	
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	5,336,396.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,162,600.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,184,700.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,141,350.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,281,400.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,000,000.000	5,110,950.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	6,000,000.000	6,062,820.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,433,050.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	27,000,000.000	27,275,670.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,500,000.000	6,721,650.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,130,200.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,921,449.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,077,300.000	

3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,212,070.000	
3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,876,734.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,522,365.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,037,900.000	
3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,305,030.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,776,100.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,498,450.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,305,600.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	10,000,000.000	10,384,200.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,730,895.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	3,100,000.000	3,502,163.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	3,300,000.000	3,606,108.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,461,780.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	6,500,000.000	6,577,610.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,550,655.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,637,690.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	4,000,000.000	4,017,840.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	5,000,000.000	4,955,150.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,164,072.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	5,000,000.000	5,005,350.000	
オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元	

			231,967,297.000 (4,642,686,269)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	518,128.050	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,111,527.250	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,328,705.010	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,179,647.920	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	972,801.500	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	963,296.790	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,232,275.380	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,380,384.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,179,193.890	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,117,285.560	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	897,274.620	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,096,866.800	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	595,211.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,279,343.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,750,668.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,118,764.400	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,177,272.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,342,404.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,885,131.500	

1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	660,219.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,628,021.500	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,545,240.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,862,469.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,134,432.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	270,240.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,849,574.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	96,632.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	940,760.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	994,236.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	961,410.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	179,972.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,873,820.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,700,000.000	1,414,366.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,424.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	385,876.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	865,900.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	91,235.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	383,992.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	196,986.000	

カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 44,650,986.270 (4,652,632,769)	
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	785,587.200	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	926,968.900	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	793,629.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	374,868.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	672,684.210	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	577,656.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	617,500.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,664.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	642,248.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	436,095.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	667,920.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	538,175.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	485,021.600	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	312,900.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	555,930.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	692,475.000	
1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	529,344.000		
1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	158,530.000		



	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	185,960.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 10,470,155.910 (1,015,081,615)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	5,626,498.500	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,010,555.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,703,304.700	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,874,419.200	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,700,590.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,388,440.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	6,785,504.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,261,250.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 47,350,561.900 (627,394,945)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	18,259,946.100	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,881,957.320	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,035,669.010	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,100,000.000	6,600,799.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,724,128.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,054,115.000	

	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	412,755.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	965,220.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 46,934,589.430 (888,471,779)	
ノルウェー・ク ローネ	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,114,451.250	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,215,724.150	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,104,077.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,192,256.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,293,115.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,508,697.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	5,948,912.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,971,885.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,556,180.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 34,905,298.500 (470,872,477)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,569,224.650	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,463,882.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,625,705.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,524,972.000	

	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,024,300.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,660,700.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	1,844,550.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,601,930.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	861,750.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	900,000.000	537,795.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	418,410.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	749,634.150	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,125,000.000	2,042,146.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	2,806,558.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,029,382.970	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 31,760,941.120 (955,807,410)	
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	2,311,563.030	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,186,799.660	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,541,675.920	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,281,384.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	726,160.780	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,340,480.990	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,836,134.160	

4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,287,793.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,071,110.950	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,747,890.990	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,166,515.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,315,202.280	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	891,386.400	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,544,327.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,567,081.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,175,482.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	1,945,144.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,208,568.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,198,044.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	597,936.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	649,551.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,610,000.000	2,533,292.100	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,179,192.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	399,904.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,187,576.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,520,662.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,950,000.000	1,667,679.000	

	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,568,034.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	466,965.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	390,548.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	504,215.000	
マレーシア・リングgit 小計			マレーシア・リングgit 39,008,298.960 (1,191,192,524)	
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	32,879,338.800	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,650,493.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,073,862.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	5,954,130.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	891,480.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	29,386,089.180	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	24,143,599.410	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	25,902,283.520	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,431,997.120	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,368,148.800	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,705,945.280	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	29,651,729.100	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	18,622,006.920	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,091,926.560	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 271,753,029.690 (1,784,194,517)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	323,545.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	272,742.030	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	775,380.880	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	693,210.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	293,313.600	

0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	746,272.000	
1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	585,754.200	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	456,660.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	448,340.000	
Finland Government Bond 20240915	200,000.000	194,414.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	227,893.400	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	271,988.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	419,630.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	209,368.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	496,608.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	185,596.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	250,000.000	169,160.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,357,924.460	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,079,867.780	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	655,612.160	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	159,590.400	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	892,557.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,203,724.800	
2.1% Austria Government Bond 21170920	590,000.000	478,023.900	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,124,736.000	

0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	885,822.000	
Austria Government Bond 20240715	1,300,000.000	1,268,059.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	832,510.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	459,074.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	254,552.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	142,411.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	990,264.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	460,435.200	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	441,666.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	149,172.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	263,769.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	439,055.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	265,887.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,660,687.550	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,594,843.740	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	963,711.040	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,812,140.100	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	982,312.160	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	614,747.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	931,756.200	

0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,045,770.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,029,336.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	509,135.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	516,894.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,395,012.500	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	583,505.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,388,370.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	553,700.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,037,122.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	583,088.600	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,086,612.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,292,288.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	228,631.400	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	327,012.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	600,000.000	424,824.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,056,156.900	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,447,301.730	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,630,808.080	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,124,838.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,592,761.940	



5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,984,619.920	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,059,657.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	4,569,058.790	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,791,254.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,511,185.560	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,274,000.000	2,821,897.560	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,172,169.520	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,624,631.970	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,581,386.660	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,064,909.950	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,606,210.040	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,023,972.680	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,149,220.460	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,099,964.760	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,291,845.120	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,279,083.400	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,968,160.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,180,768.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,463,610.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,790,389.000	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	2,858,324.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,015,024.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,675,580.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	1,360,597.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,546,685.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,665,594.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,839,480.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,576,458.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,052,688.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	781,281.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,088,864.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,808,940.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	668,338.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,090,456.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	602,161.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,500,000.000	1,273,425.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	994,460.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	99,085.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,000,000.000	580,180.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,150,986.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	98,269.000	
0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	98,074.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,882,900.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,884,748.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,651,533.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,313,096.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,199,375.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	95,806.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,083,950.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,220,024.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	92,902.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,460,509.250	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,062,267.810	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,242,633.710	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,340,661.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,241,285.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,846,900.800	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,227,211.790	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	4,683,251.520	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	2,217,780.220	

3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,892,761.280	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	5,950,610.850	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	2,861,551.600	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,184,159.800	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,246,579.190	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,939,710.690	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,388,706.640	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,993,572.940	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,620,000.000	5,305,673.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,181,425.180	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,563,536.130	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,049,861.910	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,782,983.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,305,161.500	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,262,980.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,248,131.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,106,652.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,467,626.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,577,611.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,333,632.000	

1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	3,150,000.000	2,443,297.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,922,612.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,152,989.600	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,601,122.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,679,090.900	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,820,240.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,540,528.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,330,240.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	395,998.400	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	98,218.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	969,495.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,722,136.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,843,785.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,300,000.000	768,755.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,600,000.000	1,271,744.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	100,000.000	95,938.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	166,110.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	280,038.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,363,064.080	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,162,335.500	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,159,814.930	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,525,736.440	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,399,916.450	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,175,024.660	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,536,604.020	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,725,288.210	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,852,747.380	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,094,774.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,376,704.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,267,906.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,070,568.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	680,400.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,199,632.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	740,072.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,150,000.000	623,668.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,089,270.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	641,619.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	795,132.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	94,381.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	300,000.000	257,268.000	

9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	995,241.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,296,391.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,762,066.320	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,806,961.680	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,302,131.190	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,390,429.790	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,677,213.650	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,794,758.610	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,250,406.500	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,250,713.800	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,852,878.720	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	980,413.320	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,529,400.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	704,394.240	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,277,700.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,431,631.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,289,262.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	1,636,362.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,529,009.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,553,280.000	

2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,114,828.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,946,364.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,248,039.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,436,219.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,221,032.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,525,014.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,169,339.800	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,551,280.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,815,982.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,170,608.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,012,535.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,077,737.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,585,816.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,222,065.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,107,785.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,103,274.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,081,215.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	1,987,200.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,226,032.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,591,080.000	



1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,758,015.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,282,918.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,940,840.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,549,499.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,037,625.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,470,581.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,065,636.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	705,324.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	456,134.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,580,173.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,300,000.000	1,705,473.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	430,206.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	975,403.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,439,325.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	274,955.800	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	667,384.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,443,202.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	948,110.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,160,784.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	963,149.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,270,325.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	728,757.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	280,221.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	600,000.000	385,890.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	194,490.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	269,694.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	472,465.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	751,784.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	300,000.000	258,222.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	266,151.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,588,934.220	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,292,646.280	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,058,674.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,488,458.240	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,698,297.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,245,313.560	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,332,846.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,243,152.620	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,464,585.970	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,175,031.800	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,567,276.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,957,459.840	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,283,975.940	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,260,052.830	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,283,739.960	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,048,906.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,428,152.160	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,962,445.880	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,106,785.680	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	895,221.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,359,033.360	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	989,184.630	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,545,258.750	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	788,592.960	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,140,873.670	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	631,116.110	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	985,370.960	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	831,420.240	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,047,763.040	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	497,117.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	752,368.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	668,445.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	700,005.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	894,453.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	537,446.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	270,693.500	

0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	738,576.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	679,080.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	645,280.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	278,544.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,842.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,006,145.250	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,668,483.330	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	981,041.250	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	445,071.640	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	820,424.250	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	970,210.710	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	775,988.370	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	940,621.000	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	717,098.370	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	407,391.920	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	415,949.930	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	537,501.030	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,202,926.480	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,021,278.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,926,643.320	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,193,490.560	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,698,755.510	

2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,794,942.080	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,452,722.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,517,672.700	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,817,065.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,627,902.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,940,079.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,248,392.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,500,000.000	1,314,735.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,384,496.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,706,976.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,480,496.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	1,579,456.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,228,493.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,410,716.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,145,228.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,375,750.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	784,546.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,206,080.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,119,464.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	914,173.000	

SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	460,585.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,722,666.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	290,466.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	323,102.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	433,380.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	636,246.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,518,062.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	394,836.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	803,268.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,682,268.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	415,110.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	93,978.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	87,594.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,706,165.470	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	2,514,201.760	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	2,637,831.300	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,772,508.420	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,361,187.750	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,001,242.900	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,242,792.050	

	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	1,981,868.540	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,030,809.500	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,669,111.080	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,049,627.400	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,143,784.070	
	ユーロ 小計		ユーロ 571,702,272.750 (80,495,680,003)	
国債証券 合計			230,597,354,794 [230,597,354,794]	
合計			230,597,354,794 [230,597,354,794]	

- (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 263銘柄	100%	51.2%
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	100%	5.0%
イスラエル・シェケル	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 33銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券 39銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.4%
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 15銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 31銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 358銘柄	100%	34.9%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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



**【ダイワファンドラップ 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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）

## (1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,705,264	11,666,767
親投資信託受益証券	1,947,196,276	2,287,626,681
流動資産合計	1,956,901,540	2,299,293,448
資産合計	1,956,901,540	2,299,293,448
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	201,988	235,601
未払委託者報酬	3,737,535	4,359,420
その他未払費用	75,677	88,278
流動負債合計	4,015,200	4,683,299
負債合計	4,015,200	4,683,299
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,600,235,730	1,913,328,634
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	352,650,610	381,281,515
（分配準備積立金）	168,942,214	152,811,045
元本等合計	1,952,886,340	2,294,610,149
純資産合計	1,952,886,340	2,294,610,149
負債純資産合計	1,956,901,540	2,299,293,448

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		6		-
有価証券売買等損益		115,323,370		26,459,664
営業収益合計		115,323,376		26,459,664
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,222		1,854
受託者報酬		394,207		453,976
委託者報酬		7,294,233		8,400,205
その他費用		147,716		170,088
営業費用合計		7,837,378		9,026,123
営業利益又は営業損失（ ）		107,485,998		35,485,787
経常利益又は経常損失（ ）		107,485,998		35,485,787
当期純利益又は当期純損失（ ）		107,485,998		35,485,787
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（ ）		4,310,567		1,573,109
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		223,670,333		352,650,610
剰余金増加額又は欠損金減少額		51,918,364		99,803,003
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		51,918,364		99,803,003
剰余金減少額又は欠損金増加額		26,113,518		37,259,420
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		26,113,518		37,259,420
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		352,650,610		381,281,515

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,483,316,344円	1,600,235,730円
期中追加設定元本額	288,268,635円	483,164,155円
期中一部解約元本額	171,349,249円	170,071,251円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,600,235,730口	1,913,328,634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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(103,175,398円)、投資信託約款に規定される収益調整金(183,709,552円)及び分配準備積立金(65,766,816円)より分配対象額は352,651,766円(1万口当たり2,203.75円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(228,473,278円)及び分配準備積立金(152,811,045円)より分配対象額は381,284,323円(1万口当たり1,992.78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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	111,384,127	25,389,933
合計	111,384,127	25,389,933

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.2204円	1.1993円

(1万口当たり純資産額)	(12,204円)	(11,993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	320,250,166	458,470,137	
	外国債券インデックスマザーファンド	590,145,683	1,829,156,544	
親投資信託受益証券 合計			2,287,626,681	
合計			2,287,626,681	

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

前記「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）」に記載のとおりであります。

## 「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6月15日現在	2022年6月15日現在
--	--------------	--------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	137,365,395	144,216,820
コール・ローン	253,310,609	158,474,747
国債証券	20,370,318,913	24,262,786,212
派生商品評価勘定	495,294	1,207,005
未収入金	430,557	704,277
未収利息	303,814,808	402,462,526
前払費用	17,889,938	38,027,128
流動資産合計	21,083,625,514	25,007,878,715
資産合計	21,083,625,514	25,007,878,715
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	673,483	-
未払金	45,613,599	56,082,645
未払解約金	6,709,651	11,516,689
その他未払費用	2,932	-
流動負債合計	52,999,665	67,599,334
負債合計	52,999,665	67,599,334
純資産の部		
元本等		
元本	1 14,218,438,245	17,421,108,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,812,187,604	7,519,170,691
元本等合計	21,030,625,849	24,940,279,381
純資産合計	21,030,625,849	24,940,279,381
負債純資産合計	21,083,625,514	25,007,878,715

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15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6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	11,622,687,317円	14,218,438,245円
期中追加設定元本額	3,255,307,337円	3,962,297,329円
期中一部解約元本額	659,556,409円	759,626,884円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投 資家専用)	128,487,536円	232,916,589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)	262,791,891円	320,250,166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)	426,511,600円	353,283,647円
D-I's 新興国債券イン デックス	55,078,337円	60,099,426円
iFree 新興国債券イン デックス	3,672,682,812円	4,992,677,073円
iFree 8資産バランス 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)	2,627,617,245円	3,623,367,207円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	- 円	692,689円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	162,459,472円	145,587,634円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	32,532,606円	32,381,928円
計	14,218,438,245円	17,421,108,690円
2. 期末日における受益権の総数	14,218,438,245口	17,421,108,690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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	512,675,039	5,290,296,932
合計	512,675,039	5,290,296,932

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2020年7月7日から2021年6月15日まで、及び2021年7月6日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	202,608,613	-	202,430,424	178,189	60,822,219	-	62,029,224	1,207,005
チェコ・コルナ	18,112,684	-	18,065,846	46,838	-	-	-	-
トルコ・リラ	31,836,127	-	32,327,558	491,431	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	17,163,450	-	17,152,515	10,935	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	31,976,138	-	31,719,157	256,981	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	7,774,514	-	7,774,608	94	-	-	-	-
ルーマニア・ レイ	60,115,315	-	59,847,021	268,294	60,822,219	-	62,029,224	1,207,005
南アフリカ・ ランド	35,630,385	-	35,543,719	86,666	-	-	-	-
合計	202,608,613	-	202,430,424	178,189	60,822,219	-	62,029,224	1,207,005

(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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4791円 (14,791円)	1.4316円 (14,316円)

附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	8,492,220,000.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	6,425,520,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,472,060,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,234,227,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,543,500,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	4,700,000,000.000	5,033,747,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	12,654,840,000.000	

7% Indonesia Treasury Bond 20300915	17,800,000,000.000	17,434,922,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	15,700,000,000.000	15,980,559,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	9,300,000,000.000	9,190,632,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	11,500,000,000.000	11,809,695,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	14,400,000,000.000	14,052,960,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	15,800,000,000.000	14,860,532,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	4,300,000,000.000	3,850,306,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	12,600,000,000.000	11,708,046,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	9,000,000,000.000	8,444,880,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	5,700,000,000.000	5,528,658,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,141,044,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2,180,000,000.000	2,635,576,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,393,076,500.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	13,721,551,760.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	4,978,617,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	12,530,000,000.000	12,749,901,500.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	6,910,000,000.000	7,008,191,100.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,046,960,000.000	
6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	6,613,710,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	13,149,004,800.000	

	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	15,150,000,000.000	15,977,038,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	10,620,000,000.000	11,666,494,800.000	
インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア 275,798,470,860.000 (2,537,345,932)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,558,724.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	5,967,500.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			ウルグアイ・ペソ 8,526,224.000 (28,723,144)	
エジプト・ポンド	16.1% ARAB REP EGYPT 20290507	1,500,000.000	1,512,510.000	
	14.35% ARAB REP EGYPT 20240910	1,000,000.000	979,960.000	
	14.4% ARAB REP EGYPT 20290910	4,000,000.000	3,818,120.000	
	13.536% ARAB REP EGYPT 20250114	1,500,000.000	1,439,325.000	
	14.664% ARAB REP EGYPT 20301006	4,500,000.000	4,257,360.000	
	14.556% ARAB REP EGYPT 20271013	2,000,000.000	1,900,760.000	
	14.369% ARAB REP EGYPT 20251020	9,000,000.000	8,680,140.000	
	14.292% ARAB REP EGYPT 20280105	6,000,000.000	5,658,360.000	
	14.06% ARAB REP EGYPT 20260112	10,000,000.000	9,544,200.000	
	14.483% ARAB REP EGYPT 20260406	9,000,000.000	8,732,250.000	
	14.563% ARAB REP EGYPT 20260706	1,000,000.000	967,050.000	
	14.531% ARAB REP EGYPT 20240914	3,000,000.000	2,949,090.000	
エジプト・ポンド 小計			エジプト・ポンド	

			50,439,125.000 (363,373,545)	
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	2,700,000.000	2,742,093.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,797,051.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,956,096.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	4,000,000.000	4,070,840.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,117,946.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,935,696.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,298,490.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	5,826,483.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,565,610.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	8,600,000.000	8,690,042.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	8,000,000.000	7,917,600.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,423,690.000	
	2.36% China Government Bond 20230702	6,150,000.000	6,168,942.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	4,900,000.000	4,950,029.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,126,630.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,164,800.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	7,300,000.000	7,548,930.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,972,540.000	



	3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,293,754.000	
	2.84% China Government Bond 20240408	4,000,000.000	4,041,400.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,077,300.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,141,380.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,876,734.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	1,500,000.000	1,507,455.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,816,578.000	
	3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	1,000,000.000	1,039,340.000	
	2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	1,000,000.000	1,004,460.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 128,071,909.000 (2,563,282,415)	
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	88,179,300.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	43,132,500.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,850,000,000.000	3,831,366,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	4,870,000,000.000	3,798,843,500.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	4,710,000,000.000	4,162,556,700.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	3,600,000,000.000	2,889,396,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	4,650,000,000.000	3,408,961,500.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,700,000,000.000	2,353,941,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,200,000,000.000	2,991,576,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,200,000,000.000	2,507,552,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	2,310,000,000.000	1,428,919,800.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	1,900,000,000.000	1,188,355,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	2,300,000,000.000	1,737,397,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	1,500,000,000.000	1,188,030,000.000	
	コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ	

			31,618,206,300.000 (1,075,588,142)	
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	40,374,197.500	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	23,859,899.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,610,000.000	33,058,370.200	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	28,700,000.000	29,934,100.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	29,600,000.000	28,956,496.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	35,400,000.000	34,676,070.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	24,000,000.000	24,135,120.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	37,500,000.000	39,641,625.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	28,404,761.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	21,500,000.000	21,772,190.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	26,500,000.000	26,483,835.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,500,000.000	38,326,365.000	
	1.45% Thailand Government Bond 20241217	34,000,000.000	33,571,600.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	36,500,000.000	33,021,185.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	12,609,715.000	
	0.95% Thailand Government Bond 20250617	34,000,000.000	32,908,940.000	
	0.75% Thailand Government Bond 20240617	39,900,000.000	39,079,656.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	32,900,000.000	26,321,316.000	

	2% Thailand Government Bond 20311217	36,000,000.000	32,902,920.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	19,000,000.000	14,463,750.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	32,000,000.000	29,527,360.000	
	0.75% THAILAND GOVERNMENT BOND 20240917	16,000,000.000	15,618,720.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 639,648,190.700 (2,462,645,535)	
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	16,483,208.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	12,100,000.000	12,002,353.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	21,100,000.000	19,034,310.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	17,900,000.000	14,950,080.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	16,000,000.000	11,417,280.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	11,900,000.000	11,018,210.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	22,500,000.000	17,597,250.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	18,000,000.000	15,143,580.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	19,000,000.000	13,490,950.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	16,200,000.000	11,459,070.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	10,000,000.000	6,725,000.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	9,500,000.000	8,221,205.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	14,500,000.000	10,420,425.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	17,500,000.000	15,469,125.000	

	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	10,000,000.000	5,487,700.000	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20241212	5,000,000.000	4,311,250.000	
チェコ・コロナ 小計			チェコ・コロナ 193,230,996.000 (1,099,967,444)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	466,770,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	495,164,700.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	510,000,000.000	479,053,200.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	685,000,000.000	606,430,500.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	241,850,000.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	850,000,000.000	765,297,500.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	250,000,000.000	194,652,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	183,094,000.000	
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 3,432,312,400.000 (533,460,291)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,500,804.600	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	553,057.600	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,257,577.600	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	1,930,075.000	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	1,915,600.900	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,168,100.000	

	10.5% Turkey Government Bond 20270811	2,500,000.000	1,825,650.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	2,600,000.000	2,467,036.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,650,000.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	2,800,000.000	2,626,932.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	6,100,000.000	4,943,867.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	8,400,000.000	6,231,456.000	
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 30,070,156.700 (235,307,998)	
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 10,851,500.000	
ドミニカ・ペソ 小計			ドミニカ・ペソ 10,851,500.000 (26,672,987)	
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	89,689,175.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	131,928,500.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	137,611,600.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	103,321,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	81,273,280.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	156,739,500.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	110,000,000.000	97,519,400.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	185,789,600.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	37,382,000.000	

	1% Hungary Government Bond 20251126	200,000,000.000	158,440,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	109,251,700.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	169,000,000.000	132,267,850.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	91,536,750.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	215,000,000.000	124,592,500.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	76,377,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	70,000,000.000	35,619,500.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	41,580,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	81,800,000.000	80,090,380.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	132,959,625.000	
	ハンガリー・フォリント 小計		ハンガリー・フォリント 2,003,969,760.000 (703,695,985)	
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 9,982,500.000	
	フィリピン・ペソ 小計		フィリピン・ペソ 9,982,500.000 (25,310,630)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	ブラジル・リアル 10,710,000.000	ブラジル・リアル 10,513,685.700	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	10,390,000.000	9,716,000.700	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	10,950,000.000	9,832,333.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	8,100,000.000	7,043,193.000	

	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	4,600,000.000	3,888,932.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	19,300,000.000	16,854,690.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	27,700,000.000	22,734,775.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	9,300,000.000	7,195,968.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	2,900,000.000	1,996,389.000	
	ブラジル・リアル 小計		ブラジル・リアル 89,775,966.900 (2,367,787,261)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 725,707.600	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	2,870,000.000	2,680,465.200	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	2,550,000.000	2,209,065.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,700,000.000	2,439,477.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,612,632.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,000,000.000	723,060.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	1,634,892.900	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	1,817,117.400	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	2,570,000.000	2,392,849.900	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 16,235,267.500 (583,372,126)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	ポーランド・ズロチ 7,490,000.000	ポーランド・ズロチ 6,107,720.500	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	5,240,000.000	4,072,790.000	

	2.5% Poland Government Bond 20230125	4,500,000.000	4,394,700.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	4,700,000.000	4,299,936.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	7,150,000.000	5,207,345.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	5,000,000.000	4,447,500.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	4,700,000.000	3,902,645.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,600,000.000	3,443,160.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	5,700,000.000	4,150,455.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	2,500,000.000	1,493,875.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	4,530,000.000	4,353,375.300	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	5,700,000.000	4,382,844.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	6,150,000.000	5,397,670.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 55,654,016.300 (1,674,840,836)	
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	1,826,586.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,035,780.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	3,500,000.000	3,509,275.000	
	4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,934,352.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,600,000.000	1,595,584.000	
	3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	3,700,000.000	3,737,037.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,207,476.000	



3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	4,000,000.000	3,758,680.000	
3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,700,000.000	3,573,053.000	
3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,100,000.000	2,723,629.000	
4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	2,100,000.000	1,990,968.000	
3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,450,000.000	2,386,569.500	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	2,500,000.000	2,515,925.000	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,250,000.000	3,164,070.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,763,229.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	4,450,000.000	4,477,901.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	2,300,000.000	2,199,168.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,414,196.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,800,000.000	3,786,092.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,720,000.000	1,738,954.400	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,489,256.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	2,593,526.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,500,000.000	1,510,710.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,412,474.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	1,998,620.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	2,863,299.500	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	3,300,000.000	3,299,208.000	

	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,350,000.000	2,146,772.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	3,600,000.000	3,128,220.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	3,600,000.000	3,078,792.000	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	2,900,000.000	2,526,277.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,000,000.000	933,930.000	
	4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	1,000,000.000	995,220.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 83,314,829.900 (2,544,176,629)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	52,400,000.000	46,202,128.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	27,800,000.000	24,341,958.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	41,000,000.000	39,749,090.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,500,000.000	17,203,550.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	13,000,000.000	11,057,670.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	27,250,000.000	26,663,035.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	26,550,000.000	26,799,304.500	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	36,230,000.000	33,554,052.200	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	7,854,683.200	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	31,730,000.000	30,467,146.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	29,100,000.000	27,270,192.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	41,350,000.000	37,708,719.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	26,120,000.000	22,462,677.600	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	9,311,278.200	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 360,645,483.700 (2,367,817,924)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,404,789.100	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,046,960.000	

5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	1,856,589.000	
3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,066,979.200	
3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,460,048.000	
4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,444,260.000	
5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,121,886.000	
4.85% Romania Government Bond 20260422	1,600,000.000	1,405,120.000	
3.65% Romania Government Bond 20310924	1,400,000.000	958,454.000	
4.5% Romania Government Bond 20240617	900,000.000	836,091.000	
3.65% Romania Government Bond 20250728	1,500,000.000	1,305,495.000	
4% Romania Government Bond 20231025	1,600,000.000	1,516,288.000	
4.15% Romania Government Bond 20280126	1,600,000.000	1,284,896.000	
3.7% Romania Government Bond 20241125	1,300,000.000	1,166,256.000	
3.25% Romania Government Bond 20260624	2,100,000.000	1,726,410.000	
4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,000,000.000	1,471,200.000	
4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	800,000.000	558,072.000	
2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	1,300,000.000	965,094.000	
ルーマニア・レイ 小計		ルーマニア・レイ 23,594,887.300 (672,069,691)	
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	47,950,000.000	50,788,640.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	14,720,000.000	9,701,952.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	13,280,000.000	8,271,448.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	19,540,000.000	15,528,438.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,880,000.000	8,998,992.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	45,520,000.000	35,582,984.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	29,900,000.000	23,975,315.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	42,400,000.000	37,201,760.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	27,600,000.000	21,711,540.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	34,900,000.000	29,565,535.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	28,800,000.000	24,467,040.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	23,100,000.000	18,926,985.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 284,720,629.000 (2,397,347,697)	
国債証券 合計			24,262,786,212 [24,262,786,212]	
合計			24,262,786,212 [24,262,786,212]	

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における ( ) 内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における [ ] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、

内数で表示しております。

### 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 29銘柄	100%	10.5%
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%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 27銘柄	100%	10.5%
コロンビア・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	4.4%
タイ・バーツ	国債証券 22銘柄	100%	10.1%
チェコ・コルナ	国債証券 16銘柄	100%	4.5%
チリ・ペソ	国債証券 8銘柄	100%	2.2%
トルコ・リラ	国債証券 12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 19銘柄	100%	2.9%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	9.8%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	2.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	6.9%
マレーシア・リングgit	国債証券 33銘柄	100%	10.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.8%
ルーマニア・レイ	国債証券 18銘柄	100%	2.8%
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 12銘柄	100%	9.9%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 【ダイワファンドラップ 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

## ダイワファンドラップ 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6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,172,531	25,258,380
親投資信託受益証券	6,099,988,525	6,939,720,471
流動資産合計	6,114,161,056	6,964,978,851
資産合計	6,114,161,056	6,964,978,851
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,841,673	10,102,771
未払受託者報酬	593,199	735,028
未払委託者報酬	8,601,978	10,658,698
その他未払費用	148,221	183,690
流動負債合計	11,185,071	21,680,187
負債合計	11,185,071	21,680,187
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,336,083,892	1 5,463,295,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,766,892,093	1,480,003,163
（分配準備積立金）	1,217,958,196	1,020,863,659
元本等合計	6,102,975,985	6,943,298,664
純資産合計	6,102,975,985	6,943,298,664
負債純資産合計	6,114,161,056	6,964,978,851



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		37		2
有価証券売買等損益		1,611,112,750		642,518,054
営業収益合計		1,611,112,787		642,518,052
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,238		3,596
受託者報酬		1,091,772		1,432,235
委託者報酬		15,832,018		20,768,936
その他費用		272,893		357,908
営業費用合計		17,199,921		22,562,675
営業利益又は営業損失（ ）		1,593,912,866		665,080,727
経常利益又は経常損失（ ）		1,593,912,866		665,080,727
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,593,912,866		665,080,727
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		132,958,524		38,546,589
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		125,755,253		1,766,892,093
剰余金増加額又は欠損金減少額		225,446,765		678,481,345
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		225,446,765		678,481,345
剰余金減少額又は欠損金増加額		45,264,267		338,836,137
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		45,264,267		338,836,137
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,766,892,093		1,480,003,163

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	3,955,757,912円	4,336,083,892円
期中追加設定元本額	1,408,443,585円	1,972,084,634円
期中一部解約元本額	1,028,117,605円	844,873,025円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,336,083,892口	5,463,295,501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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(955,917,834円)、投資信託約款に規定される収益調整金(548,936,699円)及び分配準備積立金(262,040,362円)より分配対象額は1,766,894,895円(1万口当たり4,074.86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(1,128,740,648円)及び分配準備積立金(1,020,863,659円)より分配対象額は2,149,604,307円(1万口当たり3,934.63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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,523,352,266	626,186,011
合計	1,523,352,266	626,186,011

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4075円 (14,075円)	1.2709円 (12,709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	2,188,150,866	6,939,720,471	
親投資信託受益証券 合計			6,939,720,471	
合計			6,939,720,471	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		9,391,833,293	8,226,563,058
投資証券	2	477,927,135,200	429,701,345,100
派生商品評価勘定		193,704,000	-
未収入金		2,888,260,342	1,569,533,936
未収配当金		2,704,946,046	2,639,651,445
前払金		-	409,920,000
流動資産合計		493,105,878,881	442,547,013,539
資産合計		493,105,878,881	442,547,013,539
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	729,736,000
前受金		230,720,000	-
未払解約金		88,913,000	18,334,000
流動負債合計		319,633,000	748,070,000
負債合計		319,633,000	748,070,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	140,780,222,102	139,303,981,506
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		352,006,023,779	302,494,962,033
元本等合計		492,786,245,881	441,798,943,539
純資産合計		492,786,245,881	441,798,943,539
負債純資産合計		493,105,878,881	442,547,013,539

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	126,932,759,051円	140,780,222,102円
期中追加設定元本額	40,009,856,488円	25,498,473,442円
期中一部解約元本額	26,162,393,437円	26,974,714,038円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	5,423,655,838円	4,649,706,801円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	124,292,216,452円	122,625,951,024円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	334,735,806円	343,647,782円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,678,854円	12,174,835円
iFree J-REITイ ンデックス	440,538,252円	632,690,424円
iFree 8資産バランス	1,135,916,681円	1,531,174,342円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,406,499,984円	5,400,391,803円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,669,644円	6,412,105円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,416,293円	5,416,927円
	ダイワ国内REITインデッ クス（投資一任専用）	- 円	324,864円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	103,578,212円	94,767,979円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	1,742,654,704円	2,188,150,866円
	ダイワJ - REITインデッ クス（ダイワSMA専用）	388,974,439円	366,782,635円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	471,415,178円	505,967,594円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,027,271,765円	940,421,525円
	計	140,780,222,102円	139,303,981,506円
2.	期末日における受益権の総数	140,780,222,102口	139,303,981,506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 5,835,100,000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 5,215,950,000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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4 項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用 の基本方針」に従っております。



2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	44,692,150,542	2,933,814,643
合計	44,692,150,542	2,933,814,643

(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3月16日から2021年6月15日まで、及び2022年3月16日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 不動産投信関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	11,722,480,000	-	11,916,800,000	194,320,000	11,131,120,000	-	10,402,000,000	729,120,000
合計	11,722,480,000	-	11,916,800,000	194,320,000	11,131,120,000	-	10,402,000,000	729,120,000

(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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.5004円	3.1715円
(1万口当たり純資産額)	(35,004円)	(31,715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	8,307	1,064,126,700	
	サンケイリアルエステート	13,067	1,253,125,300	
	SOSILA物流リート投	19,191	2,721,283,800	
	東海道リート投資法	3,159	365,180,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	14,244	9,130,404,000	
	森ヒルズリート	48,511	6,995,286,200	
	産業ファンド	58,566	10,073,352,000	
	アドバンス・レジデンス	41,247	13,797,121,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	29,519	5,965,789,900	
	A P I 投資法人	21,986	8,662,484,000	
	G L P 投資法人	133,610	20,602,662,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	19,191	6,150,715,500	
	日本プロロジスリート	67,495	21,463,410,000	
	星野リゾート・リート	6,913	4,562,580,000	
	ONE リート投資法人	7,159	1,867,067,200	
	イオンリート投資	48,515	7,088,041,500	
	ヒューリックリート投資法	38,485	5,918,993,000	
	日本リート投資法人	12,730	4,563,705,000	
	積水ハウス・リート投資	125,223	9,454,336,500	
	トーセイ・リート投資法人	8,619	1,097,198,700	
	ケネディクス商業リート	16,471	4,328,578,800	
	ヘルスケア&メディカル投資	10,106	1,516,910,600	
	サムティ・レジデンシャル	9,345	1,221,391,500	
	野村不動産マスターF	133,405	21,291,438,000	
	いちごホテルリート投資	6,834	610,276,200	
	ラサールロジポート投資	50,502	8,393,432,400	
	スターアジア不動産投	42,633	2,515,347,000	
	マリモ地方創生リート	4,831	645,421,600	
	三井不ロジパーク	16,250	8,222,500,000	
	大江戸温泉リート	6,659	443,489,400	
	投資法人みらい	49,971	2,408,602,200	
	森トラスト・ホテルリート投	9,679	1,179,870,100	
三菱地所物流REIT	11,985	5,177,520,000		
CREロジスティクスファンド	15,977	3,027,641,500		
ザイマックス・リート	6,658	814,939,200		
タカラレーベン不動産投	16,268	1,830,150,000		
アドバンス・ロジスティクス投資法人	16,085	2,380,580,000		

日本ビルファンド	48,095	32,367,935,000	
ジャパンリアルエステイト	41,254	24,876,162,000	
日本都市ファンド投資法人	208,146	21,022,746,000	
オリックス不動産投資	82,197	14,392,694,700	
日本プライムリアルティ	28,189	10,937,332,000	
NTT都市開発リート投資法人	39,543	5,658,603,300	
東急リアル・エステート	27,659	5,083,724,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	28,263	2,916,741,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	92,869	12,537,315,000	
森トラスト総合リート	29,484	3,992,133,600	
インヴィンシブル投資法人	181,574	6,963,362,900	
フロンティア不動産投資	14,462	7,288,848,000	
平和不動産リート	28,123	3,900,660,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	27,816	8,525,604,000	
福岡リート投資法人	21,336	3,424,428,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,762	8,001,774,000	
いちごオフィスリート投資法人	33,803	2,738,043,000	
大和証券オフィス投資法人	8,722	5,651,856,000	
阪急阪神リート投資法人	18,634	2,653,481,600	
スターツプロシード投資法人	6,424	1,478,804,800	
大和ハウスリート投資法人	61,942	17,963,180,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	126,383	7,709,363,000	
大和証券リビング投資法人	55,743	6,209,770,200	
ジャパンエクセレント投資法人	37,844	4,601,830,400	
投資証券 合計		429,701,345,100	
合計		429,701,345,100	

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 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	56,363,712	44,718,355
親投資信託受益証券	17,864,614,746	16,269,038,236
派生商品評価勘定	5,113,293	-
流動資産合計	17,926,091,751	16,313,756,591
<b>資産合計</b>		
17,926,091,751		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	85,158,764	-
未払金	321,150	-
未払解約金	22,051,024	1,342,516
未払受託者報酬	1,655,340	2,144,216
未払委託者報酬	31,038,321	40,204,835
その他未払費用	413,747	535,974
流動負債合計	140,638,346	44,227,541
<b>負債合計</b>		
140,638,346		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,593,897,109	15,522,412,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,191,556,296	747,117,015
（分配準備積立金）	3,334,362,973	2,541,468,191
元本等合計	17,785,453,405	16,269,529,050
<b>純資産合計</b>		
17,785,453,405		
<b>負債純資産合計</b>		
17,926,091,751		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		213		-
有価証券売買等損益		5,262,176,668		722,040,635
為替差損益		842,309,290		1,747,775,457
<b>営業収益合計</b>		<b>4,419,867,591</b>		<b>2,469,816,092</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,148		8,453
受託者報酬		3,034,670		4,219,194
委託者報酬		56,901,490		79,111,292
その他費用		764,622		1,323,754
<b>営業費用合計</b>		<b>60,709,930</b>		<b>84,662,693</b>
営業利益又は営業損失( )		4,359,157,661		2,554,478,785
経常利益又は経常損失( )		4,359,157,661		2,554,478,785
当期純利益又は当期純損失( )		4,359,157,661		2,554,478,785
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		235,568,398		180,964,139
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,167,524,087		3,191,556,296
剰余金増加額又は欠損金減少額		236,708,109		1,223,683,550
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		236,708,109		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,223,683,550
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,216,989		932,679,907
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		932,679,907
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,216,989		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		3,191,556,296		747,117,015



## (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6月16日	至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	13,224,446,669円	14,593,897,109円
期中追加設定元本額	4,211,375,221円	5,111,449,724円
期中一部解約元本額	2,841,924,781円	4,182,934,798円
2. 計算期間末日における受益権の総数	14,593,897,109口	15,522,412,035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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,630,151,149円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,237,935,151円)及び分配準備積立金(704,211,824円)より分配対象額は4,572,298,124円(1万口当たり3,133.02円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,321,738,980円)及び分配準備積立金(2,541,468,191円)より分配対象額は4,863,207,171円(1万口当たり3,133.02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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	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6月15日現在
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,932,244,450	3,501,341,986
合計	4,932,244,450	3,501,341,986

## （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 2021年6月15日 現在				第6期 2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引  為替予約取引								

売 建	16,716,939,394	-	16,796,984,865	80,045,471	-	-	-	-
アメリカ・ドル	12,423,985,463	-	12,504,588,657	80,603,194	-	-	-	-
イギリス・ポンド	1,000,330,777	-	998,573,718	1,757,059	-	-	-	-
イスラエル・ シェケル	7,611,597	-	7,663,001	51,404	-	-	-	-
オーストラリア・ ドル	1,180,697,822	-	1,182,745,603	2,047,781	-	-	-	-
カナダ・ドル	332,512,038	-	332,312,101	199,937	-	-	-	-
シンガポール・ ドル	580,590,224	-	581,264,956	674,732	-	-	-	-
ニュージー ランド・ドル	70,088,715	-	69,225,727	862,988	-	-	-	-
ユーロ	836,349,121	-	834,100,320	2,248,801	-	-	-	-
香港・ドル	284,773,637	-	286,510,782	1,737,145	-	-	-	-
合計	16,716,939,394	-	16,796,984,865	80,045,471	-	-	-	-

## (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6月16日

至 2022年6月15日

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

(1口当たり情報)

	第5期 2021年6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2187円 (12,187円)	1.0481円 (10,481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	18,535,989,788	16,269,038,236	
親投資信託受益証券 合計			16,269,038,236	
合計			16,269,038,236	

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。

前計算期間末時点において、同マザーファンドは投資対象ではなかったため、期末日の状況のみを掲載しております。

「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6月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		38,375,995
コール・ローン		224,814,474
投資信託受益証券		748,747,617
投資証券		20,320,475,804
派生商品評価勘定		2,785,122
未収入金		15,956,744
未収配当金		48,218,543
差入委託証拠金		89,707,769
流動資産合計		21,489,082,068
資産合計		21,489,082,068
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		920,055,082
未払金		1,168,640
流動負債合計		921,223,722
負債合計		921,223,722
純資産の部		
元本等		
元本	1	23,434,151,916
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	2,866,293,570
元本等合計		20,567,858,346
純資産合計		20,567,858,346
負債純資産合計		21,489,082,068

#### 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10月6日 至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

<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>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> <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6月15日現在
1. 1 期首	2021年10月6日
期首元本額	1,492,500,000円
期中追加設定元本額	24,408,344,047円
期中一部解約元本額	2,466,692,131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	18,535,989,788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	857,624,811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	952,554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	1,483,812,793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	2,555,771,970円
クス（為替ヘッジあり）（ダ	
イワSMA専用）	



計	23,434,151,916円
2. 期末日における受益権の総数	23,434,151,916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2,866,293,570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10月6日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資効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。 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6月15日現在
-----	--------------

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2022年6月15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		80,203,063
投資証券		4,244,768,780
合計		4,324,971,843

（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10月6日から2022年6月15日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種 類	2022年6月15日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	479,224,828	-	475,302,358	3,922,470

合計	479,224,828	-	475,302,358	3,922,470
----	-------------	---	-------------	-----------

## (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6月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	23,280,653,896	-	24,194,001,386	913,347,490
アメリカ・ドル	17,843,267,642	-	18,686,685,572	843,417,930
イギリス・ポンド	1,269,424,854	-	1,267,237,768	2,187,086
イスラエル・ シケル	30,785,688	-	30,876,723	91,035
オーストラリア・ ドル	1,571,574,007	-	1,577,362,604	5,788,597
カナダ・ドル	454,248,302	-	464,177,616	9,929,314
シンガポール・ ドル	756,994,149	-	780,114,686	23,120,537
ニュージー ランド・ドル	83,460,168	-	83,321,320	138,848
ユーロ	902,532,463	-	918,530,943	15,998,480
香港・ドル	368,366,623	-	385,694,154	17,327,531
合計	23,280,653,896	-	24,194,001,386	913,347,490

## (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6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8777円
(1万口当たり純資産額)	(8,777円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	63,512.000	5,545,867.840	
		小計		5,545,867.840 (748,747,617)	
投資信託受益証券 合計				748,747,617 [748,747,617]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,189	292,388.250	

URBAN EDGE PROPERTIES	12,730	189,804.300	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13,204	204,662.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,158	2,992,300.020	
SIMON PROPERTY GROUP INC	37,991	3,666,511.410	
BOSTON PROPERTIES INC	16,434	1,489,577.760	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	18,583	108,896.380	
VORNADO REALTY TRUST	18,382	532,342.720	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,959	187,527.970	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,474	432,014.400	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,627	160,220.730	
EQUITY RESIDENTIAL	39,508	2,717,360.240	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24,552	363,860.640	
EPR PROPERTIES	8,648	376,706.880	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,427	89,513.240	
CITY OFFICE REIT INC	5,316	60,921.360	
GLOBAL NET LEASE INC	11,978	157,271.140	
EQUINIX INC	10,410	6,438,689.100	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,943	220,444.950	
CHATHAM LODGING TRUST	5,953	65,304.410	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,366	507,497.520	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14,038	216,746.720	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,867	94,266.960	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	35,476.480	
HOST HOTELS & RESORTS INC	82,551	1,418,226.180	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34,138	1,124,505.720	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,628	286,631.280	
RLJ LODGING TRUST	19,259	225,522.890	
FARMLAND PARTNERS INC	3,465	48,024.900	
PHYSICIANS REALTY TRUST	25,468	421,495.400	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,218	104,943.860	
KIMCO REALTY CORP	71,293	1,368,825.600	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,367	79,710.940	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	25,532	690,895.920	
WHITESTONE REIT	5,635	60,012.750	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27,151	1,174,823.770	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,352	186,145.440	
PARK HOTELS & RESORTS INC	27,340	419,395.600	
INVITATION HOMES INC	68,994	2,320,268.220	
JBG SMITH PROPERTIES	13,198	305,533.700	

ALEXANDER & BALDWIN INC	8,385	152,690.850	
CLIPPER REALTY INC	1,647	12,451.320	
GLADSTONE LAND CORP	3,800	83,790.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	30,842	892,567.480	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,984	110,897.760	
VICI PROPERTIES INC	97,469	2,741,802.970	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	29,035.420	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,145	359,410.600	
SAFEHOLD INC	1,726	59,650.560	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15,076	102,064.520	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,055	282,224.400	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,224	75,398.400	
STORE CAPITAL CORP	28,372	703,341.880	
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1,854	12,885.300	
BROADSTONE NET LEASE INC	18,644	360,015.640	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12,994	97,584.940	
LIFE STORAGE INC	9,483	971,248.860	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,088	175,334.400	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25,513	536,028.130	
PARAMOUNT GROUP INC	18,985	138,210.800	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,350	109,381.500	
NETSTREIT CORP	4,837	90,935.600	
APARTMENT INCOME REIT CO	18,149	715,796.560	
CTO REALTY GROWTH INC	728	41,874.560	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,528	1,073,327.040	
STAG INDUSTRIAL INC	20,373	619,542.930	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	22,890.060	
INDUS REALTY TRUST INC	807	46,588.110	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,085	29,857.200	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13,116	419,843.160	
ORION OFFICE REIT INC	6,912	80,110.080	
VENTAS INC	46,150	2,235,044.500	
CARETRUST REIT INC	11,218	187,228.420	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7,776	202,176.000	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34,434	686,958.300	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,911	114,673.400	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,438	347,395.320	
UMH PROPERTIES INC	5,564	94,532.360	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,127	75,204.350	
IRON MOUNTAIN INC	33,475	1,582,698.000	
TERRENO REALTY CORP	8,728	478,992.640	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,764	534,899.720	
SUN COMMUNITIES INC	13,407	2,024,993.280	
ACADIA REALTY TRUST	10,226	164,536.340	
ALEXANDER'S INC	262	56,854.000	
PROLOGIS INC	85,553	9,467,294.980	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,827	2,277,870.990	
BRANDYWINE REALTY TRUST	19,784	188,145.840	
SAUL CENTERS INC	1,591	67,712.960	
VERIS RESIDENTIAL INC	9,253	130,097.180	
CAMDEN PROPERTY TRUST	11,815	1,488,690.000	
COUSINS PROPERTIES INC	17,190	507,792.600	
SITE CENTERS CORP	20,756	260,280.240	
DUKE REALTY CORP	44,031	2,254,387.200	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,704	715,854.720	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,543	1,932,592.030	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15,063	706,454.700	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,180	778,408.800	
GETTY REALTY CORP	4,815	121,097.250	
WELLTOWER INC	50,323	3,897,516.350	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,350	1,461,484.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,127	407,952.280	
SERVICE PROPERTIES TRUST	19,087	106,314.590	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,058	424,744.200	
EQUITY COMMONWEALTH	13,075	356,947.500	
KILROY REALTY CORP	12,144	602,099.520	
LTC PROPERTIES INC	4,552	162,506.400	
LXP INDUSTRIAL TRUST	32,697	334,817.280	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,334	2,133,840.020	
MACERICH CO/THE	24,630	228,073.800	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,960	1,370,653.200	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,301	299,400.480	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20,305	804,687.150	

REALTY INCOME CORP	65,408	4,106,968.320	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12,986	333,480.480	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	7,636	2,214.440	
PUBLIC STORAGE	17,638	5,253,301.920	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,325	432,310.500	
REGENCY CENTERS CORP	17,815	1,008,329.000	
RPT REALTY	10,289	99,185.960	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12,022	174,920.100	
SL GREEN REALTY CORP	7,411	364,176.540	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29,173	53,678.320	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,682	58,654.260	
UDR INC	34,575	1,463,214.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,565	77,890.050	
WP CAREY INC	22,036	1,784,254.920	
WASHINGTON REIT	9,785	216,150.650	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,132	23,841.640	
AGREE REALTY CORP	8,241	552,147.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27,628	764,190.480	
CUBESMART	25,297	983,294.390	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25,358	262,201.720	
DIGITAL REALTY TRUST INC	32,809	4,087,017.130	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,501	37,509.990	
EXTRA SPACE STORAGE INC	15,480	2,457,295.200	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,032	40,400.640	
CENTERSPACE	1,734	133,760.760	
KITE REALTY GROUP TRUST	25,320	440,568.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	50,127.150	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	16,088	1,036,388.960	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,549	82,700.820	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24,350	216,228.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68,999	1,030,845.060	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	46,420.000	
DOUGLAS EMMETT INC	20,288	459,928.960	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	118,989.000	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95,400	65,349.000	
PRIME US REIT	68,400	47,538.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 113,621,423.030 (15,340,028,323)	



イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	347,117	230,485.680	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	71,016	62,281.030	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	51,354	40,877.780	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	100,969	81,683.920	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	64,471	61,054.030	
	REGIONAL REIT LTD	54,681	43,580.750	
	NEWRIVER REIT PLC	39,166	34,505.240	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	101,897	151,215.140	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73,284	58,700.480	
	CUSTODIAN REIT PLC	51,902	53,666.660	
	PRS REIT PLC/THE	64,664	69,061.150	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	45,413	55,403.860	
	LXI REIT PLC	109,114	155,596.560	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46,825	40,878.220	
	AEW UK REIT PLC	20,041	24,249.610	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	94,111	108,227.650	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	117,956	149,214.340	
	HOME REIT PLC	66,127	75,252.520	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	88,454	647,129.460	
	SEGREO PLC	141,566	1,351,672.160	
	HAMMERSON PLC	417,915	95,535.360	
	UNITE GROUP PLC/THE	46,990	497,624.100	
	BRITISH LAND CO PLC	110,429	559,433.310	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	29,888	185,305.600	
	DERWENT LONDON PLC	13,211	364,887.820	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	156,924	214,044.330		
WORKSPACE GROUP PLC	16,231	106,637.670		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	24,820	251,923.000		
SHAFTESBURY PLC	33,926	194,735.240		
BIG YELLOW GROUP PLC	20,359	254,487.500		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	115,214	265,453.050		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71,398	40,054.270		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	219,898	398,235.270		
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 6,923,092.760 (1,122,994,876)	
イスラエル・ シュケル			イスラエル・シュケル	

	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	243,797.700	
	REIT 1 LTD	25,897	458,376.900	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 702,174.600 (27,344,294)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	132,820	1,204,677.400	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33,012	51,498.720	
	HOME CONSORTIUM LTD	21,693	98,703.150	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46,291	38,190.070	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39,378	123,253.140	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	167,757	117,429.900	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65,291	191,302.630	
	RURAL FUNDS GROUP	45,313	121,891.970	
	WAYPOINT REIT	87,433	196,724.250	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	75,404	327,253.360	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	91,628.250	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	75,235	145,579.720	
	IRONGATE GROUP	65,105	123,048.450	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	176,023	219,148.630	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	137,848	365,297.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34,802	121,110.960	
	NATIONAL STORAGE REIT	133,591	287,220.650	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,502	70,495.320	
	GDI PROPERTY GROUP	64,299	61,727.040	
	SCENTRE GROUP	640,950	1,634,422.500	
	ARENA REIT	41,056	159,297.280	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22,847	73,110.400	
	BWP TRUST	58,372	214,808.960	
	GPT GROUP	236,551	984,052.160	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	64,281	244,267.800	
MIRVAC GROUP	486,873	998,089.650		
STOCKLAND	294,787	1,061,233.200		
ABACUS PROPERTY GROUP	45,390	122,553.000		
GOODMAN GROUP	209,940	3,760,025.400		
VICINITY CENTRES	477,829	833,811.600		

	CHARTER HALL GROUP	57,635	658,191.700	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	43,391	154,905.870	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 14,854,950.330 (1,382,995,876)	
カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,000	14,160.000	カナダ・ドル
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,600	16,836.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5,600	22,232.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3,600	36,792.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5,725	73,222.750	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	85,626.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,600	51,120.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,700	113,699.000	
	SLATE OFFICE REIT	4,900	22,883.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	38,500.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,000	158,340.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11,000	185,900.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,500	33,385.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,400	31,296.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,000	316,840.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,600	178,850.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,100	99,954.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13,000	185,250.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	19,800	271,062.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	40,800.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6,200	98,704.000	
	PLAZA RETAIL REIT	6,300	27,090.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8,800	239,096.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,500	463,890.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	17,100	216,657.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18,700	376,057.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,000	58,800.000		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,700	119,610.000		
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,100	96,075.000		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,700	265,958.000		

カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 3,938,684.750 (410,410,950)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	163,300	315,169.000
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153,800	43,833.000
	AIMS APAC REIT	57,800	78,030.000
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	355,300	454,784.000
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,400	52,456.000
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	203,200	159,512.000
	EC WORLD REIT	32,900	19,411.000
	IREIT GLOBAL	64,500	39,345.000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRUST	414,700	1,140,425.000
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	628,400	1,332,208.000
	SUNTEC REIT	265,600	438,240.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	390,100	631,962.000
	KEPPEL REIT	243,000	274,590.000
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	238,700	269,731.000
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	621,400	248,560.000
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	103,400	129,250.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	132,400	295,252.000
	STARHILL GLOBAL REIT	166,800	95,076.000
	CAPITALAND CHINA TRUST	133,900	151,307.000
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	45,900	220,320.000
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	236,700	572,814.000	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	267,200	470,272.000	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	124,300	79,552.000	
SPH REIT	113,000	106,220.000	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST I	284,100	109,378.500	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 7,727,697.500 (749,200,272)
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル
	ARGOSY PROPERTY LTD	107,307	126,085.720
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	199,256	189,293.200
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	54,226	145,596.810
GOODMAN PROPERTY TRUST	132,996	266,656.980	

	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	164,981	219,424.730	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 947,057.440 (79,505,472)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,541	101,173.480	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,766	22,498.840	
	HAMBORNER REIT AG	8,773	72,728.170	
	WERELDHAVE NV	4,993	70,201.580	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,386	716,151.000	
	NSI NV	2,198	75,940.900	
	VASTNED RETAIL NV	2,242	50,108.700	
	ICADE	3,682	173,643.120	
	CARMILA	5,596	74,874.480	
	ALTAREA	528	66,844.800	
	GECINA SA	6,251	598,220.700	
	KLEPIERRE	22,429	422,113.780	
	COVIVIO	5,437	308,277.900	
	MERCIALYS	6,169	50,184.810	
	AEDIFICA	4,175	396,207.500	
	COFINIMMO	3,389	381,601.400	
	BEFIMMO	2,813	132,211.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,935	72,788.000	
	RETAIL ESTATES	1,308	80,180.400	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,147	496,681.720	
	CARE PROPERTY INVEST	3,339	77,297.850	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,396	98,954.800	
	MONTEA NV	1,175	99,757.500	
	COIMA RES SPA	2,686	26,483.960	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	23,561.040	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,263	35,298.180		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	31,023	201,339.270		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	38,351	370,087.150		
CROMWELL REIT EUR	38,300	77,749.000		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	53,167	68,798.090		
HIBERNIA REIT PLC	76,097	121,603.000		
ユーロ 小計			ユーロ 5,563,562.120 (783,349,546)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	

	SK REITS LTD	7,476	50,238,720.000	
	D&D PLATFORM REIT LTD	6,865	35,698,000.000	
	JR GLOBAL	2,822	588,271.920	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7,432	58,712,800.000	
	LOTTE REIT CO LTD	15,417	92,347,830.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11,781	56,195,370.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3,918	22,724,400.000	
	JR REIT XXVII	14,711	80,910,500.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,393	33,868,040.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18,659	116,991,930.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 548,275,861.920 (57,349,655)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	289,000	884,340.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128,000	483,840.000	
	FORTUNE REIT	183,000	1,237,080.000	
	PROSPERITY REIT	156,000	413,400.000	
	LINK REIT	255,700	17,489,880.000	
	CHAMPION REIT	241,000	845,910.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 21,354,450.000 (367,296,540)	
投資証券 合計			20,320,475,804 [20,320,475,804]	
合計			21,069,223,421 [21,069,223,421]	

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 149銘柄	4.7%	95.3%	76.4%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.3%

イスラエル・シケル	投資証券	2銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	32銘柄	-%	100%	6.6%
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券	31銘柄	-%	100%	3.7%
韓国・ウォン	投資証券	10銘柄	-%	100%	0.3%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	-%	100%	1.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【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) 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6月16日から2022年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】



## 【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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6月15日現在	第6期 2022年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,133,780	8,434,244
親投資信託受益証券	3,226,545,186	3,453,951,613
未収入金	-	95,000
流動資産合計	3,233,678,966	3,462,480,857
資産合計	3,233,678,966	3,462,480,857
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	886,817	-
未払受託者報酬	298,073	410,244
未払委託者報酬	5,589,758	7,693,044
その他未払費用	74,441	102,482
流動負債合計	6,849,089	8,205,770
負債合計	6,849,089	8,205,770
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,226,129,492	1,234,388,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	962,700,385	1,110,390,892
（分配準備積立金）	725,475,939	609,795,846
元本等合計	3,226,829,877	3,454,275,087
純資産合計	3,226,829,877	3,454,275,087
負債純資産合計	3,233,678,966	3,462,480,857

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年6月16日 至 2021年6月15日	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		-
有価証券売買等損益		943,302,043		150,611,427
営業収益合計		943,302,045		150,611,427
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,061		1,316
受託者報酬		545,891		789,625
委託者報酬		10,237,191		14,807,019
その他費用		136,334		197,241
営業費用合計		10,920,477		15,795,201
<b>営業利益</b>		932,381,568		134,816,226
経常利益		932,381,568		134,816,226
<b>当期純利益</b>		932,381,568		134,816,226
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		61,055,677		80,039,513
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,846,185		962,700,385
剰余金増加額又は欠損金減少額		76,261,501		365,574,406
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		76,261,501		365,574,406
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,733,192		272,660,612
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,733,192		272,660,612
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		962,700,385		1,110,390,892

## (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6月16日	至 2022年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首元本額	2,067,091,677円	2,264,129,492円
期中追加設定元本額	758,967,899円	709,209,320円
期中一部解約元本額	561,930,084円	629,454,617円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,264,129,492口	2,343,884,195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6月16日 至 2021年6月15日	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(634,973,851円)、投資信託約款に規定される収益調整金(237,225,380円)及び分配準備積立金(90,502,088円)より分配対象額は962,701,319円(1万口当たり4,251.97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(54,777,132円)、投資信託約款に規定される収益調整金(500,596,184円)及び分配準備積立金(555,018,714円)より分配対象額は1,110,392,030円(1万口当たり4,737.40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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	897,728,280	83,216,347
合計	897,728,280	83,216,347

## （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6月15日現在	2022年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年6月16日
至 2022年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.4252円	1.4737円

(1万口当たり純資産額)	(14,252円)	(14,737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	1,136,729,180	3,453,951,613	
親投資信託受益証券 合計			3,453,951,613	
合計			3,453,951,613	

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6月15日現在	2022年6月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	108,984,909	64,421,750

コール・ローン	291,310,260	272,236,281
投資信託受益証券	389,119,381	1,003,957,474
投資証券	42,224,363,659	24,030,593,444
派生商品評価勘定	93,130,728	4,606,986
未収入金	2,179,419	5,244,903
未収配当金	61,033,920	57,254,896
差入委託証拠金	264,273,124	110,930,801
流動資産合計	43,434,395,400	25,549,246,535
資産合計	43,434,395,400	25,549,246,535
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	306,121	3,707,677
未払金	52,097,895	179,214,434
未払解約金	5,877,400	8,675,500
流動負債合計	58,281,416	191,597,611
負債合計	58,281,416	191,597,611
純資産の部		
元本等		
元本	1 14,827,050,251	8,345,562,785
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	28,549,063,733	17,012,086,139
元本等合計	43,376,113,984	25,357,648,924
純資産合計	43,376,113,984	25,357,648,924
負債純資産合計	43,434,395,400	25,549,246,535

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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



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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
1. 1 期首	2020年6月16日	2021年6月16日
期首元本額	11,968,050,382円	14,827,050,251円
期中追加設定元本額	4,938,340,057円	4,338,728,665円
期中一部解約元本額	2,079,340,188円	10,820,216,131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）	6,106,516,748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）	1,102,903,841円	1,136,729,180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）	333,772,518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）	280,439,993円	241,121,883円
D-I's グローバルREI Tインデックス	2,300,718円	1,675,380円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,865,686円	10,746,531円
iFree 外国REITイ ンデックス	434,510,780円	729,914,213円
iFree 8資産バランス	1,411,645,138円	1,582,219,772円

グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	175,971,248円	256,304,741円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	72,188,679円	150,433,938円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,906,413,027円	3,742,300,862円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,709,333円	6,607,695円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,182,980円	5,568,438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	330,548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)	218,996,022円	161,211,552円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	246,972,772円	248,229,351円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	56,274,115円	68,184,460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)	832,319,807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)	447,317,832円	3,984,241円
計	14,827,050,251円	8,345,562,785円
2. 期末日における受益権の総数	14,827,050,251口	8,345,562,785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6月16日 至 2022年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、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6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2021年6月15日現在	2022年6月15日現在
--	--------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	14,369,410	90,792,240
投資証券	7,406,728,672	5,575,385,632
合計	7,421,098,082	5,666,177,872

(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6月15日まで、及び2021年12月1日から2022年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 不動産投信関連

種 類	2021年6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	642,529,634	-	734,930,224	92,400,590	466,809,508	-	464,087,761	2,721,747
合計	642,529,634	-	734,930,224	92,400,590	466,809,508	-	464,087,761	2,721,747

(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6月15日 現在				2022年6月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	267,316,559	-	267,740,576	424,017	409,318,657	-	412,939,713	3,621,056
アメリカ・ドル	151,293,820	-	151,911,366	617,546	256,616,125	-	260,458,191	3,842,066
イギリス・ポンド	21,702,056	-	21,750,498	48,442	23,252,515	-	22,688,862	563,653
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	23,237,930	-	23,253,000	15,070
カナダ・ドル	8,163,810	-	8,158,563	5,247	9,622,440	-	9,367,443	254,997
ニュージーランド・ドル	5,571,377	-	5,502,749	68,628	-	-	-	-
ユーロ	74,946,816	-	74,744,320	202,496	96,589,647	-	97,172,217	582,570
香港・ドル	5,638,680	-	5,673,080	34,400	-	-	-	-
合計	267,316,559	-	267,740,576	424,017	409,318,657	-	412,939,713	3,621,056

## (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6月15日現在	2022年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.9255円	3.0385円
(1万口当たり純資産額)	(29,255円)	(30,385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	85,160.000	アメリカ・ドル 7,436,171.200	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 7,436,171.200 (1,003,957,474)	
投資信託受益証券 合計				1,003,957,474 [1,003,957,474]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18,096	アメリカ・ドル 348,348.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	15,182	226,363.620	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,700	243,350.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,241	3,563,240.790	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	45,189	4,361,190.390	
		BOSTON PROPERTIES INC	19,564	1,773,280.960	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20,988	122,989.680	
		VORNADO REALTY TRUST	21,821	631,936.160	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,878	223,662.740	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,300	515,280.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,126	190,654.740	
		EQUITY RESIDENTIAL	47,062	3,236,924.360	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	29,200	432,744.000	
		EPR PROPERTIES	10,284	447,971.040	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,900	101,868.000	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	68,760.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	14,233	186,879.290	
		EQUINIX INC	12,387	7,661,483.370	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,629	262,004.850	
		CHATHAM LODGING TRUST	6,665	73,115.050	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,600	605,872.000			
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,700	257,848.000			

COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,200	105,216.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	39,936.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	98,272	1,688,312.960	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40,673	1,339,768.620	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,000	341,460.000	
RLJ LODGING TRUST	22,921	268,404.910	
FARMLAND PARTNERS INC	3,900	54,054.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	30,300	501,465.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,300	118,761.000	
KIMCO REALTY CORP	84,828	1,628,697.600	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,300	89,806.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	30,395	822,488.700	
WHITESTONE REIT	6,400	68,160.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32,274	1,396,495.980	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,100	221,787.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	32,480	498,243.200	
INVITATION HOMES INC	82,143	2,762,469.090	
JBG SMITH PROPERTIES	15,732	364,195.800	
ALEXANDER & BALDWIN INC	10,000	182,100.000	
CLIPPER REALTY INC	1,890	14,288.400	
GLADSTONE LAND CORP	4,251	93,734.550	
AMERICOLD REALTY TRUST	36,695	1,061,953.300	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,000	125,010.000	
VICI PROPERTIES INC	115,665	3,253,656.450	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	33,136.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,589	410,150.920	
SAFEHOLD INC	1,957	67,633.920	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16,943	114,704.110	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16,743	336,199.440	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,750	84,787.500	
STORE CAPITAL CORP	33,770	837,158.300	
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	2,100	14,595.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	22,200	428,682.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,668	110,156.680	
LIFE STORAGE INC	11,313	1,158,677.460	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,274	209,491.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	30,319	637,002.190	

PARAMOUNT GROUP INC	22,593	164,477.040	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,500	130,455.000	
NETSTREIT CORP	5,500	103,400.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	21,601	851,943.440	
CTO REALTY GROWTH INC	860	49,467.200	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,079	1,279,036.470	
STAG INDUSTRIAL INC	24,266	737,929.060	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,500	26,190.000	
INDUS REALTY TRUST INC	861	49,705.530	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,300	32,936.000	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15,569	498,363.690	
ORION OFFICE REIT INC	7,823	90,668.570	
VENTAS INC	54,913	2,659,436.590	
CARETRUST REIT INC	13,304	222,043.760	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,500	247,000.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41,010	818,149.500	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,654	129,087.600	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31,443	413,161.020	
UMH PROPERTIES INC	6,244	106,085.560	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,600	86,580.000	
IRON MOUNTAIN INC	39,886	1,885,810.080	
TERRENO REALTY CORP	10,350	568,008.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,593	637,394.390	
SUN COMMUNITIES INC	15,994	2,415,733.760	
ACADIA REALTY TRUST	12,211	196,474.990	
ALEXANDER'S INC	300	65,100.000	
PROLOGIS INC	101,813	11,266,626.580	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,071	2,717,011.270	
BRANDYWINE REALTY TRUST	23,542	223,884.420	
SAUL CENTERS INC	1,800	76,608.000	
VERIS RESIDENTIAL INC	11,000	154,660.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,031	1,767,906.000	
COUSINS PROPERTIES INC	20,455	604,240.700	
SITE CENTERS CORP	24,678	309,462.120	
DUKE REALTY CORP	52,400	2,682,880.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,578	848,860.040	



ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,934	2,288,980.140	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,907	839,838.300	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,707	923,718.120	
GETTY REALTY CORP	5,403	135,885.450	
WELLTOWER INC	59,876	4,637,396.200	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	74,221	1,739,740.240	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,400	484,416.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	22,700	126,439.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20,259	504,449.100	
EQUITY COMMONWEALTH	15,575	425,197.500	
KILROY REALTY CORP	14,409	714,398.220	
LTC PROPERTIES INC	5,408	193,065.600	
LXP INDUSTRIAL TRUST	38,895	398,284.800	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,878	2,540,956.340	
MACERICH CO/THE	29,279	271,123.540	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,715	1,628,509.050	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,300	355,824.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,120	955,875.600	
REALTY INCOME CORP	77,825	4,886,631.750	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15,410	395,728.800	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,000	4,930.000	
PUBLIC STORAGE	20,956	6,241,535.040	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,764	513,938.160	
REGENCY CENTERS CORP	21,226	1,201,391.600	
RPT REALTY	11,600	111,824.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,316	208,297.800	
SL GREEN REALTY CORP	8,838	434,299.320	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32,900	60,536.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,100	65,313.000	
UDR INC	41,167	1,742,187.440	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,800	89,586.000	
WP CAREY INC	26,243	2,124,895.710	
WASHINGTON REIT	11,600	256,244.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	27,119.000	
AGREE REALTY CORP	9,800	656,600.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,906	910,179.960	
CUBESMART	30,158	1,172,241.460	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,126	311,502.840	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,096	4,870,188.720	

	CEDAR REALTY TRUST INC	1,700	42,483.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	18,429	2,925,419.460	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	45,841.500	
	CENTERSPACE	2,060	158,908.400	
	KITE REALTY GROUP TRUST	30,169	524,940.600	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	56,122.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,190	1,236,219.800	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,121	93,099.780	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28,942	257,004.960	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	82,122	1,226,902.680	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	52,420.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	24,186	548,296.620	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	247,362	144,706.770	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110,200	75,487.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	79,100	54,974.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 135,027,477.570 (18,230,059,747)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	407,270	270,427.280	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83,320	73,071.640	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,200	44,735.200	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118,460	95,834.140	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	75,640	71,631.080	
	REGIONAL REIT LTD	59,840	47,692.480	
	NEWRIVER REIT PLC	42,860	37,759.660	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	117,590	174,503.560	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85,980	68,869.980	
	CUSTODIAN REIT PLC	60,900	62,970.600	
	PRS REIT PLC/THE	75,872	81,031.290	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,280	65,001.600	
	LXI REIT PLC	125,918	179,559.060	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,240	44,732.520	
	AEW UK REIT PLC	21,930	26,535.300	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	110,420	126,983.000	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	136,123	172,195.590	
	HOME REIT PLC	77,587	88,294.000	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	105,957	775,181.410	
	SEGR0 PLC	170,889	1,631,648.170	
	HAMMERSON PLC	482,269	110,246.690	
	UNITE GROUP PLC/THE	56,290	596,111.100	
	BRITISH LAND CO PLC	132,280	670,130.480	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	35,071	217,440.200	
	DERWENT LONDON PLC	15,830	437,224.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	184,120	251,139.680	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,759	136,386.630	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	29,124	295,608.600	
	SHAFTESBURY PLC	39,800	228,452.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,890	298,625.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135,177	311,447.800	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78,138	43,835.410	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	263,418	477,049.990	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 8,212,355.740 (1,332,126,225)	
イスラエル・ シュケル			イスラエル・シュケル	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31,070	283,700.170	
	REIT 1 LTD	26,100	461,970.000	
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 745,670.170 (29,038,112)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	155,650	1,411,745.500	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38,400	59,904.000	
	HOME CONSORTIUM LTD	25,790	117,344.500	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	44,467.500	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46,820	146,546.600	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	199,444	139,610.800	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	76,000	222,680.000	
	RURAL FUNDS GROUP	53,875	144,923.750	
	WAYPOINT REIT	101,781	229,007.250	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	86,122	373,769.480	
	CENTURIA OFFICE REIT	62,250	108,937.500	

	CENTURIA CAPITAL GROUP	89,450	173,085.750	
	IRONGATE GROUP	77,400	146,286.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	204,898	255,098.010	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165,430	438,389.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41,377	143,991.960	
	NATIONAL STORAGE REIT	152,575	328,036.250	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31,510	83,816.600	
	GDI PROPERTY GROUP	71,460	68,601.600	
	SCENTRE GROUP	760,116	1,938,295.800	
	ARENA REIT	48,810	189,382.800	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27,160	86,912.000	
	BWP TRUST	67,951	250,059.680	
	GPT GROUP	277,210	1,153,193.600	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	73,410	278,958.000	
	MIRVAC GROUP	570,551	1,169,629.550	
	STOCKLAND	350,431	1,261,551.600	
	ABACUS PROPERTY GROUP	53,960	145,692.000	
	GOODMAN GROUP	248,100	4,443,471.000	
	VICINITY CENTRES	556,686	971,417.070	
	CHARTER HALL GROUP	68,052	777,153.840	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	51,590	184,176.300	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 17,486,135.790 (1,627,959,242)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	16,284.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	18,666.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	24,614.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,300	43,946.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6,741	86,217.390	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,400	101,304.000	
	SLATE GROCERY REIT	4,000	56,800.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,000	135,760.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	23,817.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,800	43,120.000	

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,500	188,790.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,200	206,180.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	37,027.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,700	35,208.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,500	356,445.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16,200	198,450.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9,700	119,698.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15,200	216,600.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	22,600	309,394.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,700	45,900.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,400	117,808.000	
	PLAZA RETAIL REIT	7,000	30,100.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,000	271,700.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,000	530,160.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19,966	252,969.220	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,400	430,354.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	64,680.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	141,760.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,200	113,400.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800	303,952.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 4,521,103.610 (471,098,996)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	186,483	359,912.190	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170,976	48,728.160	
	AIMS APAC REIT	64,300	86,805.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	411,290	526,451.200	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73,800	58,302.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,440	206,015.400	
	EC WORLD REIT	36,500	21,535.000	
	IREIT GLOBAL	71,624	43,690.640	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	483,177	1,328,736.750	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	732,122	1,552,098.640	
	SUNTEC REIT	307,400	507,210.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	460,600	746,172.000	
	KEPPEL REIT	277,600	313,688.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	272,656	308,101.280	

	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	730,702	292,280.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	127,700	159,625.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	151,176	337,122.480	
	STARHILL GLOBAL REIT	198,400	113,088.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	159,142	179,830.460	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	54,600	262,080.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	285,969	692,044.980	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	309,284	544,339.840	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147,800	94,592.000	
	SPH REIT	134,400	126,336.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337,763	130,038.750	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 9,038,824.570 (876,314,042)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	ARGOSY PROPERTY LTD	119,250	140,118.750	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	221,440	210,368.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,260	161,798.100	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	147,800	296,339.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	183,350	243,855.500	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,052,479.350 (88,355,641)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,057	112,669.960	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	23,186.800	
	HAMBORNER REIT AG	9,070	75,190.300	
	WERELDHAVE NV	5,160	72,549.600	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,315	819,352.500	
	NSI NV	2,271	78,463.050	
	VASTNED RETAIL NV	2,320	51,852.000	
	ICADE	4,098	193,261.680	
	CARMILA	5,780	77,336.400	
	ALTAREA	550	69,630.000	
	GECINA SA	7,153	684,542.100	
	KLEPIERRE	25,657	482,864.740	
	COVIVIO	6,222	352,787.400	
	MERCIALYS	6,370	51,819.950	

	AEDIFICA	4,776	453,242.400	
	COFINIMMO	3,882	437,113.200	
	BEFIMMO	3,130	147,110.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,030	75,144.000	
	RETAIL ESTATES	1,457	89,314.100	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,468	568,075.680	
	CARE PROPERTY INVEST	3,450	79,867.500	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,670	110,271.000	
	MONTEA NV	1,310	111,219.000	
	COIMA RES SPA	2,770	27,312.200	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	24,358.950	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,500	36,450.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,559	224,287.910	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	43,870	423,345.500	
	CROMWELL REIT EUR	43,520	88,345.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54,940	71,092.360	
	HIBERNIA REIT PLC	84,780	135,478.440	
ユーロ 小計			ユーロ 6,247,534.320 (879,652,832)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	8,700	韓国・ウォン 58,464,000.000	
	D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	41,600,000.000	
	JR GLOBAL	3,137	653,936.580	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,260	65,254,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	17,135	102,638,650.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13,090	62,439,300.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	32,480,000.000	
	JR REIT XXVII	16,350	89,925,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	37,617,200.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20,740	130,039,800.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 621,111,886.580 (64,968,303)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321,000	香港・ドル 982,260.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142,000	536,760.000	
	FORTUNE REIT	203,000	1,372,280.000	
	PROSPERITY REIT	174,000	461,100.000	
	LINK REIT	303,600	20,766,240.000	

	CHAMPION REIT	268,000	940,680.000	
	香港・ドル 小計		香港・ドル 25,059,320.000 (431,020,304)	
投資証券	合計		24,030,593,444 [24,030,593,444]	
合計			25,034,550,918 [25,034,550,918]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 150銘柄	5.2%	94.8%	76.8%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.3%
イスラエル・シェケル	投資証券 2銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 32銘柄	-%	100%	6.5%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 31銘柄	-%	100%	3.5%
韓国・ウォン	投資証券 10銘柄	-%	100%	0.3%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.7%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。





**【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2022年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	35,012,085
親投資信託受益証券	15,960,839,648
未収入金	8,300,000
流動資産合計	16,004,151,733
<b>資産合計</b>	
16,004,151,733	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	15,294,317
未払受託者報酬	1,704,970
未払委託者報酬	24,722,649
その他未払費用	426,166
流動負債合計	42,148,102
<b>負債合計</b>	
42,148,102	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,611,388,166
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,350,615,465
（分配準備積立金）	1,888,991,330
元本等合計	15,962,003,631
<b>純資産合計</b>	
15,962,003,631	
<b>負債純資産合計</b>	16,004,151,733

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
受取利息	3
有価証券売買等損益	1,140,028,067
営業収益合計	1,140,028,070
営業費用	
支払利息	5,841
受託者報酬	1,704,970
委託者報酬	24,722,649
その他費用	426,166
営業費用合計	26,859,626
営業利益	1,113,168,444
経常利益	1,113,168,444
中間純利益	1,113,168,444
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	70,786,085
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,141,570,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	706,934,191
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	706,934,191
剰余金減少額又は欠損金増加額	540,271,135
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	540,271,135
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,350,615,465

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	9,440,492,072円
期中追加設定元本額	1,156,365,075円
期中一部解約元本額	985,468,981円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	9,611,388,166口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6607円 (16,607円)

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,668,116,090
株式	2 3 201,474,077,420
派生商品評価勘定	25,576,300
未収配当金	29,061,170
未収利息	329,979

その他未収収益	4	4,016,798
流動資産合計		212,201,177,757
資産合計		212,201,177,757
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		334,400
前受金		30,250,000
未払解約金		77,241,150
受入担保金		7,750,410,885
流動負債合計		7,858,236,435
負債合計		7,858,236,435
純資産の部		
元本等		
元本	1	147,943,244,024
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		56,399,697,298
元本等合計		204,342,941,322
純資産合計		204,342,941,322
負債純資産合計		212,201,177,757

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	144,235,597,142円
期中追加設定元本額	10,080,731,810円
期中一部解約元本額	6,373,084,928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	2,868,949,682円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	4,766,704,801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	917,527円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	268,786,587円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	565,944,626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)	473,487,596円



D - I ' s T O P I Xイン デックス	29,458,378円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	224,512,137円
i F r e e T O P I Xイン デックス	6,263,908,766円
i F r e e 8資産バランス	4,269,604,444円
i F r e e 年金バランス	795,274,227円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	69,156,106,443円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,295,345,245円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,747,389,276円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,674,145,045円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,697,152,918円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	57,539,012円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	70,743,973円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	2,726,927,024円
ダイワつみたてインデックス バランス30	11,751,428円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,389,851円
ダイワつみたてインデックス バランス70	26,197,857円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	2,162,123,997円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	77,693,100円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	34,559,946円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,041,330,410円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	454,758,876円

	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)		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)		104,389,988円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド		200,792,157円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス		11,555,777,330円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		2,005,540,911円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス		3,203,014,936円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX		1,199,899,246円
	ダイワライフスタイル25		134,288,281円
	ダイワライフスタイル50		550,914,553円
	ダイワライフスタイル75		419,769,904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)		8,692,304,746円
	計		147,943,244,024円
2.	期末日における受益権の総数		147,943,244,024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 7,416,598,340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 894,610,000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3,594,860円が 含まれております。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2022年12月15日現在
----	---------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	2,767,820,000	-	2,793,140,000	25,320,000
合計	2,767,820,000	-	2,793,140,000	25,320,000

（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）

	2022年12月15日現在
--	---------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3812円 (13,812円)
---------------------------	----------------------

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		36,347,331
親投資信託受益証券		15,922,401,196
流動資産合計		15,958,748,527
資産合計		15,958,748,527
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		6,903,858
未払受託者報酬		1,696,896
未払委託者報酬		24,605,623
その他未払費用		424,143
流動負債合計		33,630,520
負債合計		33,630,520
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		18,569,026,977
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		7,356,091,030
(分配準備積立金)		2,761,499,774
元本等合計		15,925,118,007
純資産合計		15,925,118,007
負債純資産合計		15,958,748,527

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	97
有価証券売買等損益	1,109,184,241
営業収益合計	1,109,184,338
<b>営業費用</b>	
支払利息	7,582
受託者報酬	1,696,896
委託者報酬	24,605,623
その他費用	424,143
営業費用合計	26,734,244
営業利益又は営業損失（ ）	1,082,450,094
経常利益又は経常損失（ ）	1,082,450,094
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,082,450,094
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	64,126,651
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,098,752,418
剰余金増加額又は欠損金減少額	867,917,596
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	867,917,596
剰余金減少額又は欠損金増加額	628,902,427
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	628,902,427
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,356,091,030

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	8,353,925,182円
期中追加設定元本額	1,071,796,232円
期中一部解約元本額	856,694,437円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	8,569,026,977口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。



## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8585円 (18,585円)

## (参考)

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

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

## 「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,038,540,888
株式	23 225,278,652,500
派生商品評価勘定	25,381,450
未収入金	1,341,300
未収利息	154,785

その他未収収益		124,651
流動資産合計		235,344,195,574
資産合計		235,344,195,574
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,924,650
前受金		54,370,000
未払解約金		630,069,000
受入担保金		3,130,191,750
流動負債合計		3,816,555,400
負債合計		3,816,555,400
純資産の部		
元本等		
元本	1	61,716,373,363
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		169,811,266,811
元本等合計		231,527,640,174
純資産合計		231,527,640,174
負債純資産合計		235,344,195,574

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	60,104,604,144円
期中追加設定元本額	11,451,925,003円
期中一部解約元本額	9,840,155,784円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファ ンド225	25,801,253,975円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	259,563,333円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	7,901,255,792円
D-I's 日経225イン デックス	70,977,882円
iFree 日経225イン デックス	10,326,380,425円
DC・ダイワ・ストックイン デックス225(確定拠出年 金専用ファンド)	5,575,078,701円
ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	472,339,091円
ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	4,244,275,942円
ダイワ日経225インデック ス(ダイワSMA専用)	870,388,142円
ダイワ・インデックスセレク ト 日経225	6,194,860,080円
計	61,716,373,363円

2.	期末日における受益権の総数		61,716,373,363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	2,970,699,900円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。	
		株式	3,794,750,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	6,239,460,000	-	6,263,040,000	23,580,000

合計	6,239,460,000	-	6,263,040,000	23,580,000

(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)

	2022年12月15日現在
1口当たり純資産額	3.7515円
(1万口当たり純資産額)	(37,515円)

**【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		198,966,096
親投資信託受益証券		62,457,464,180
流動資産合計		62,656,430,276
資産合計		62,656,430,276
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		56,857,069
未払受託者報酬		6,509,489
未払委託者報酬		125,308,642
その他未払費用		1,100,934
流動負債合計		189,776,134
負債合計		189,776,134
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		38,205,263,398
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		24,261,390,744
(分配準備積立金)		11,773,650,578
元本等合計		62,466,654,142
純資産合計		62,466,654,142
負債純資産合計		62,656,430,276

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	3,125,578,383
営業収益合計	3,125,578,384
営業費用	
支払利息	28,458
受託者報酬	6,509,489
委託者報酬	125,308,642
その他費用	1,100,934
営業費用合計	132,947,523
営業利益	2,992,630,861
経常利益	2,992,630,861
中間純利益	2,992,630,861
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	159,745,500
期首剰余金又は期首欠損金( )	19,149,754,424
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,026,871,236
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,026,871,236
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,748,120,277
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,748,120,277
中間剰余金又は中間欠損金( )	24,261,390,744



## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	34,566,355,532円
期中追加設定元本額	6,769,495,233円
期中一部解約元本額	3,130,587,367円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	38,205,263,398口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6350円 (16,350円)

## (参考)

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

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

## 「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	401,902,112
コール・ローン	2,719,668,878
株式	73,075,544,109
投資証券	1,809,194,203
派生商品評価勘定	639,222,827

未収入金		170,504
未収配当金		85,995,928
差入委託証拠金		1,581,192,960
流動資産合計		80,312,891,521
資産合計		80,312,891,521
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		196,987,588
未払金		9,172,841
未払解約金		160,020
流動負債合計		206,320,449
負債合計		206,320,449
純資産の部		
元本等		
元本	1	31,443,732,583
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		48,662,838,489
元本等合計		80,106,571,072
純資産合計		80,106,571,072
負債純資産合計		80,312,891,521

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	30,012,407,804円
期中追加設定元本額	4,744,814,201円
期中一部解約元本額	3,313,489,422円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	24,516,197,276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）	1,785,447,391円
iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	2,726,987,498円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	360,348円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	2,414,740,070円
計	31,443,732,583円
2. 期末日における受益権の総数	31,443,732,583口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
-----	---------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	3,608,237,160	-	3,618,980,695	10,743,535
合計	3,608,237,160	-	3,618,980,695	10,743,535

#### （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

#### 2. 通貨関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	77,064,908,552	-	76,633,416,848	431,491,704
アメリカ・ドル	56,055,906,525	-	55,493,485,714	562,420,811
イギリス・ポンド	3,564,736,625	-	3,623,237,452	58,500,827
イスラエル・シケル	123,276,258	-	122,488,455	787,803
オーストラリア・ドル	1,891,293,653	-	1,889,982,134	1,311,519
カナダ・ドル	2,971,621,781	-	2,915,469,719	56,152,062
シンガポール・ドル	330,450,012	-	329,673,690	776,322
スイス・フラン	2,334,955,766	-	2,354,922,714	19,966,948
スウェーデン・クローナ	819,379,389	-	835,861,869	16,482,480
デンマーク・クローネ	671,346,336	-	679,603,059	8,256,723
ニュージーランド・ドル	47,272,313	-	47,894,754	622,441
ノルウェー・クローネ	191,619,202	-	191,540,585	78,617
ユーロ	7,434,307,670	-	7,526,401,964	92,094,294
香港・ドル	628,743,022	-	622,854,739	5,888,283
合計	77,064,908,552	-	76,633,416,848	431,491,704

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	2.5476円
(1万口当たり純資産額)	(25,476円)



**【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		34,564,351
親投資信託受益証券		13,091,843,348
流動資産合計		13,126,407,699
資産合計		13,126,407,699
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		5,053,244
未払受託者報酬		1,374,145
未払委託者報酬		26,452,899
その他未払費用		343,458
流動負債合計		33,223,746
負債合計		33,223,746
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		5,550,264,538
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		7,542,919,415
(分配準備積立金)		1,935,372,933
元本等合計		13,093,183,953
純資産合計		13,093,183,953
負債純資産合計		13,126,407,699

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	973,651,406
営業収益合計	973,651,406
営業費用	
支払利息	5,317
受託者報酬	1,374,145
委託者報酬	26,452,899
その他費用	343,458
営業費用合計	28,175,819
営業利益	945,475,587
経常利益	945,475,587
中間純利益	945,475,587
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	115,220,992
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,863,208,750
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,655,862,037
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,655,862,037
剰余金減少額又は欠損金増加額	806,405,967
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	806,405,967
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,542,919,415

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	4,981,572,692円
期中追加設定元本額	1,244,095,129円
期中一部解約元本額	675,403,283円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	5,550,264,538口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2,359,000円 (23,590円)

（参考）

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	756,736,556
コール・ローン	8,923,087,308
株式	275,606,812,246
投資証券	6,795,381,557
派生商品評価勘定	83,428,734

未収入金		652,743
未収配当金		332,495,272
差入委託証拠金		5,099,079,469
流動資産合計		297,597,673,885
資産合計		297,597,673,885
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		72,914,927
未払解約金		27,796,300
流動負債合計		100,711,227
負債合計		100,711,227
純資産の部		
元本等		
元本	1	69,448,079,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		228,048,882,953
元本等合計		297,496,962,658
純資産合計		297,496,962,658
負債純資産合計		297,597,673,885

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	65,283,819,354円
期中追加設定元本額	6,932,955,460円
期中一部解約元本額	2,768,695,109円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックス V A	301,128,157円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	36,734,762円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	179,363,294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)	69,298,618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)	522,933,980円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	3,056,199,862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)	641,813,574円
D-I's 外国株式インデッ クス	18,431,520円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	48,085,035円



i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	5,947,731,832円
i F r e e 8資産バランス	1,362,304,932円
i F r e e 年金バランス	254,030,959円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	43,908,674,447円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	524,630,505円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	1,005,136,860円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	828,038,320円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,898,644,444円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,200,370円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	12,252,667円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	1,391,353,679円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	1,875,196円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	2,214,762円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	4,614,179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)	4,349,417円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	75,082,129円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	55,630,821円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	1,203,874,057円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A(適格機関投資家専 用)	62,417,353円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	171,714,594円

ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,156,769,726円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	427,180,785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)	1,278,958,175円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,887,470,789円
ダイワライフスタイル25	10,487,092円
ダイワライフスタイル50	43,398,957円
ダイワライフスタイル75	33,119,707円
計	69,448,079,705円
2. 期末日における受益権の総数	69,448,079,705口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				

株価指数 先物取引				
買 建	15,176,115,787	-	15,222,974,694	46,858,907
合計	15,176,115,787	-	15,222,974,694	46,858,907

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種 類	2022年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	9,234,066,620	-	9,197,721,520	36,345,100
アメリカ・ドル	5,858,680,550	-	5,803,826,100	54,854,450
イギリス・ポンド	595,468,150	-	604,272,960	8,804,810
オーストラリア・ドル	333,911,220	-	334,125,720	214,500
カナダ・ドル	578,968,940	-	568,362,390	10,606,550
スイス・フラン	595,958,400	-	601,108,380	5,149,980
ユーロ	1,271,079,360	-	1,286,025,970	14,946,610
合計	9,234,066,620	-	9,197,721,520	36,345,100

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	4.2837円
(1万口当たり純資産額)	(42,837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）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 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）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2022年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	29,633,559
親投資信託受益証券	2,799,084,065
未収入金	2,190,000
流動資産合計	2,830,907,624
資産合計	2,830,907,624
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	2,844,409
未払受託者報酬	302,411
未払委託者報酬	5,973,622
その他未払費用	75,520
流動負債合計	9,195,962
負債合計	9,195,962
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,291,451,372
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,530,260,290
（分配準備積立金）	617,228,460
元本等合計	2,821,711,662
純資産合計	2,821,711,662
負債純資産合計	2,830,907,624

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	175,553,187
営業収益合計	175,553,189
営業費用	
支払利息	5,970
受託者報酬	302,411
委託者報酬	5,973,622
その他費用	75,520
営業費用合計	6,357,523
営業利益	169,195,666
経常利益	169,195,666
中間純利益	169,195,666
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	15,628,041
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,335,340,057
剰余金増加額又は欠損金減少額	184,501,726
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	184,501,726
剰余金減少額又は欠損金増加額	143,149,118
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	143,149,118
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,530,260,290

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,270,536,081円
期中追加設定元本額	156,407,427円
期中一部解約元本額	135,492,136円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,291,451,372口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。



## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1849円 (21,849円)

## （参考）

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

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

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「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）」に記載のとおりであります。

## 「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

	2022年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	

預金		625,815,804
コール・ローン		791,242,298
株式		19,009,302,036
投資証券		2,095,997,532
派生商品評価勘定		17,697,082
未収配当金		90,495,244
差入委託証拠金		618,371,755
流動資産合計		23,248,921,751
資産合計		23,248,921,751
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,596,968
流動負債合計		5,596,968
負債合計		5,596,968
純資産の部		
元本等		
元本	1	12,001,946,718
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,241,378,065
元本等合計		23,243,324,783
純資産合計		23,243,324,783
負債純資産合計		23,248,921,751

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

#### (3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2022年6月16日 10,444,109,018円 1,787,399,123円 229,561,423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） 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）	63,532,658円 288,645,965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）	354,246,223円
D - I ' s 新興国株式イン デックス	134,029,023円
i F r e e 新興国株式イン デックス	4,811,593,083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）	3,027,797,087円 5,773,039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）	1,478,836,918円
D Cダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	1,389,477,952円
ダイワ・インデックスセレクト ト 新興国株式	350,699,207円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	97,315,563円
計	12,001,946,718円
2. 期末日における受益権の総数	12,001,946,718口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 株式関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,892,618,343	-	1,909,726,757	17,108,414
合計	1,892,618,343	-	1,909,726,757	17,108,414

#### （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	833,137,699	-	833,726,367	588,668
アメリカ・ドル	833,137,699	-	833,726,367	588,668

合計	833,137,699	-	833,726,367	588,668
----	-------------	---	-------------	---------

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	1.9366円
(1万口当たり純資産額)	(19,366円)

**【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。



## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		86,882,093
親投資信託受益証券		35,637,241,923
流動資産合計		35,724,124,016
資産合計		35,724,124,016
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		23,097,998
未払受託者報酬		2,014,013
未払委託者報酬		25,175,712
その他未払費用		1,006,942
流動負債合計		51,294,665
負債合計		51,294,665
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1	37,257,211,731
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	1,584,382,380
（分配準備積立金）		280,758,872
元本等合計		35,672,829,351
純資産合計		35,672,829,351
負債純資産合計		35,724,124,016

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	15
有価証券売買等損益	235,001,562
営業収益合計	235,001,547
<b>営業費用</b>	
支払利息	15,817
受託者報酬	2,014,013
委託者報酬	25,175,712
その他費用	1,006,942
営業費用合計	28,212,484
営業利益又は営業損失（ ）	263,214,031
経常利益又は経常損失（ ）	263,214,031
中間純利益又は中間純損失（ ）	263,214,031
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,730,696
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,354,687,620
剰余金増加額又は欠損金減少額	153,463,487
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	153,463,487
剰余金減少額又は欠損金増加額	123,674,912
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	123,674,912
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,584,382,380

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 2022年6月16日	至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	38,196,306,569円
期中追加設定元本額	3,400,173,262円
期中一部解約元本額	4,339,268,100円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	37,257,211,731口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,584,382,380円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9575円 (9,575円)

（参考）

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月15日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	255,810,451
国債証券	105,471,713,880

地方債証券		2,911,945,500
特殊債券		2,017,610,200
社債券		2,780,911,400
未収利息		241,726,340
前払費用		5,571,144
流動資産合計		113,685,288,915
資産合計		113,685,288,915
負債の部		
流動負債		
未払解約金		74,451,708
流動負債合計		74,451,708
負債合計		74,451,708
純資産の部		
元本等		
元本	1	83,335,918,616
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,274,918,591
元本等合計		113,610,837,207
純資産合計		113,610,837,207
負債純資産合計		113,685,288,915

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	73,960,042,577円
期中追加設定元本額	16,714,991,030円
期中一部解約元本額	7,339,114,991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)	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)	270,434,396円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	46,312,087円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	568,218,859円
DCダイワ日本債券インデッ クス	10,350,003,479円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	1,741,661,789円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,916,160,136円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,534,699,741円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	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)	241,971,948円
ダイワ・ノーロード 日本債 券ファンド	63,352,255円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	26,140,425,382円

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	22,772,520,859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	2,094,273,911円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	866,908,135円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,364,662,671円
ダイワライフスタイル25	432,831,898円
ダイワライフスタイル50	549,014,545円
ダイワライフスタイル75	139,716,194円
計	83,335,918,616円
2. 期末日における受益権の総数	83,335,918,616口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2022年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.3633円
(1万口当たり純資産額)	(13,633円)





**【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		585,609,335
親投資信託受益証券		98,395,013,570
流動資産合計		98,980,622,905
資産合計		98,980,622,905
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		83,907,502
未払受託者報酬		10,962,570
未払委託者報酬		197,327,054
その他未払費用		1,077,161
流動負債合計		293,274,287
負債合計		293,274,287
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1	113,383,125,332
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	14,695,776,714
（分配準備積立金）		3,485,842,366
元本等合計		98,687,348,618
純資産合計		98,687,348,618
負債純資産合計		98,980,622,905

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	31
有価証券売買等損益	727,313,689
営業収益合計	727,313,658
<b>営業費用</b>	
支払利息	102,804
受託者報酬	10,962,570
委託者報酬	197,327,054
その他費用	1,077,161
営業費用合計	209,469,589
営業利益又は営業損失（ ）	936,783,247
経常利益又は経常損失（ ）	936,783,247
中間純利益又は中間純損失（ ）	936,783,247
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	10,707,412
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,467,784,787
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,378,031,022
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,378,031,022
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,679,947,114
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,679,947,114
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	14,695,776,714

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2022年6月16日	2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。  時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	110,985,788,072円
期中追加設定元本額	13,796,216,596円
期中一部解約元本額	11,398,879,336円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	113,383,125,332口
3. 2 元本の欠損	中間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14,695,776,714円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8704円 (8,704円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月15日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	729,883,156
コール・ローン	1,660,485,420

国債証券		116,420,988,602
派生商品評価勘定		1,837,945,307
未収入金		44,531,377
未収利息		757,656,345
前払費用		64,489,956
差入委託証拠金		283,636,576
流動資産合計		121,799,616,739
資産合計		121,799,616,739
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		420,057,760
流動負債合計		420,057,760
負債合計		420,057,760
純資産の部		
元本等		
元本	1	135,968,059,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	14,588,500,451
元本等合計		121,379,558,979
純資産合計		121,379,558,979
負債純資産合計		121,799,616,739

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	133,574,429,591円
期中追加設定元本額	17,028,890,073円
期中一部解約元本額	14,635,260,234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	110,221,814,238円
債券インデックス（為替ヘッ	
ジあり）	
ダイワファンドラップオンラ	4,253,418,038円
イン 外国債券インデックス	
（為替ヘッジあり）	

	ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	3,745,315円
	ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	3,345,589,597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）	18,143,492,242円
	計	135,968,059,430円
2.	期末日における受益権の総数	135,968,059,430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14,588,500,451円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種 類	2022年12月15日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引		うち 1年超	



債券先物取引				
買 建	1,861,057,558	-	1,879,284,887	18,227,329
合計	1,861,057,558	-	1,879,284,887	18,227,329

(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。

2. 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。
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12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	119,994,502,639	-	118,594,842,421	1,399,660,218
アメリカ・ドル	59,389,510,464	-	57,753,278,453	1,636,232,011
イギリス・ポンド	6,036,173,188	-	6,120,908,755	84,735,567
イスラエル・シユケル	500,840,747	-	493,253,475	7,587,272
オーストラリア・ドル	2,040,541,832	-	2,034,090,351	6,451,481
オフショア・人民元	4,488,406,256	-	4,443,487,254	44,919,002
カナダ・ドル	2,601,078,168	-	2,532,910,195	68,167,973
シンガポール・ドル	427,214,570	-	422,683,826	4,530,744
スウェーデン・クローナ	336,490,709	-	343,283,475	6,792,766

デンマーク ・クローネ	510,759,725	-	514,624,762	3,865,037
ニュージー ランド・ドル	261,700,281	-	264,823,968	3,123,687
ノルウェー・ クローネ	291,657,543	-	290,602,974	1,054,569
ポーランド・ ズロチ	627,039,874	-	635,123,341	8,083,467
マレーシア・ リングギット	721,109,640	-	715,080,120	6,029,520
メキシコ・ペ ソ	1,162,598,115	-	1,118,234,743	44,363,372
ユーロ	40,599,381,527	-	40,912,456,729	313,075,202
合計	119,994,502,639	-	118,594,842,421	1,399,660,218

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	0.8927円
(1万口当たり純資産額)	(8,927円)



**【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		45,991,177
親投資信託受益証券		8,588,615,224
流動資産合計		8,634,606,401
資産合計		8,634,606,401
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		2,854,429
未払受託者報酬		907,843
未払委託者報酬		16,341,863
その他未払費用		340,371
流動負債合計		20,444,506
負債合計		20,444,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		7,041,324,419
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,572,837,476
(分配準備積立金)		370,243,760
元本等合計		8,614,161,895
純資産合計		8,614,161,895
負債純資産合計		8,634,606,401

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	139,460,561
営業収益合計	139,460,563
営業費用	
支払利息	8,270
受託者報酬	907,843
委託者報酬	16,341,863
その他費用	340,371
営業費用合計	17,598,347
営業利益	121,862,216
経常利益	121,862,216
中間純利益	121,862,216
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	16,137,113
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,283,536,886
剰余金増加額又は欠損金減少額	289,080,484
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	289,080,484
剰余金減少額又は欠損金増加額	105,504,997
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	105,504,997
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,572,837,476

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	6,337,300,973円
期中追加設定元本額	1,216,817,866円
期中一部解約元本額	512,794,420円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	7,041,324,419口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2234円 (12,234円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,223,358,399
コール・ローン	1,086,337,276
国債証券	237,728,287,647
派生商品評価勘定	3,682,309
未収入金	193,503



未収利息		1,414,329,627
前払費用		65,033,191
流動資産合計		241,521,221,952
資産合計		241,521,221,952
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		9,494,829
未払金		3,759,734
未払解約金		115,558,395
流動負債合計		128,812,958
負債合計		128,812,958
純資産の部		
元本等		
元本	1	76,387,675,693
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		165,004,733,301
元本等合計		241,392,408,994
純資産合計		241,392,408,994
負債純資産合計		241,521,221,952

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>2022年6月16日</p> <p>75,409,227,916円</p> <p>4,644,812,912円</p> <p>3,666,365,135円</p>
<p>期末元本額の内訳</p> <p>ファンド名</p> <p>ダイワ外国債券インデックス V A</p> <p>ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p> <p>ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)</p> <p>ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)</p>	<p>444,538,723円</p> <p>9,071,985円</p> <p>50,091,127円</p> <p>19,793,735円</p>

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	244,218,374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)	356,097,659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)	597,663,829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)	2,717,830,203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)	613,332,271円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,260,819円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	12,929,401円
iFree 外国債券イン デックス	2,021,881,897円
iFree 8資産バランス	1,857,736,632円
iFree 年金バランス	345,764,891円
DCダイワ外国債券インデッ クス	50,549,552,926円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,065,124,089円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	679,953,448円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	451,284,039円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	638,267,038円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	502,045,408円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	192,980,808円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	32,167,746円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	14,083,084円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	1,387,456,076円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,873,500円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,503,887円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,558,903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)	181,835,929円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	119,575,140円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	37,971,006円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,279,540,906円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	199,538,920円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	150,697,545円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	48,771,009円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	1,744,667,921円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,709,978,028円
ダイワライフスタイル25	28,448,488円
ダイワライフスタイル50	58,633,583円
ダイワライフスタイル75	14,954,720円
計	76,387,675,693円
2. 期末日における受益権の総数	76,387,675,693口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2022年12月15日現在
----	---------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	995,753,583	-	989,941,063	5,812,520
アメリカ・ドル	232,751,982	-	229,755,532	2,996,450
イギリス・ポンド	9,630,755	-	9,736,512	105,757
オフショア・人民元	95,757,698	-	94,799,376	958,322
カナダ・ドル	88,626,862	-	86,261,952	2,364,910
シンガポール・ドル	55,212,696	-	54,627,148	585,548
メキシコ・ペソ	67,791,720	-	65,204,868	2,586,852
ユーロ	445,981,870	-	449,555,675	3,573,805
合計	995,753,583	-	989,941,063	5,812,520

（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12月15日現在
1口当たり純資産額	3.1601円
(1万口当たり純資産額)	(31,601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）】**

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 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)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		12,755,292
親投資信託受益証券		2,359,805,449
流動資産合計		2,372,560,741
資産合計		2,372,560,741
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		592,520
未払受託者報酬		258,683
未払委託者報酬		4,786,760
その他未払費用		96,946
流動負債合計		5,734,909
負債合計		5,734,909
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1,934,325,260
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		432,500,572
(分配準備積立金)		140,625,666
元本等合計		2,366,825,832
純資産合計		2,366,825,832
負債純資産合計		2,372,560,741



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	51,357,161
営業収益合計	51,357,161
営業費用	
支払利息	2,191
受託者報酬	258,683
委託者報酬	4,786,760
その他費用	96,946
営業費用合計	5,144,580
営業利益又は営業損失（ ）	46,212,581
経常利益又は経常損失（ ）	46,212,581
中間純利益又は中間純損失（ ）	46,212,581
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,961,769
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	381,281,515
剰余金増加額又は欠損金減少額	41,601,461
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41,601,461
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,633,216
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,633,216
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	432,500,572

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,913,328,634円
期中追加設定元本額	178,790,310円
期中一部解約元本額	157,793,684円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,934,325,260口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2236円 (12,236円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「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）」に記載のとおりであります。

「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

	2022年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	

預金		197,263,917
コール・ローン		148,909,017
国債証券		27,419,195,615
派生商品評価勘定		323,185
未収入金		7,511
未収利息		386,688,880
前払費用		35,244,650
流動資産合計		28,187,632,775
資産合計		28,187,632,775
負債の部		
流動負債		
未払金		39,480,930
未払解約金		1,385,622
流動負債合計		40,866,552
負債合計		40,866,552
純資産の部		
元本等		
元本	1	19,023,977,188
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,122,789,035
元本等合計		28,146,766,223
純資産合計		28,146,766,223
負債純資産合計		28,187,632,775

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15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	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	17,421,108,690円
期中追加設定元本額	1,950,926,276円
期中一部解約元本額	348,057,778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)	303,890,558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)	318,437,299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 エマーシングプラス(為替 ヘッジなし)	327,862,906円
D-I's 新興国債券イン デックス	58,593,884円
iFree 新興国債券イン デックス	5,740,749,963円
iFree 8資産バランス 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)	3,962,195,718円 1,710,056円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	8,135,913,333円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	142,783,392円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	31,840,079円
計	19,023,977,188円
2. 期末日における受益権の総数	19,023,977,188口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	25,802,514	-	26,125,699	323,185
ポーランド・ ズロチ	13,434,858	-	13,687,606	252,748
南アフリカ・ ランド	12,367,656	-	12,438,093	70,437
合計	25,802,514	-	26,125,699	323,185

(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12月15日現在
1口当たり純資産額	1.4795円
(1万口当たり純資産額)	(14,795円)



### 【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		22,193,685
親投資信託受益証券		7,539,853,348
流動資産合計		7,562,047,033
資産合計		7,562,047,033
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		5,416,742
未払受託者報酬		826,681
未払委託者報酬		11,987,562
その他未払費用		206,592
流動負債合計		18,437,577
負債合計		18,437,577
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		5,626,440,092
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,917,169,364
(分配準備積立金)		908,434,328
元本等合計		7,543,609,456
純資産合計		7,543,609,456
負債純資産合計		7,562,047,033

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	1
有価証券売買等損益	401,672,877
営業収益合計	401,672,878
<b>営業費用</b>	
支払利息	3,946
受託者報酬	826,681
委託者報酬	11,987,562
その他費用	206,592
営業費用合計	13,024,781
営業利益又は営業損失（ ）	388,648,097
経常利益又は経常損失（ ）	388,648,097
中間純利益又は中間純損失（ ）	388,648,097
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	47,562,976
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,480,003,163
剰余金増加額又は欠損金減少額	275,892,752
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	275,892,752
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,811,672
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	179,811,672
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,917,169,364

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	5,463,295,501円
期中追加設定元本額	814,059,361円
期中一部解約元本額	650,914,770円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	5,626,440,092口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3407円 (13,407円)

（参考）

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

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

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2022年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,008,528,662
投資証券	2	482,152,758,100
派生商品評価勘定		104,944,000
未収入金		3,952,193,515
未収配当金		2,864,084,928

流動資産合計		498,082,509,205
資産合計		498,082,509,205
負債の部		
流動負債		
前受金		69,160,000
未払金		653,400,000
未払解約金		2,133,200,000
流動負債合計		2,855,760,000
負債合計		2,855,760,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	147,752,120,681
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		347,474,628,524
元本等合計		495,226,749,205
純資産合計		495,226,749,205
負債純資産合計		498,082,509,205

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	139,303,981,506円
期中追加設定元本額	19,725,567,990円
期中一部解約元本額	11,277,428,815円

	ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	498,725,032円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	925,598,212円
計		147,752,120,681円
2.	期末日における受益権の総数	147,752,120,681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 5,144,650,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種 類	2022年12月15日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引			
不動産投信 指数先物取引			



買 建	10,682,840,000	-	10,788,400,000	105,560,000
合計	10,682,840,000	-	10,788,400,000	105,560,000

## (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)

	2022年12月15日現在
1口当たり純資産額	3.3517円
(1万口当たり純資産額)	(33,517円)

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		46,247,066
親投資信託受益証券		17,843,790,175
流動資産合計		17,890,037,241
資産合計		17,890,037,241
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		8,180,172
未払受託者報酬		1,904,401
未払委託者報酬		35,708,494
その他未払費用		476,018
流動負債合計		46,269,085
負債合計		46,269,085
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		17,149,742,095
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		694,026,061
(分配準備積立金)		2,333,301,057
元本等合計		17,843,768,156
純資産合計		17,843,768,156
負債純資産合計		17,890,037,241

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	55,549,061
<b>営業収益合計</b>	<b>55,549,061</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	7,367
受託者報酬	1,904,401
委託者報酬	35,708,494
その他費用	481,958
<b>営業費用合計</b>	<b>38,102,220</b>
営業利益又は営業損失（ ）	93,651,281
経常利益又は経常損失（ ）	93,651,281
中間純利益又は中間純損失（ ）	93,651,281
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	6,840,956
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	747,117,015
剰余金増加額又は欠損金減少額	116,153,611
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	116,153,611
剰余金減少額又は欠損金増加額	68,752,328
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	68,752,328
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	694,026,061

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	15,522,412,035円
期中追加設定元本額	3,026,899,015円
期中一部解約元本額	1,399,568,955円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	17,149,742,095口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい  
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0405円 (10,405円)

（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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「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12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	40,384,829
コール・ローン	1,168,886,286
投資信託受益証券	188,109,415
投資証券	19,017,528,512
派生商品評価勘定	187,582,821

未収入金		565,105
未収配当金		54,228,711
差入委託証拠金		218,090,497
流動資産合計		20,875,376,176
資産合計		20,875,376,176
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		26,546,753
流動負債合計		26,546,753
負債合計		26,546,753
純資産の部		
元本等		
元本	1	23,875,178,898
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	3,026,349,475
元本等合計		20,848,829,423
純資産合計		20,848,829,423
負債純資産合計		20,875,376,176

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
<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>
<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	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	23,434,151,916円
期中追加設定元本額	3,437,237,321円
期中一部解約元本額	2,996,210,339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）	20,434,940,650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）	993,949,149円
ダイワ海外REITインデッ クス（為替ヘッジあり）（投 資一任専用）	958,821円
ダイワ・マクロ・ナビゲー ター・ファンド2021-10（為 替ヘッジあり / 適格機関投資 家専用）	469,852,089円
ダイワ外国REITインデッ クス（為替ヘッジあり）（ダ イワSMA専用）	1,975,478,189円
計	23,875,178,898円
2. 期末日における受益権の総数	23,875,178,898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3,026,349,475円であります。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 不動産投信関連

種 類	2022年12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	1,218,075,325	-	1,236,433,539	18,358,214
合計	1,218,075,325	-	1,236,433,539	18,358,214

（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12月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

売 建	19,420,674,481	-	19,277,996,627	142,677,854
アメリカ・ドル	14,947,467,326	-	14,791,428,739	156,038,587
イギリス・ポンド	979,566,618	-	995,959,335	16,392,717
イスラエル・シェケル	24,922,809	-	24,763,539	159,270
オーストラリア・ドル	1,373,942,935	-	1,373,637,240	305,695
カナダ・ドル	394,151,237	-	386,416,626	7,734,611
シンガポール・ドル	704,601,821	-	702,712,574	1,889,247
ニュージーランド・ドル	80,848,915	-	81,908,237	1,059,322
ユーロ	636,762,816	-	645,035,947	8,273,131
香港・ドル	278,410,004	-	276,134,390	2,275,614
合計	19,420,674,481	-	19,277,996,627	142,677,854

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	0.8732円

(1万口当たり純資産額)	
--------------	--

(8,732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) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2022年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		10,516,888
親投資信託受益証券		3,917,008,037
流動資産合計		3,927,524,925
資産合計		3,927,524,925
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		1,759,502
未払受託者報酬		417,387
未払委託者報酬		7,826,815
その他未払費用		104,268
流動負債合計		10,107,972
負債合計		10,107,972
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		2,598,495,264
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,318,921,689
(分配準備積立金)		562,137,378
元本等合計		3,917,416,953
純資産合計		3,917,416,953
負債純資産合計		3,927,524,925

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年6月16日
	至 2022年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	86,402,424
営業収益合計	86,402,424
営業費用	
支払利息	1,593
受託者報酬	417,387
委託者報酬	7,826,815
その他費用	104,268
営業費用合計	8,350,063
営業利益	78,052,361
経常利益	78,052,361
中間純利益	78,052,361
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	12,121,333
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,110,390,892
剰余金増加額又は欠損金減少額	238,521,651
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	238,521,651
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,921,882
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,921,882
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,318,921,689

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 1 期首元本額	2,343,884,195円
期中追加設定元本額	454,537,672円
期中一部解約元本額	199,926,603円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,598,495,264口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。



## (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2022年12月15日現在
該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2022年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5076円 (15,076円)

## （参考）

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

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

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年12月15日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	139,259,603
コール・ローン	339,906,411
投資信託受益証券	1,455,566,231
投資証券	26,195,593,229
派生商品評価勘定	16,294,377

未収入金		808,074
未収配当金		74,889,173
差入委託証拠金		193,472,482
流動資産合計		28,415,789,580
資産合計		28,415,789,580
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,188,576
未払金		25,328,063
未払解約金		16,184,000
流動負債合計		43,700,639
負債合計		43,700,639
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,107,962,449
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		19,264,126,492
元本等合計		28,372,088,941
純資産合計		28,372,088,941
負債純資産合計		28,415,789,580

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2022年12月15日現在
1. 1 期首	2022年6月16日
期首元本額	8,345,562,785円
期中追加設定元本額	1,040,126,215円
期中一部解約元本額	277,726,551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 ヘッジなし)	1,257,426,098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)	255,921,809円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,856,528円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	13,282,727円
iFree 外国REITイ ンデックス	753,519,511円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,887,991,019円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	334,214,135円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	183,684,010円
	3,931,301,524円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	7,052,874円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,626,997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）	835,597円
ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専 用）	148,041,885円
ダイワ・インデックスセレク ト グローバルREIT	249,977,407円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	72,292,521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）	3,937,807円
計	9,107,962,449円
2. 期末日における受益権の総数	9,107,962,449口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

	2022年12月15日 現在
--	----------------

種 類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	696,374,490	-	711,393,797	15,019,307
合計	696,374,490	-	711,393,797	15,019,307

## (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12月15日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	316,688,886	-	315,775,380	913,506
アメリカ・ドル	218,549,814	-	216,361,238	2,188,576
ユーロ	98,139,072	-	99,414,142	1,275,070
合計	316,688,886	-	315,775,380	913,506

## (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12月15日現在
1口当たり純資産額	3.1151円
(1万口当たり純資産額)	(31,151円)

## 2【ファンドの現況】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

## 【純資産額計算書】

2022年12月30日

資産総額	15,470,619,758円
負債総額	54,055,046円
純資産総額（ - ）	15,416,564,712円
発行済数量	9,670,013,737口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5943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12月30日

資産総額	206,374,712,532円
負債総額	8,178,681,255円
純資産総額（ - ）	198,196,031,277円
発行済数量	149,463,238,773口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3261円

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	14,921,804,264円
負債総額	12,916,117円
純資産総額（ - ）	14,908,888,147円
発行済数量	8,609,870,358口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7316円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	232,880,344,151円
------	------------------



負債総額	6,623,162,639円
純資産総額( - )	226,257,181,512円
発行済数量	64,720,289,063口
1単位当たり純資産額( / )	3.4959円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	61,031,556,527円
負債総額	42,258,111円
純資産総額( - )	60,989,298,416円
発行済数量	38,563,245,991口
1単位当たり純資産額( / )	1.5815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12月30日

資産総額	78,328,521,176円
負債総額	196,281,857円
純資産総額( - )	78,132,239,319円
発行済数量	31,700,037,859口
1単位当たり純資産額( / )	2.4647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)

純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	12,853,703,069円
負債総額	17,567,940円
純資産総額( - )	12,836,135,129円
発行済数量	5,754,892,945口
1単位当たり純資産額( / )	2.2305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12月30日

資産総額	285,932,714,963円
負債総額	769,801,616円
純資産総額（ - ）	285,162,913,347円
発行済数量	70,393,364,422口
1単位当たり純資産額（ / ）	4.0510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）

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	2,727,881,081円
負債総額	9,798,590円
純資産総額（ - ）	2,718,082,491円
発行済数量	1,305,076,290口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0827円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

(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12月30日

資産総額	23,765,429,876円
負債総額	494,531,383円
純資産総額（ - ）	23,270,898,493円
発行済数量	12,232,398,205口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9024円

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	35,336,189,404円
------	-----------------

負債総額	90,362,102円
純資産総額( - )	35,245,827,302円
発行済数量	37,388,936,953口
1単位当たり純資産額( / )	0.9427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12月30日

資産総額	112,215,927,607円
負債総額	271,749,197円
純資産総額( - )	111,944,178,410円
発行済数量	83,397,162,847口
1単位当たり純資産額( / )	1.3423円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	96,684,376,364円
負債総額	122,234,830円
純資産総額( - )	96,562,141,534円
発行済数量	113,925,434,580口
1単位当たり純資産額( / )	0.8476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12月30日

資産総額	118,654,343,027円
負債総額	54,563,928円
純資産総額( - )	118,599,779,099円
発行済数量	136,422,137,936口
1単位当たり純資産額( / )	0.8694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)

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	8,308,933,300円
負債総額	12,975,191円
純資産総額（ - ）	8,295,958,109円
発行済数量	7,127,375,472口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1640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12月30日

資産総額	231,867,949,856円
負債総額	609,729,171円
純資産総額（ - ）	231,258,220,685円
発行済数量	76,913,876,366口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.0067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）

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	2,283,451,268円
負債総額	6,316,597円
純資産総額（ - ）	2,277,134,671円
発行済数量	1,943,620,582口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1716円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

(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12月30日

資産総額	28,133,908,780円
負債総額	5,609,733円
純資産総額（ - ）	28,128,299,047円
発行済数量	19,362,527,985口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4527円

ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	7,396,488,483円
負債総額	13,422,735円
純資産総額（ - ）	7,383,065,748円
発行済数量	5,656,591,160口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3052円

## (参考) ダイワ J - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	483,365,827,724円
負債総額	793,035,509円
純資産総額（ - ）	482,572,792,215円
発行済数量	147,878,462,564口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.2633円

ダイワファンドラップ 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	17,305,052,072円
負債総額	8,684,246円
純資産総額（ - ）	17,296,367,826円
発行済数量	17,263,247,409口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0019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12月30日

資産総額	20,263,708,396円
負債総額	78,856,137円
純資産総額( - )	20,184,852,259円
発行済数量	24,001,034,355口
1単位当たり純資産額( / )	0.8410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)

## 純資産額計算書

2022年12月30日

資産総額	3,731,735,745円
負債総額	2,459,367円
純資産総額( - )	3,729,276,378円
発行済数量	2,629,084,943口
1単位当たり純資産額( / )	1.4185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12月30日

資産総額	27,219,630,406円
負債総額	198,574,028円
純資産総額( - )	27,021,056,378円
発行済数量	9,217,374,277口
1単位当たり純資産額( / )	2.9315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。



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2022年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2022年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	85	292,873
追加型株式投資信託	773	20,246,853
株式投資信託 合計	858	20,539,726
単位型公社債投資信託	80	156,936
追加型公社債投資信託	14	1,410,738
公社債投資信託 合計	94	1,567,674
総合計	952	22,107,399

## 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	203
建物	6	4

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

(単位:百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<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 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	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、コマースナル・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)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取(注)	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 -

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(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 資本準備金	利益剰余金 利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
				その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,737	12,737	12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	7,232	7,232	7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737



	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	576	576	576
当中間期変動額合計	576	576	7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては、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)	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(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【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
  - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
  - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
  - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
    - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
    - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 使用開始日を記載することがあります。
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
    - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
    - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
  - ・ 次の事項を記載することがあります。
    - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
    - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
    - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
  - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
  - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
  - ・ 図案を採用することがあります。
  - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
  - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
  - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

**独立監査人の監査報告書**

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

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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**

2022年8月12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 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6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 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6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 J - R E I T インデックスの2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 TOPIXインデックスの2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ TOPIXインデックスの2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 日経225インデックスの2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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**

2022年8月12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 日本債券インデックスの2021年6月16日から2022年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2022年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**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。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 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）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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



以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 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）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ TOPIXインデックスの2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ TOPIXインデックスの2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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



以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日経225インデックスの2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年2月10日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2022年6月16日から2022年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年6月16日から2022年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。