

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2025年2月21日提出

【計算期間】 第8計算期間  
(自 2023年12月1日 至 2024年12月2日)

【ファンド名】 ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス  
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス  
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)  
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス  
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)  
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

【発行者名】 大和アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 小松 幹太

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 佐竹 優子

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

#### <FWO TOPIXインデックス>

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 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					日経 225
中小型株	年2回	日本			
債券					
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
公債		欧州			
社債	年6回 (隔月)	アジア			TOPIX
その他債券 クレジット属性 ( )		オセアニア			
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米			
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (MSCIコクサイ 指数(配当込み、 円ヘッジ・ベース))
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FWO 日本債券インデックス&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (除く日本)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア			
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	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	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。

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

## 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	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	中南米		
資産配分固定型		中近東 (中東)		
資産配分変更型		アフリカ		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## <FWO J-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	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
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	
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	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数) (配当込み)
	その他 ( )	中南米		
		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 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 (フルヘッジ)	
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 (SSP先進国REIT 指数(除く日本) (円ヘッジ・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。

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

## (注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

#### < 信託金の限度額 >

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### < ファンドの特色 >

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

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

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

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

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

## ●各ファンドの運用方針

## FWO TOPIXインデックス

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

◆東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数（配当込み）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（配当込み）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（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。
- (c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。  
TOPIX（配当込み）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行いません。

## FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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



## FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## FWO 日本債券インデックス

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

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

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

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

## FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注3)</sup>を用い債券価格変動への連動をめ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、需給要因によっては、さらにコストが拡大することもあります。

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

## FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## FWO J-REITインデックス

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

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

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

## FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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

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

## FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## ●特定の指数について

## ◆東証株価指数（TOPIX）

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。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

## ◆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社（FTSE International Limited）による基準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、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の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公募の確定利付円建債のうち、残存額、残存期間などの水準により選定された債券で構成され、時価総額加重平均方式で算出されます。

## ◆FTSE世界国債インデックス

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

## ◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

## －エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）

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

## ◆東証REIT指数（配当込み）

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

## ◆S&amp;P先進国REIT指数

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

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

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

## 〈分配方針〉

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

主な投資制限
<p>●FWO TOPIXインデックス</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>③外貨建資産への投資は、行ないません。</li> </ol>
<p>●FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）</p> <p>●FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ol>
<p>●FWO 日本債券インデックス</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>③外貨建資産への投資は、行ないません。</li> </ol>
<p>●FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ol>
<p>●FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</li> </ol>

**●FWO J-REITインデックス**

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

**●FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）**

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

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

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

\*「FWO TOPIXインデックス」を除きます。

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

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

\*「FWO 日本債券インデックス」を除きます。

### FWO J-REITインデックス

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

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

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

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

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

本ファンドは、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>]

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

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

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

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



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

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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年1月11日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2022年2月22日

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）> 商品分類の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3 ）

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

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

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況(2024年12月末日現在) >

・資本金の額 414億2,454万1,896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
2024年10月 1日	株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携

## ・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	% 80.00
株式会社かんぽ生命保険	東京都千代田区大手町二丁目3番1号	株 652,132	% 20.00

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 主要投資対象

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

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

## 投資態度

## &lt;FWO TOPIXインデックス&gt;

イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(TOPIX)(配当込み)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。
- 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。

< FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式(DR(預託証券))を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(配当込み、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。
- 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。

< FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

- イ．主として、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。
- 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の80%
- ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の20%
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 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。

< FWO 日本債券インデックス >

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

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

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

- イ．主として、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行いません。
- ロ．各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行いません。
- |                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券.....      | 信託財産の純資産総額の80% |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券..... | 信託財産の純資産総額の20% |
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<FWO J-REITインデックス>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数(配当込み、以下同じ。)の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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

- ロ．マザーファンドにおいて、保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。
- ハ．運用の効率化をはかるため、リート指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額とリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ．運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

(2)【投資対象】

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

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

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
- イ．有価証券
- ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、および に定めるものに限ります。）

## 八．約束手形

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

### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

#### イ．為替手形

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

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

#### 1．株券または新株引受権証券

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

#### 2．国債証券

#### 3．地方債証券

#### 4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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



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

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

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

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。 )
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 )

7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

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

#### <FWO J - R E I Tインデックス>

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

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

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

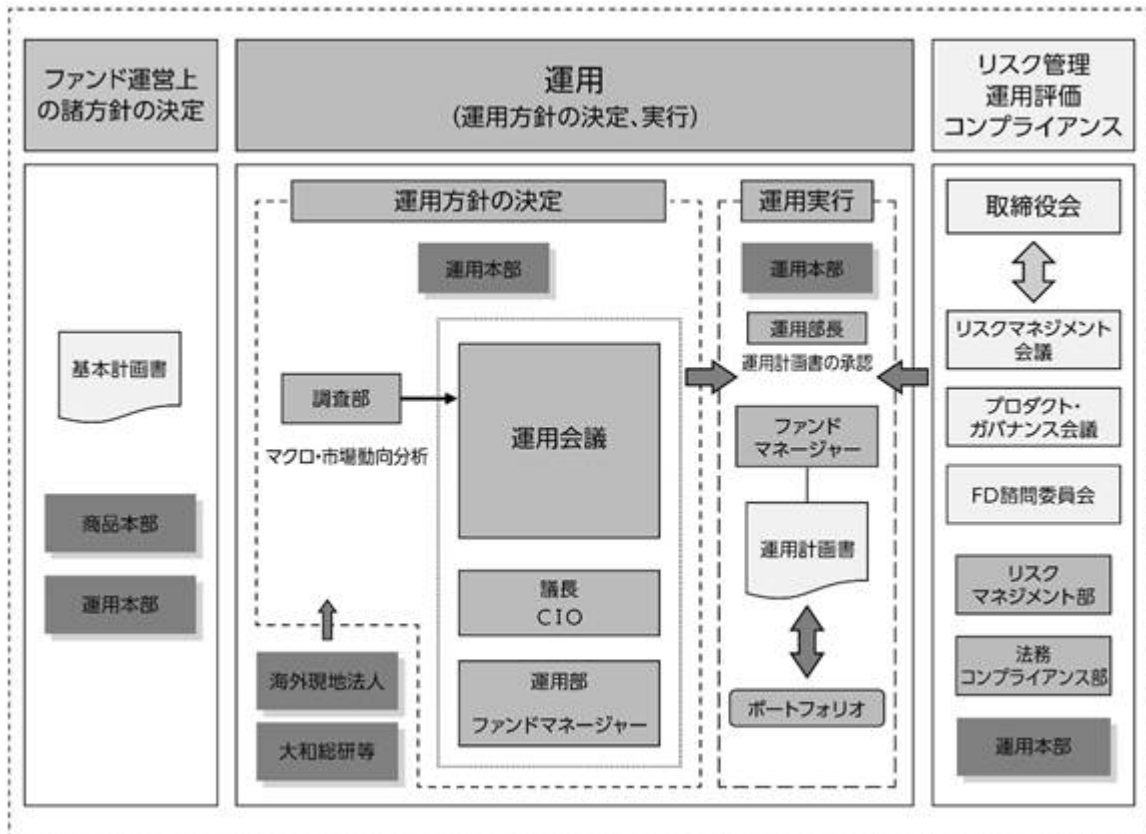
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(3)【運用体制】

<各ファンド共通>

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (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、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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10～20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．プロダクト・ガバナンス会議

経営会議の分科会として、運用状況・商品性およびこれらの開示の適切性について検証結果の報告を行ない、対応方針を審議・決定したうえでその実行状況を確認します。加えて、その他当社が運用するプロダクトの品質の維持・向上に関する事項の審議・決定・報告を行ないます。

ハ．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。

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2024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）

<FWO TOPIXインデックス>

< FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) >

< FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし) >

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

< FWO 日本債券インデックス >

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

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

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

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

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

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

< FWO 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。

< FWO J-REITインデックス >

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等(信託約款)

< FWO TOPIXインデックス >

< FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FWO 日本債券インデックス >

< FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) >

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

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

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

## &lt; 上記以外の各ファンド &gt;

（規定なし）

## 投資信託証券（信託約款）

## &lt; FWO T O P I X インデックス &gt;

## &lt; FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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

## &lt; FWO 日本債券インデックス &gt;

## &lt; FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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

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

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

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（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。

## &lt; FWO J - R E I T インデックス &gt;

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）

## &lt; FWO T O P I X インデックス &gt;

## &lt; FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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

## &lt; FWO 日本債券インデックス &gt;

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

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

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

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引

されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

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

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

< FWO J - R E I Tインデックス >

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

< FWO T O P I Xインデックス >

< FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FWO 日本債券インデックス >

< FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FWO 外国 R E I Tインデックス(為替ヘッジあり) >

< FWO 外国 R E I Tインデックス(為替ヘッジなし) >

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

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

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

信用取引(信託約款)

< FWO T O P I Xインデックス >

< FWO 日本債券インデックス >

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

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



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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

先物取引等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FWO J-REITインデックス>

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号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。

#### スワップ取引(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ.スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

#### <FWO J-REITインデックス>

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

#### <FWO TOPIXインデックス>

#### <FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

（規定なし）

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

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

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

資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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します。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

直物為替先渡取引(信託約款)

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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

ロ．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとしします。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します。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

デリバティブ取引等(信託約款)

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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します。

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

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

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

<FWO J - R E I T インデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FWO T O P I X インデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FWO J - R E I T インデックス>

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

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出来ます。

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用リスク集中回避（信託約款）

#### <各ファンド共通>

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

資金の借入れ（信託約款）

#### <各ファンド共通>

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### <参考> マザーファンドの概要

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数(配当込み)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(配当込み)の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。 ロ. ポートフォリオは、東証株価指数(配当込み)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(配当込み)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	株式 株式への投資には、制限を設けません。 先物取引等 イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 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。 スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、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。 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。 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。

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

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

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

## ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

## 日本債券インデックスマザーファンド

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

## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

## 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

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

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

## 主な投資制限

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

#### 外国債券インデックスマザーファンド

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

#### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

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

## 先進国リート・インデックス( 為替ヘッジあり ) マザーファンド

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



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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### < FWO TOPIXインデックス >

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

#### < FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

#### （FWO TOPIXインデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

#### <FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

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

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 日本債券インデックス>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

(FWO 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容)

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

## 外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の と同内容）

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

## &lt;FWO J - R E I Tインデックス&gt;

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

(FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

## ロ．カントリー・リスク

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

## (2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

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

## (3)その他の留意点

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

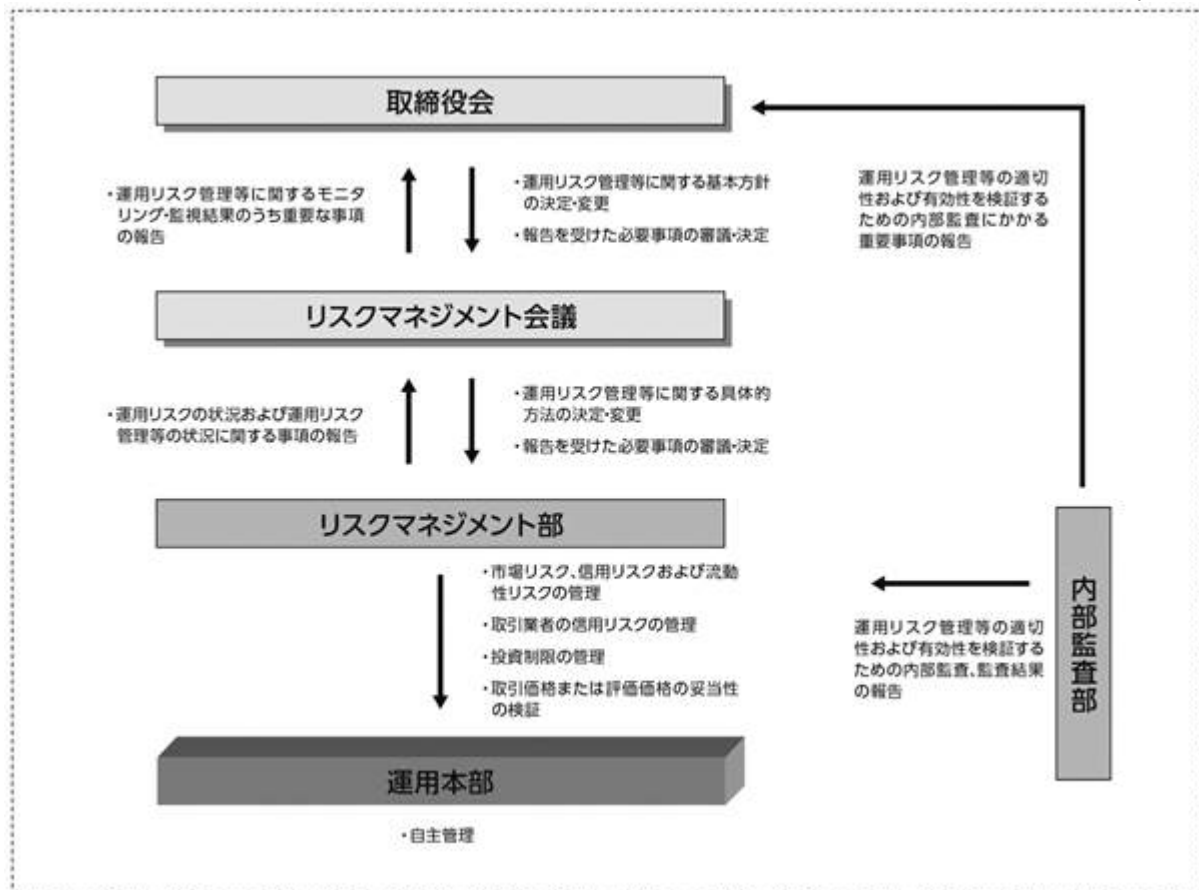
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

### 流動性リスクに関する事項

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

## (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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



## 参考情報

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

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

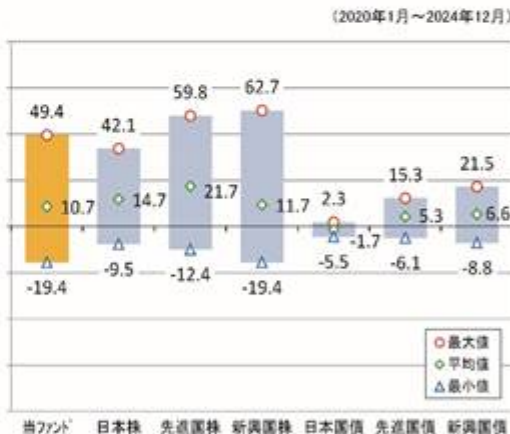
#### [FWO TOPIXインデックス]



### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



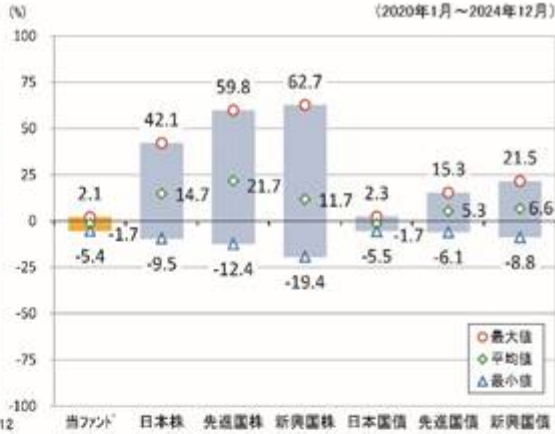
#### [FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



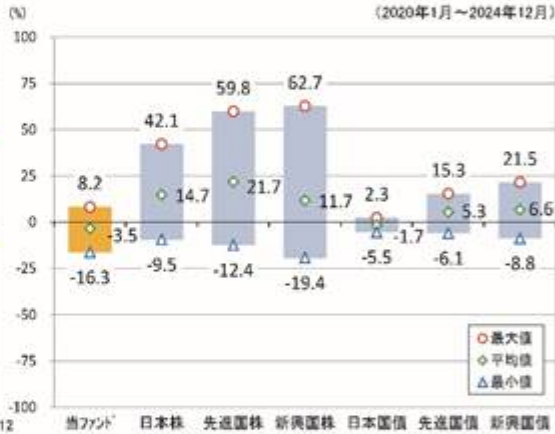
#### [FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



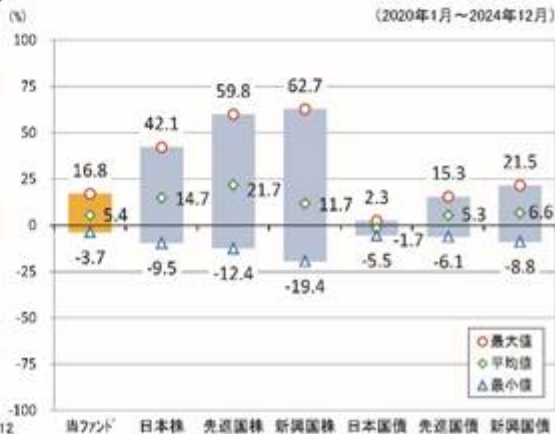
## [FWO 日本債券インデックス]



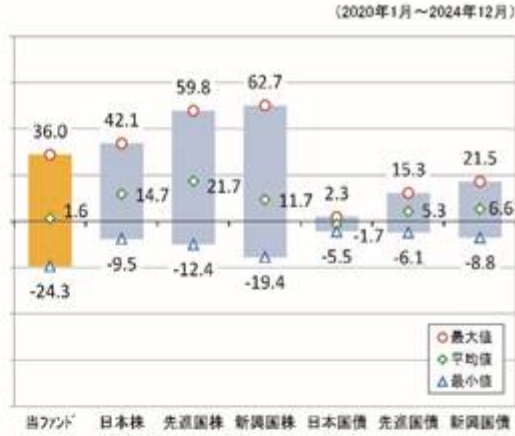
## [FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



## [FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



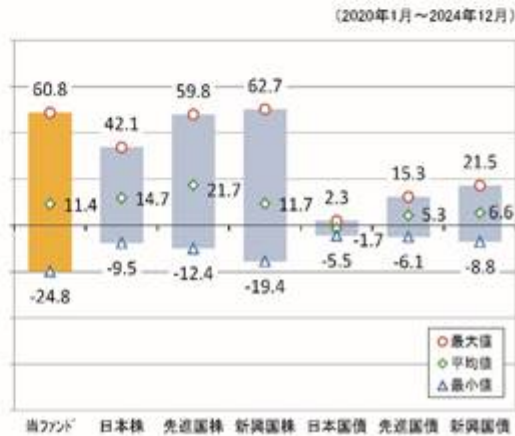
## [FWO J-REITインデックス]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率
FWO TOPIXインデックス	年率0.231%（税抜0.21%）
FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.3355%（税抜0.305%）

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

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

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.11%(税抜0.10%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.2255%(税抜0.205%)

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

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

<FWO TOPIXインデックス>

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FWO 日本債券インデックス>

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社

年率0.18% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)
-----------------	-----------------	-----------------

## &lt;FWO J-REITインデックス&gt;

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

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

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

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」について

少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にN I S Aの適用対象となります。

当ファンドは、N I S Aの対象ではありません。くわしくは、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、2024年12月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。



## 5【運用状況】

## 【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

## (1)【投資状況】（2024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	7,258,810,585	99.99
内 日本	7,258,810,585	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	512,254	0.01
純資産総額	7,259,322,839	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】（2024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	3,544,168,051	1.9938 7,066,625,925	2.0481 7,258,810,585	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,308,490,516	1,308,490,516	1.1827	1.1827
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,014,835,042	2,014,835,042	1.1209	1.1209
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,849,716,102	2,849,716,102	1.1793	1.1793
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,646,152,629	2,646,152,629	1.2343	1.2343
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,521,561,254	3,521,561,254	1.3823	1.3823
第6計算期間末 (2022年11月30日)	4,455,757,806	4,455,757,806	1.4592	1.4592
第7計算期間末 (2023年11月30日)	5,715,400,246	5,715,400,246	1.7851	1.7851
2023年12月末日	5,690,904,769	-	1.7809	-
2024年1月末日	6,164,734,335	-	1.9197	-
2月末日	6,450,660,414	-	2.0137	-
3月末日	6,416,536,405	-	2.1025	-
4月末日	6,608,391,397	-	2.0834	-
5月末日	6,753,986,736	-	2.1068	-
6月末日	6,884,147,548	-	2.1369	-
7月末日	6,902,518,581	-	2.1250	-
8月末日	6,777,795,011	-	2.0635	-
9月末日	6,729,567,533	-	2.0310	-
10月末日	6,908,825,508	-	2.0688	-
11月末日	6,921,055,782	-	2.0578	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	7,008,139,960	7,008,139,960	2.0838	2.0838
12月末日	7,259,322,839	-	2.1402	-

## 【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	18.3
第2計算期間	5.2
第3計算期間	5.2
第4計算期間	4.7
第5計算期間	12.0
第6計算期間	5.6
第7計算期間	22.3
第8計算期間	16.7

## (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	1,207,147,382	101,755,106
第2計算期間	1,072,657,156	381,496,133
第3計算期間	1,209,913,301	590,980,566
第4計算期間	931,798,024	1,204,458,870
第5計算期間	891,127,877	487,424,798
第6計算期間	939,195,196	433,167,059
第7計算期間	852,973,955	704,845,388
第8計算期間	766,621,291	605,090,116

(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 (2024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	409,408,926,410	98.05
内 日本	409,408,926,410	98.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,135,524,843	1.95
純資産総額	417,544,451,253	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)	7,885,795,000	1.89
内 日本	7,885,795,000	1.89

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

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

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

## (2) 投資資産 (2024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	5,475,100	2,614.96 14,317,206,091	3,146.00 17,224,664,600	4.13
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,606,800	2,660.14 9,594,618,914	3,369.00 12,151,309,200	2.91
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,507,000	1,472.17 9,579,455,766	1,846.00 12,011,922,000	2.88
4	日立	日本	株式	電気機器	2,678,700	3,698.65 9,907,589,002	3,937.00 10,546,041,900	2.53
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	826,100	9,284.68 7,670,075,400	11,145.00 9,206,884,500	2.21
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,116,100	3,021.75 6,394,328,172	3,764.00 7,965,000,400	1.91
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	103,000	67,273.86 6,929,208,002	64,630.00 6,656,890,000	1.59
8	任天堂	日本	株式	その他製品	650,200	7,726.52 5,023,788,446	9,264.00 6,023,452,800	1.44

9	伊藤忠	日本	株式	卸売業	732,500	7,670.91 5,618,945,172	7,832.00 5,736,940,000	1.37
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	990,400	5,229.36 5,179,159,357	5,728.00 5,673,011,200	1.36
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,369,200	2,881.87 3,945,857,046	3,873.00 5,302,911,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,601,100	2,952.90 4,727,902,127	3,311.00 5,301,242,100	1.27
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	218,000	23,096.03 5,034,934,623	24,185.00 5,272,330,000	1.26
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,014,000	2,874.32 5,788,881,262	2,604.00 5,244,456,000	1.26
15	信越化学	日本	株式	化学	925,100	5,754.48 5,323,474,405	5,296.00 4,899,329,600	1.17
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	30,726,100	150.32 4,618,884,547	158.00 4,854,723,800	1.16
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	509,600	8,455.19 4,308,768,959	9,185.00 4,680,676,000	1.12
18	第一三共	日本	株式	医薬品	974,900	4,939.02 4,815,051,829	4,352.00 4,242,764,800	1.02
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,819,100	1,887.13 3,432,895,554	2,223.00 4,043,859,300	0.97
20	HOYA	日本	株式	精密機器	201,200	19,309.43 3,885,058,431	19,815.00 3,986,778,000	0.95
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	919,100	4,259.69 3,915,088,494	4,181.00 3,842,757,100	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	759,800	4,819.52 3,661,874,722	5,042.00 3,830,911,600	0.92
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,440,300	1,537.30 3,751,478,321	1,535.00 3,745,860,500	0.90
24	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	61,300	46,295.58 2,837,919,286	53,820.00 3,299,166,000	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	16,532,600	197.23 3,260,784,168	198.90 3,288,334,140	0.79
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,203,800	2,180.17 2,624,496,192	2,487.00 2,993,850,600	0.72
27	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	324,600	6,563.78 2,130,603,490	9,198.00 2,985,670,800	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,058,100	2,266.72 2,398,426,554	2,687.00 2,843,114,700	0.68

29	富士通	日本	株式	電気機器	957,200	2,914.77 2,790,024,240	2,799.50 2,679,681,400	0.64
30	キヤノン	日本	株式	電気機器	513,700	4,759.83 2,445,127,571	5,161.00 2,651,205,700	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

(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
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.24%
建設業	2.11%
食料品	2.99%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.05%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.82%
金属製品	0.48%
機械	5.45%
電気機器	17.28%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.61%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.20%
海運業	0.68%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.33%

卸売業	6.68%
小売業	4.51%
銀行業	8.39%
証券、商品先物取引業	0.87%
保険業	3.22%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.73%
サービス業	5.04%
合計	98.05%

(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 0703月	買建	283	7,766,705,650	7,885,795,000	1.89%

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●FWO TOPIXインデックス

2024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	21,402円
純資産総額	72億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.0%
3カ月間	5.4%
6カ月間	0.2%
1年間	20.2%
3年間	49.6%
5年間	80.5%
設定来	114.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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	2,090	98.0%	電気機器	17.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
国内株式先物	1	1.9%	銀行業	8.4%	ソニーグループ	電気機器	2.9%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
コール・ローン、その他		2.0%	情報・通信業	7.3%	日立	電気機器	2.5%
合計	2,091	-	卸売業	6.7%	リクルートホールディングス	サービス業	2.2%
株式市場・上場別構成			機械	5.4%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.9%
東証プライム市場		97.7%	化学	5.0%	TOPIX 先物 0703月	-	1.9%
東証スタンダード市場		0.4%	サービス業	5.0%	キーエンス	電気機器	1.6%
東証グロス市場		0.0%	小売業	4.5%	任天堂	その他製品	1.4%
地方市場・その他		-	その他	30.6%	伊藤忠	卸売業	1.4%
合計		98.0%	合計	98.0%	合計		22.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】(2024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		3,309,168,362	99.98
	内 日本	3,309,168,362	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		508,831	0.02
純資産総額		3,309,677,193	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】（2024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	992,879,583	3.3796 3,355,602,576	3.3329 3,309,168,362	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,294,661,850	1,294,661,850	1.1363	1.1363
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,198,184,300	2,198,184,300	1.1423	1.1423
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,353,172,110	2,353,172,110	1.3050	1.3050
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,369,427,354	3,369,427,354	1.4661	1.4661
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,374,668,404	3,374,668,404	1.8402	1.8402
第6計算期間末 (2022年11月30日)	4,518,708,605	4,518,708,605	1.5660	1.5660
第7計算期間末 (2023年11月30日)	3,427,426,519	3,427,426,519	1.6927	1.6927
2023年12月末日	3,561,920,436	-	1.7685	-
2024年1月末日	3,619,778,937	-	1.8048	-
2月末日	3,720,782,921	-	1.8478	-
3月末日	3,807,668,071	-	1.9104	-
4月末日	2,914,016,327	-	1.8603	-
5月末日	3,001,984,618	-	1.8913	-
6月末日	3,110,699,255	-	1.9494	-
7月末日	3,122,833,212	-	1.9329	-
8月末日	3,207,643,695	-	1.9736	-
9月末日	3,263,254,921	-	2.0118	-
10月末日	3,254,455,360	-	2.0184	-
11月末日	3,355,529,387	-	2.0676	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	3,371,093,385	3,371,093,385	2.0772	2.0772
12月末日	3,309,677,193	-	2.0479	-

## 【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
第7計算期間	0.0000

第8計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.6
第2計算期間	0.5
第3計算期間	14.2
第4計算期間	12.3
第5計算期間	25.5
第6計算期間	14.9
第7計算期間	8.1
第8計算期間	22.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,218,074,496	79,711,026
第2計算期間	1,148,408,392	363,438,941
第3計算期間	570,028,310	691,152,610
第4計算期間	1,186,063,315	691,086,927
第5計算期間	503,558,139	967,841,476
第6計算期間	1,347,521,936	295,924,245
第7計算期間	370,879,531	1,231,571,990
第8計算期間	355,014,131	756,937,694

(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 (2024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	136,985,039,776	95.62
内 香港	664,862,368	0.46
内 シンガポール	556,548,737	0.39
内 イスラエル	337,208,239	0.24
内 ノルウェー	213,098,151	0.15
内 スウェーデン	1,260,290,484	0.88
内 デンマーク	1,038,130,917	0.72

内 イギリス	5,031,691,853	3.51
内 アイルランド	92,063,061	0.06
内 オランダ	1,534,802,655	1.07
内 ベルギー	325,717,895	0.23
内 フランス	3,601,784,291	2.51
内 ドイツ	3,073,804,972	2.15
内 スイス	3,238,367,673	2.26
内 ポルトガル	55,574,067	0.04
内 スペイン	899,331,586	0.63
内 イタリア	929,135,842	0.65
内 フィンランド	323,808,184	0.23
内 オーストリア	62,529,940	0.04
内 カナダ	4,071,246,052	2.84
内 アメリカ	107,296,522,806	74.90
内 オーストラリア	2,302,551,379	1.61
内 ニューゼaland	75,968,624	0.05
投資証券	2,590,911,714	1.81
内 香港	34,131,201	0.02
内 シンガポール	36,087,159	0.03
内 イギリス	36,144,843	0.03
内 ベルギー	7,614,686	0.01
内 フランス	46,166,624	0.03
内 カナダ	3,863,119	0.00
内 アメリカ	2,201,870,415	1.54
内 オーストラリア	225,033,667	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,678,794,833	2.57
純資産総額	143,254,746,323	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)	11,161,367,614	7.79
内 イギリス	357,061,782	0.25
内 ドイツ	1,414,301,718	0.99
内 カナダ	654,185,292	0.46
内 アメリカ	8,532,490,197	5.96
内 オーストラリア	203,328,625	0.14
為替予約取引(売建)	143,446,637,056	100.13
内 日本	143,446,637,056	100.13

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

(注2) 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（2024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	200,563	30,399.34 6,097,009,235	40,429.22 8,108,606,894	5.66
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	323,710	10,089.35 3,266,070,905	21,672.24 7,015,521,393	4.90
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	93,166	60,405.30 5,627,729,581	68,101.23 6,344,719,697	4.43
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	124,585	24,609.48 3,065,973,327	35,392.77 4,409,408,873	3.08
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	28,767	60,506.38 1,740,588,188	94,877.94 2,729,353,867	1.91
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	37,946	36,447.83 1,383,053,733	68,279.97 2,590,952,076	1.81
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	77,268	22,757.19 1,758,409,473	30,490.77 2,355,961,342	1.64
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	58,580	18,222.81 1,067,494,420	38,240.01 2,240,100,079	1.56
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	66,340	23,014.71 1,526,801,750	30,693.24 2,036,190,019	1.42

10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	37,569	28,029.65 1,053,049,711	38,148.27 1,433,192,378	1.00
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,665	104,838.38 1,118,102,439	123,881.83 1,321,199,723	0.92
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	17,459	60,149.52 1,050,153,334	72,210.75 1,260,727,516	0.88
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	21,960	42,266.32 928,171,790	50,405.63 1,106,907,828	0.77
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	58,629	16,124.86 945,392,913	16,843.00 987,488,622	0.69
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	12,169	85,989.65 1,046,409,014	80,670.21 981,675,885	0.69
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	10,898	68,086.68 742,009,588	84,183.39 917,430,650	0.64
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,820	110,307.93 641,992,803	148,641.74 865,094,962	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	58,267	8,927.36 520,175,436	14,498.77 844,800,344	0.59
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	31,048	24,188.09 750,996,912	26,816.25 832,591,098	0.58
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	5,653	80,779.36 456,646,281	143,556.25 811,523,532	0.57
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	13,054	55,350.66 722,549,302	62,142.59 811,209,433	0.57
22	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,794	25,564.41 812,796,214	22,944.00 729,481,822	0.51
23	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	12,574	41,122.37 517,074,517	53,536.02 673,161,928	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,259	26,341.71 612,682,150	28,157.62 654,918,125	0.46
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	92,149	5,447.56 501,992,311	7,013.70 646,305,552	0.45
26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	43,969	16,695.72 734,094,874	14,059.74 618,193,104	0.43
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	21,920	17,445.19 382,401,370	26,726.09 585,835,954	0.41

28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	5,127	110,122.52 564,598,572	112,953.70 579,113,661	0.40
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	54,033	9,719.05 525,156,730	9,878.34 533,756,399	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	13,397	24,266.32 325,098,238	39,498.34 529,159,261	0.37

(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	95.62%
投資証券	1.81%
合計	97.43%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.68%
素材	3.08%
資本財・サービス	9.59%
一般消費財・サービス	10.53%
生活必需品	5.93%
ヘルスケア	10.23%
金融	15.48%
情報技術	26.38%
コミュニケーション・サービス	7.98%
公益事業	2.47%
不動産	0.28%
合計	95.62%

(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 25	買建	179	8,659,058,857	8,532,490,197	5.96%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	22	359,830,250	357,061,782	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	10	204,603,708	203,328,625	0.14%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	20	663,561,187	654,185,292	0.46%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	13	265,034,204	263,743,935	0.18%
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	142	1,164,508,696	1,150,557,783	0.80%
為替予約取引	日本	香港ドル売/円買 2025年1月	売建	34,284,800	658,532,152	697,630,538	0.49%
		イスラエル・シュケル売/円買 2025年1月	売建	3,847,100	158,231,223	164,933,640	0.12%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2025年1月	売建	16,373,200	220,856,457	227,952,602	0.16%
		豪ドル売/円買 2025年1月	売建	27,289,600	2,649,843,812	2,684,248,718	1.87%
		カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	39,853,100	4,250,809,973	4,370,430,431	3.05%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2025年1月	売建	80,479,700	1,102,547,746	1,157,249,798	0.81%
		ユーロ売/円買 2025年1月	売建	66,245,500	10,447,147,209	10,915,098,796	7.62%
		米ドル売/円買 2025年1月	売建	714,669,700	106,797,819,672	112,889,225,812	78.80%
		シンガポール・ドル売/円買 2025年1月	売建	4,353,000	485,381,735	506,673,964	0.35%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2025年1月	売建	838,400	73,933,465	74,664,969	0.05%
		英ポンド売/円買 2025年1月	売建	26,373,500	5,002,948,726	5,240,992,028	3.66%
		デンマーク・クローネ売/円買 2025年1月	売建	53,001,800	1,120,675,359	1,170,931,666	0.82%
スイス・フラン売/円買 2025年1月	売建	19,087,600	3,244,567,510	3,346,604,094	2.34%		

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

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



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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報) 運用実績

### ●FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2024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



※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	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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	1,156	103.4%	日本円	99.6%	情報技術	26.4%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	6.0%
外国リート	51	1.8%	米ドル	0.3%	金融	15.5%	APPLE INC	アメリカ	5.7%
外国投資証券	3	0.1%	ユーロ	0.3%	一般消費財・サービス	10.5%	NVIDIA CORP	アメリカ	4.9%
外国ワラント	1	0.0%	シンガポール・ドル	0.0%	ヘルスケア	10.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
ユーロ・ローン、その他		2.6%	香港ドル	0.0%	資本財・サービス	9.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	3.1%
合計	1,211	-	イスラエル・シケル	0.0%	コミュニケーション・サービス	8.0%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.9%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	0.0%	生活必需品	5.9%	TESLA INC	アメリカ	1.8%
アメリカ		82.4%	ニュージーランド・ドル	0.0%	エネルギー	3.7%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
イギリス		3.8%	スイス・フラン	-0.0%	素材	3.1%	BROADCOM INC	アメリカ	1.6%
その他		19.0%	その他	-0.2%	公益事業、他	2.7%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
合計		105.2%	合計	100.0%	合計	95.6%	合計		32.4%

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

#### 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIロクサイ指数(税引後配当込み、円ヘッジ・ベース)です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】（2024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	5,146,543,070	99.21
内 日本	5,146,543,070	99.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	41,001,926	0.79
純資産総額	5,187,544,996	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】（2024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	569,826,752	6.9710 3,972,269,390	7.2380 4,124,406,030	79.51
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	355,612,511	2.7019 960,857,757	2.8743 1,022,137,040	19.70

(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	99.21%
合計	99.21%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	915,626,043	915,626,043	1.1391	1.1391
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,637,273,973	1,637,273,973	1.1550	1.1550
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,845,455,269	1,845,455,269	1.2622	1.2622
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,513,652,732	2,513,652,732	1.3420	1.3420
第5計算期間末 (2021年11月30日)	2,628,949,371	2,628,949,371	1.7840	1.7840
第6計算期間末 (2022年11月30日)	3,471,221,862	3,471,221,862	1.8759	1.8759
第7計算期間末 (2023年11月30日)	3,745,266,306	3,745,266,306	2.2554	2.2554
2023年12月末日	3,785,538,465	-	2.2911	-
2024年1月末日	3,981,381,875	-	2.4110	-
2月末日	4,163,844,884	-	2.5269	-
3月末日	4,144,230,046	-	2.6166	-
4月末日	4,480,660,011	-	2.6796	-
5月末日	4,597,983,420	-	2.7407	-
6月末日	4,861,423,798	-	2.8873	-
7月末日	4,539,667,729	-	2.7228	-
8月末日	4,541,497,394	-	2.6771	-
9月末日	4,675,557,629	-	2.7400	-
10月末日	5,010,405,286	-	2.9242	-
11月末日	4,965,100,456	-	2.9030	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	4,970,558,110	4,970,558,110	2.9061	2.9061
12月末日	5,187,544,996	-	3.0302	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.9
第2計算期間	1.4
第3計算期間	9.3
第4計算期間	6.3
第5計算期間	32.9
第6計算期間	5.2
第7計算期間	20.2
第8計算期間	28.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	866,066,727	72,233,916
第2計算期間	874,852,673	261,158,636
第3計算期間	481,206,327	436,632,747
第4計算期間	950,256,999	539,288,288
第5計算期間	415,335,713	814,761,474
第6計算期間	645,807,754	269,063,761
第7計算期間	360,555,164	550,400,119
第8計算期間	481,642,488	431,825,540

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2024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		664,948,937,471	93.92
	内 香港	3,278,069,956	0.46
	内 シンガポール	2,736,380,178	0.39
	内 イスラエル	1,649,747,543	0.23
	内 ノルウェー	1,001,666,836	0.14
	内 スウェーデン	6,198,717,354	0.88
	内 デンマーク	5,046,887,127	0.71
	内 イギリス	23,304,665,468	3.29
	内 アイルランド	449,777,616	0.06
	内 オランダ	7,450,885,512	1.05
	内 ベルギー	1,577,865,510	0.22
	内 フランス	17,623,980,655	2.49
	内 ドイツ	14,974,676,166	2.12
	内 スイス	14,493,342,974	2.05
	内 ポルトガル	264,776,302	0.04
	内 スペイン	4,398,985,152	0.62
	内 イタリア	4,514,558,654	0.64
	内 フィンランド	1,574,034,058	0.22
	内 オーストリア	310,533,061	0.04
	内 カナダ	19,423,534,158	2.74
	内 アメリカ	523,827,958,210	73.99
	内 オーストラリア	10,487,651,986	1.48
	内 ニュージーランド	360,242,995	0.05
投資証券		12,479,592,243	1.76
	内 香港	167,156,352	0.02
	内 シンガポール	165,248,323	0.02
	内 イギリス	160,464,025	0.02
	内 ベルギー	35,680,693	0.01
	内 フランス	219,838,528	0.03
	内 カナダ	22,314,046	0.00
	内 アメリカ	10,696,623,768	1.51
	内 オーストラリア	1,012,266,508	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,569,023,036	4.32
純資産総額		707,997,552,750	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)	30,745,648,148	4.34

	内 イギリス	1,931,379,639	0.27
	内 ドイツ	5,022,395,228	0.71
	内 カナダ	2,714,868,962	0.38
	内 アメリカ	19,877,365,431	2.81
	内 オーストラリア	1,199,638,888	0.17
	為替予約取引(買建)	19,217,157,600	2.71
	内 日本	19,217,157,600	2.71

(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（2024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	980,500	37,540.85 36,808,812,642	40,429.22 39,640,856,289	5.60
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,580,200	21,868.38 34,556,421,977	21,672.24 34,246,476,492	4.84
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	454,400	66,982.90 30,437,031,032	68,101.23 30,945,201,366	4.37
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	608,200	32,884.04 20,000,073,250	35,392.77 21,525,885,755	3.04
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	140,700	90,845.93 12,782,023,420	94,877.94 13,349,326,974	1.89
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	185,050	54,597.40 10,103,250,498	68,279.97 12,635,210,077	1.78
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	377,000	26,724.51 10,075,140,647	30,490.77 11,495,022,854	1.62

8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	285,620	25,637.81 7,322,672,549	38,240.01 10,922,113,084	1.54
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	323,440	26,968.10 8,722,564,916	30,693.24 9,927,423,874	1.40
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	183,070	39,500.70 7,231,394,906	38,148.27 6,983,803,899	0.99
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	51,985	125,808.46 6,540,152,949	123,881.83 6,439,996,964	0.91
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	85,350	76,404.10 6,521,090,242	72,210.75 6,163,187,666	0.87
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	107,850	49,839.35 5,375,174,372	50,405.63 5,436,248,145	0.77
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	285,809	18,658.91 5,332,885,208	16,843.00 4,813,882,816	0.68
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,466	96,521.43 5,739,743,713	80,670.21 4,797,135,195	0.68
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	53,100	84,300.44 4,476,353,853	84,183.39 4,470,138,328	0.63
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	28,560	153,731.97 4,390,585,303	148,641.74 4,245,208,266	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需 品	284,500	14,631.65 4,162,704,425	14,498.77 4,124,902,569	0.58
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	151,167	28,355.34 4,286,392,710	26,816.25 4,053,732,880	0.57
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	27,690	140,275.60 3,884,231,525	143,556.25 3,975,072,812	0.56
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	63,950	67,879.78 4,340,912,148	62,142.59 3,974,018,937	0.56
22	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	155,000	24,519.48 3,800,519,679	22,944.00 3,556,321,395	0.50
23	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	61,566	52,197.81 3,213,610,875	53,536.02 3,295,998,669	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	113,672	28,935.86 3,289,197,919	28,157.62 3,200,733,185	0.45

25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	449,301	7,515.13 3,376,556,233	7,013.70 3,151,262,963	0.45
26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	213,987	16,743.90 3,582,977,571	14,059.74 3,008,603,509	0.42
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,033	29,237.99 3,129,429,912	26,726.09 2,860,573,891	0.40
28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	25,150	108,583.32 2,730,870,699	112,953.70 2,840,785,756	0.40
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	263,550	10,136.17 2,671,388,763	9,878.34 2,603,436,771	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	65,778	37,090.50 2,439,739,435	39,498.34 2,598,121,809	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.92%
投資証券	1.76%
合計	95.68%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.59%
素材	2.97%
資本財・サービス	9.42%
一般消費財・サービス	10.38%
生活必需品	5.78%
ヘルスケア	10.00%
金融	15.16%
情報技術	26.07%
コミュニケーション・サービス	7.87%
公益事業	2.41%
不動産	0.27%
合計	93.92%

(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 25	買建	417	20,261,868,299	19,877,365,431	2.81%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	119	1,952,918,031	1,931,379,639	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	59	1,210,854,639	1,199,638,888	0.17%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	83	2,759,761,983	2,714,868,962	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	91	1,861,448,572	1,846,207,545	0.26%
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	392	3,219,887,690	3,176,187,683	0.45%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2025年1月	買建	7,500,000	728,422,240	737,712,000	0.10%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	8,500,000	1,348,394,820	1,400,522,900	0.20%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	78,900,000	11,904,185,770	12,463,044,000	1.76%
		スイス・フラン買/円売 2025年1月	買建	8,100,000	1,378,866,950	1,420,162,470	0.20%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	17,000,000	1,815,234,350	1,864,279,500	0.26%
		英ポンド買/円売 2025年1月	買建	6,700,000	1,274,462,810	1,331,436,730	0.19%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024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	37,453,929,774	88.28
内 中国	16,420,914,760	38.71
内 台湾	7,105,523,321	16.75
内 タイ	1,247,545,348	2.94
内 マレーシア	272,389,257	0.64
内 インドネシア	407,435,929	0.96
内 インド	4,361,048,332	10.28
内 サウジアラビア	920,483,703	2.17
内 トルコ	644,799,003	1.52
内 カナダ	16,020,787	0.04
内 メキシコ	705,151,330	1.66
内 チリ	114,447,136	0.27
内 ブラジル	3,761,832,105	8.87
内 南アフリカ	1,476,338,763	3.48
投資証券	2,976,339,615	7.02
内 アメリカ	2,922,243,420	6.89
内 メキシコ	18,286,911	0.04
内 南アフリカ	35,809,284	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,995,108,252	4.70
純資産総額	42,425,377,641	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)	1,590,460,355	3.75
内 アメリカ	1,590,460,355	3.75
為替予約取引(買建)	15,796,000	0.04
内 日本	15,796,000	0.04

(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 (2024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	-	895,500	3,275.11 2,932,867,184	3,263.25 2,922,243,420	6.89
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	486,000	4,835.96 2,350,278,352	5,252.92 2,552,923,008	6.02
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	948,900	1,536.08 1,457,592,743	1,678.29 1,592,532,228	3.75
4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	151,100	7,842.04 1,184,933,059	8,506.61 1,285,349,073	3.03
5	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	10,703,000	97.78 1,046,785,969	105.16 1,125,536,042	2.65
6	CHINA CONSTRUCTION BANK- H	中国	株式	金融	7,825,000	113.88 891,205,923	131.85 1,031,793,545	2.43
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	962,000	764.73 735,683,429	944.61 908,717,706	2.14
8	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	9,391,000	78.32 735,693,093	80.29 754,071,005	1.78
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネル ギー	788,000	951.04 749,424,219	908.32 715,759,618	1.69
10	VALE SA	ブラジル	株式	素材	458,890	1,611.11 739,335,095	1,394.32 639,842,410	1.51
11	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	214,195	2,195.27 470,220,324	2,769.64 593,243,468	1.40
12	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネル ギー	522,300	1,012.47 528,826,896	989.32 516,724,297	1.22
13	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	717,600	360.21 258,498,313	695.97 499,433,095	1.18
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	505,902	1,017.49 514,753,166	898.78 454,695,004	1.07
15	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	64,003	6,571.17 420,575,222	6,891.45 441,073,858	1.04
16	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネル ギー	4,543,800	108.21 491,799,200	89.46 406,525,607	0.96

17	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,946,000	71.77 283,298,308	89.87 354,649,907	0.84
18	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	151,264	2,856.13 432,031,353	2,271.15 343,543,687	0.81
19	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	101,736	3,205.91 326,156,707	3,344.74 340,280,977	0.80
20	MEITUAN-CLASS B	中国	株式	一般消費財・サービス	106,890	2,516.95 269,037,316	3,152.78 337,001,296	0.79
21	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	357,000	702.43 250,770,420	808.06 288,479,919	0.68
22	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,192,000	167.01 366,123,887	122.89 269,377,949	0.63
23	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	74,637	3,149.10 235,039,810	3,565.15 266,092,474	0.63
24	EVERGREEN MARINE CORP LTD	台湾	株式	資本財・サービス	235,800	916.88 216,201,326	1,089.13 256,819,023	0.61
25	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,616,100	152.78 246,914,112	147.95 239,110,076	0.56
26	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	304,836	847.82 258,449,064	784.02 238,998,132	0.56
27	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション・サービス	124,350	1,787.52 222,280,046	1,732.30 215,411,505	0.51
28	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	257,000	794.17 204,103,515	795.16 204,358,176	0.48
29	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費財・サービス	5,483	30,532.37 167,409,039	35,972.93 197,239,614	0.46
30	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	125,000	1,468.20 183,526,326	1,402.38 175,298,400	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	88.28%
投資証券	7.02%
合計	95.30%

(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	9.13%
素材	7.58%
資本財・サービス	4.07%
一般消費財・サービス	9.82%
生活必需品	2.83%
ヘルスケア	0.83%
金融	27.79%
情報技術	16.37%
コミュニケーション・サービス	6.32%
公益事業	2.35%
不動産	1.19%
合計	88.28%

(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 25	買建	185	1,616,490,060	1,590,460,355	3.75%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1 月	買建	100,000	14,920,560	15,796,000	0.04%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報) 運用実績

## ● FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

2024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	30,302円
純資産総額	51億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	10.6%
6カ月間	4.9%
1年間	32.3%
3年間	63.5%
5年間	130.5%
設定来	203.0%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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	1,574	96.3%	米ドル	64.5%	情報技術	24.0%	APPLE INC	アメリカ	4.5%
外国投資証券	4	1.4%	香港ドル	6.9%	金融	17.5%	NVIDIA CORP	アメリカ	3.8%
外国リート	53	1.4%	ユーロ	6.3%	一般消費財・サービス	10.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.5%
			台湾ドル	3.3%	資本財・サービス	8.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.4%
コール・ローン、その他		5.1%	英ポンド	2.8%	ヘルスケア	8.1%	S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	2.2%
合計	1,631	-	カナダ・ドル	2.5%	コミュニケーション・サービス	7.5%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.5%
国・地域別構成			インド・ルピー	2.0%	生活必需品	5.2%	TESLA INC	アメリカ	1.4%
アメリカ		64.4%	ブラジル・レアル	1.8%	エネルギー	4.7%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.4%
中国		7.8%	スイス・フラン	1.8%	素材	3.9%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
その他		27.1%	その他	7.9%	公益事業、他	2.8%	BROADCOM INC	アメリカ	1.2%
合計		99.0%	合計	100.0%	合計	92.1%	合計		23.2%

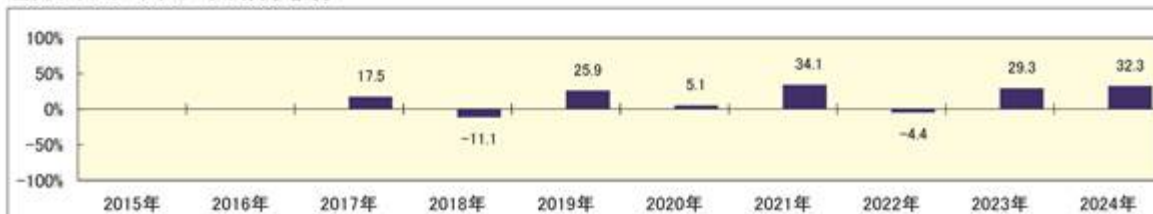
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2024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	2,264,715,742	99.90
内 日本	2,264,715,742	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,222,325	0.10
純資産総額	2,266,938,067	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】 (2024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	1,729,054,621	1.3089 2,263,206,154	1.3098 2,264,715,742	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,379,006,108	1,379,006,108	1.0010	1.0010
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,161,576,187	2,161,576,187	1.0025	1.0025
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,135,143,578	2,135,143,578	1.0249	1.0249
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,402,441,089	2,402,441,089	1.0153	1.0153
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,041,324,471	3,041,324,471	1.0151	1.0151
第6計算期間末 (2022年11月30日)	2,874,160,689	2,874,160,689	0.9712	0.9712
第7計算期間末 (2023年11月30日)	2,852,364,749	2,852,364,749	0.9585	0.9585
2023年12月末日	2,843,084,899	-	0.9624	-
2024年1月末日	2,839,392,432	-	0.9554	-
2月末日	2,870,936,060	-	0.9584	-
3月末日	2,978,897,433	-	0.9572	-
4月末日	2,295,211,521	-	0.9462	-
5月末日	2,272,431,938	-	0.9310	-
6月末日	2,268,335,925	-	0.9333	-
7月末日	2,273,377,876	-	0.9321	-
8月末日	2,290,743,371	-	0.9429	-
9月末日	2,289,566,736	-	0.9454	-
10月末日	2,263,731,163	-	0.9406	-
11月末日	2,253,454,322	-	0.9341	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	2,249,256,167	2,249,256,167	0.9324	0.9324
12月末日	2,266,938,067	-	0.9329	-

## 【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
第7計算期間	0.0000



第8計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.1
第2計算期間	0.1
第3計算期間	2.2
第4計算期間	0.9
第5計算期間	0.0
第6計算期間	4.3
第7計算期間	1.3
第8計算期間	2.7

## (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	1,498,842,558	122,203,095
第2計算期間	1,389,815,832	611,289,476
第3計算期間	844,707,447	917,630,059
第4計算期間	862,550,219	579,555,037
第5計算期間	1,226,825,775	597,072,806
第6計算期間	723,779,301	760,465,609
第7計算期間	641,695,463	625,117,092
第8計算期間	578,159,953	1,141,766,507

(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 (2024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	107,575,986,620	84.56
内 日本	107,575,986,620	84.56
地方債証券	6,311,476,800	4.96
内 日本	6,311,476,800	4.96
特殊債券	3,915,652,200	3.08
内 日本	3,915,652,200	3.08
社債券	8,907,388,400	7.00

	内 日本	8,907,388,400	7.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		510,090,717	0.40
純資産総額		127,220,594,737	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 (2024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	149 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.94 1,464,341,600	99.05 1,465,999,200	0.005000 2026/09/20	1.15
2	150 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.79 1,462,179,500	98.90 1,463,838,400	0.005000 2026/12/20	1.15
3	370 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	96.80 1,452,015,000	96.61 1,449,195,000	0.500000 2033/03/20	1.14
4	147 5年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	99.31 1,340,705,200	99.43 1,342,426,500	0.005000 2026/03/20	1.06
5	365 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	95.23 1,333,290,000	95.07 1,331,050,000	0.100000 2031/12/20	1.05
6	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	98.40 1,230,012,500	98.53 1,231,675,000	0.100000 2027/12/20	0.97
7	373 10年国債	日本	国債証券	1,160,000,000	96.78 1,122,659,100	96.59 1,120,478,800	0.600000 2033/12/20	0.88
8	163 5年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	98.97 1,118,427,500	99.05 1,119,366,700	0.400000 2028/09/20	0.88
9	369 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	97.07 1,106,609,400	96.85 1,104,101,400	0.500000 2032/12/20	0.87
10	364 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	95.49 1,088,629,800	95.36 1,087,138,200	0.100000 2031/09/20	0.85
11	354 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	97.43 1,071,818,000	97.53 1,072,852,000	0.100000 2029/03/20	0.84
12	360 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.30 1,059,373,600	96.36 1,060,015,000	0.100000 2030/09/20	0.83
13	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81

14	154 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81
15	363 10年国債	日本	国債証券	1,080,000,000	95.73 1,033,938,000	95.61 1,032,663,600	0.100000 2031/06/20	0.81
16	367 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	95.33 1,000,971,300	95.14 999,012,000	0.200000 2032/06/20	0.79
17	166 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	98.83 968,612,400	98.92 969,435,600	0.400000 2028/12/20	0.76
18	362 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.97 959,780,000	95.89 958,930,000	0.100000 2031/03/20	0.75
19	368 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.03 950,380,000	94.85 948,540,000	0.200000 2032/09/20	0.75
20	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.98 940,395,500	99.09 941,374,000	0.100000 2026/12/20	0.74
21	158 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.22 933,147,000	98.36 934,496,000	0.100000 2028/03/20	0.73
22	371 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	95.69 918,624,000	95.54 917,251,200	0.400000 2033/06/20	0.72
23	466 2年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.79 898,128,000	99.85 898,695,000	0.500000 2026/11/01	0.71
24	2 CT5年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.96 890,694,000	99.02 891,261,000	0.500000 2029/06/20	0.70
25	347 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.70 888,376,500	98.83 889,551,000	0.100000 2027/06/20	0.70
26	372 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.74 888,678,000	98.55 887,004,000	0.800000 2033/09/20	0.70
27	161 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	98.73 868,868,000	98.85 869,888,800	0.300000 2028/06/20	0.68
28	148 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	99.12 862,420,700	99.23 863,353,200	0.005000 2026/06/20	0.68
29	156 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	98.75 859,132,300	98.82 859,768,800	0.200000 2027/12/20	0.68
30	151 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	98.64 838,457,000	98.77 839,562,000	0.005000 2027/03/20	0.66

(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	84.56%
地方債証券	4.96%

特殊債券	3.08%
社債券	7.00%
合計	99.60%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FWO 日本債券インデックス

2024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	9,329円
純資産総額	22億円



※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	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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	429	99.5%	直接利回り(%)	149 5年国債	0.005	2026/09/20	1.2%
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.1%
コール・ローン、その他		0.5%	修正デュレーション	370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.1%
合計	429	100.0%	残存年数	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.1%
債券種別構成	比率	格付別構成	比率	365 10年国債	0.100	2031/12/20	1.0%
国債	84.3%	AAA	87.5%	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.0%
事業債	7.7%	AA	7.3%	373 10年国債	0.600	2033/12/20	0.9%
地方債	5.9%	A	2.9%	163 5年国債	0.400	2028/09/20	0.9%
政府保証債	1.2%	BBB	-	369 10年国債	0.500	2032/12/20	0.9%
その他	0.4%	BB以下・無格付	2.3%	364 10年国債	0.100	2031/09/20	0.9%
合計	99.5%	合計	100.0%	合計			10.0%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.3%保有しております。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】 (2024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	3,856,693,825	99.80
内 日本	3,856,693,825	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,568,018	0.20
純資産総額	3,864,261,843	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】 (2024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	4,640,469,048	0.8464 3,928,063,240	0.8311 3,856,693,825	99.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年11月30日)	2,166,190,168	2,166,190,168	1.0078	1.0078
第2計算期間末 (2018年11月30日)	3,598,169,224	3,598,169,224	0.9860	0.9860
第3計算期間末 (2019年12月2日)	3,539,153,139	3,539,153,139	1.0567	1.0567
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,993,652,896	3,993,652,896	1.1094	1.1094
第5計算期間末 (2021年11月30日)	5,184,444,357	5,184,444,357	1.0770	1.0770
第6計算期間末 (2022年11月30日)	3,789,341,941	3,789,341,941	0.9096	0.9096
第7計算期間末 (2023年11月30日)	4,087,108,529	4,087,108,529	0.8649	0.8649
2023年12月末日	4,174,195,067	-	0.8887	-
2024年1月末日	4,125,866,593	-	0.8727	-
2月末日	4,116,702,184	-	0.8627	-
3月末日	4,347,744,770	-	0.8677	-
4月末日	3,789,125,017	-	0.8507	-
5月末日	3,816,022,928	-	0.8481	-
6月末日	3,846,990,644	-	0.8558	-
7月末日	3,903,401,586	-	0.8629	-
8月末日	3,939,877,713	-	0.8709	-
9月末日	3,956,608,668	-	0.8766	-
10月末日	3,862,492,718	-	0.8564	-
11月末日	3,909,963,751	-	0.8626	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	3,919,581,594	3,919,581,594	0.8647	0.8647
12月末日	3,864,261,843	-	0.8488	-

## 【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
第7計算期間	0.0000

第8計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.8
第2計算期間	2.2
第3計算期間	7.2
第4計算期間	5.0
第5計算期間	2.9
第6計算期間	15.5
第7計算期間	4.9
第8計算期間	0.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,296,791,192	148,346,007
第2計算期間	2,190,846,317	691,122,259
第3計算期間	1,134,630,067	1,434,493,694
第4計算期間	1,133,997,978	883,504,385
第5計算期間	1,938,477,119	724,498,228
第6計算期間	881,042,439	1,528,864,291
第7計算期間	1,222,534,062	663,008,864
第8計算期間	1,099,909,120	1,292,485,007

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## (1) 投資状況 (2024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	124,970,077,095	101.35
内 ユーロ	37,879,231,817	30.72
内 中国	14,677,093,397	11.90
内 シンガポール	564,578,300	0.46
内 マレーシア	697,309,011	0.57
内 イスラエル	395,874,464	0.32
内 ノルウェー	190,578,079	0.15



内 スウェーデン	240,945,894	0.20
内 デンマーク	305,994,631	0.25
内 イギリス	6,456,858,047	5.24
内 ポーランド	640,769,620	0.52
内 カナダ	2,446,257,799	1.98
内 アメリカ	57,589,782,428	46.71
内 メキシコ	939,163,375	0.76
内 オーストラリア	1,591,807,921	1.29
内 ニュージーランド	353,832,312	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,666,662,606	1.35
純資産総額	123,303,414,489	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)	2,113,724,985	1.71
内 ドイツ	149,170,140	0.12
内 アメリカ	1,964,554,845	1.59
為替予約取引(売建)	131,685,636,363	106.80
内 日本	131,685,636,363	106.80

(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 (2024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	14,000,000	93.65 2,074,075,141	94.83 2,100,073,606	2.250000 2027/08/15	1.70
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,350,000	94.19 1,542,060,201	95.84 1,569,073,390	2.000000 2026/11/15	1.27
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.06 1,358,818,226	100.21 1,347,407,294	4.500000 2026/03/31	1.09

4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,950,000	105.63 1,328,430,597	104.81 1,318,068,542	6.125000 2027/11/15	1.07
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.91 1,201,153,957	95.81 1,212,418,064	2.250000 2027/02/15	0.98
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.15 1,108,940,876	99.97 1,106,994,257	4.250000 2026/01/31	0.90
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	94.42 1,025,323,020	96.44 1,047,345,188	1.625000 2026/05/15	0.85
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.11 957,401,058	93.22 958,501,200	2.625000 2029/02/15	0.78
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	100.42 953,132,571	99.77 946,944,570	4.375000 2028/11/30	0.77
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	93.62 851,515,762	95.58 869,360,839	1.500000 2026/08/15	0.71
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	91.04 864,095,713	90.02 854,428,251	1.750000 2029/01/31	0.69
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	94.35 828,341,601	95.58 839,122,201	2.375000 2027/05/15	0.68
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	89.30 776,970,669	90.55 787,845,544	1.250000 2028/03/31	0.64
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	103.19 816,153,437	99.17 784,390,893	4.250000 2029/06/30	0.64
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,900,000	87.98 821,152,399	83.82 782,334,869	1.875000 2032/02/15	0.63
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	102.17 727,320,339	99.21 706,243,645	4.500000 2033/11/15	0.57
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	94.66 673,799,346	96.51 687,017,657	1.875000 2026/06/30	0.56
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	93.79 667,620,835	91.58 651,911,188	3.375000 2033/05/15	0.53
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	95.35 648,552,710	95.41 649,001,625	3.125000 2028/11/15	0.53
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	81.51 644,702,135	81.54 644,915,678	0.875000 2030/11/15	0.52
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	88.09 627,097,491	89.82 639,376,214	0.625000 2027/11/30	0.52
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	82.51 639,589,915	82.24 637,458,440	1.125000 2031/02/15	0.52
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	86.39 614,961,131	86.52 615,907,838	1.500000 2030/02/15	0.50

24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	84.68 616,177,219	84.06 611,644,096	1.625000 2031/05/15	0.50
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	93.44 591,219,895	96.20 608,701,948	0.375000 2025/12/31	0.49
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,700,000	81.91 608,986,356	81.33 604,659,500	1.250000 2031/08/15	0.49
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.58 598,470,866	95.25 602,672,127	2.750000 2028/02/15	0.49
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.57 598,363,304	94.85 600,179,210	2.875000 2028/08/15	0.49
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	92.44 584,918,004	94.38 597,161,136	1.250000 2026/11/30	0.48
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.83 600,008,376	92.70 586,575,730	3.500000 2033/02/15	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	101.35%
合計	101.35%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND MAR 25	買建	2	37,395,739	35,837,656	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 25	買建	10	174,917,469	171,526,438	0.14%
		US 5YR NOTE MAR 25	買建	15	254,312,724	251,598,878	0.20%
		US 2YR NOTE MAR 25	買建	40	1,301,791,599	1,299,349,869	1.05%
		US ULTRA T-BOND MAR 25	買建	11	218,101,099	206,242,004	0.17%
	ドイツ	EURO-SCHATZ MAR 25	買建	5	88,625,864	88,190,970	0.07%

		EURO-OAT MAR 25	買建	3	62,375,581	60,979,170	0.05%
為替予約取引	日本	イスラエル・シケル 売/円買 2025年1月	売建	9,521,000	391,560,646	408,238,581	0.33%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2025年1月	売建	15,718,000	212,461,777	218,855,860	0.18%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2025年1月	売建	19,066,000	699,470,528	734,544,342	0.60%
		豪ドル売/円買 2025年1 月	売建	17,192,000	1,674,062,404	1,691,249,246	1.37%
		カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	22,804,000	2,437,302,922	2,500,987,652	2.03%
		メキシコ・ペソ売/円買 2025年1月	売建	132,169,000	968,494,781	1,024,018,978	0.83%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2025年1月	売建	22,059,000	302,543,596	317,215,037	0.26%
		ユーロ売/円買 2025年1 月	売建	241,584,000	38,191,020,992	39,808,525,579	32.29%
		米ドル売/円買 2025年1 月	売建	385,354,000	57,584,382,549	60,878,224,920	49.37%
		マレーシア・リングgit 売/円買 2025年1月	売建	19,130,000	673,004,878	674,923,617	0.55%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2025年1月	売建	5,029,000	561,447,618	585,409,797	0.47%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2025年1月	売建	4,284,000	378,865,821	381,562,171	0.31%
		英ポンド売/円買 2025年 1月	売建	35,854,000	6,809,585,174	7,125,946,646	5.78%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2025年1月	売建	18,525,000	392,817,067	409,289,497	0.33%
オフショア人民元売/円 買 2025年1月	売建	689,771,000	14,239,064,957	14,926,644,440	12.11%		

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ● FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2024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	8,488円
純資産総額	38億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.6%
3カ月間	-3.2%
6カ月間	-0.8%
1年間	-4.5%
3年間	-20.5%
5年間	-19.2%
設定来	-15.1%



※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	直近1年間分配金合計額: 0円								設定来分配金合計額: 0円	
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月	第6期 22年11月	第7期 23年11月	第8期 24年12月		
分配金	0円	0円	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	691	102.9%	日本円	102.7%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.7%
			オフショア人民元	0.1%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.3%
コール・ローン、その他		-1.2%	マレーシア・リンギット	0.0%	修正デュレーション	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2026/03/31	1.1%
合計	691	-	カナダ・ドル	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	1.1%
債券種別構成			デンマーク・クローネ	0.0%	格付別構成	US 2YR NOTE MAR 25	-	1.1%
国債		101.2%	南アフリカ・ランド	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2027/02/15	1.0%
			イスラエル・シケル	-0.0%	AA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2026/01/31	0.9%
			ニュージーランド・ドル	-0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.8%
			ノルウェー・クローネ	-0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.8%
			その他	-2.8%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2028/11/30	0.8%
合計		101.2%	合計	100.0%	合計	合計		10.4%

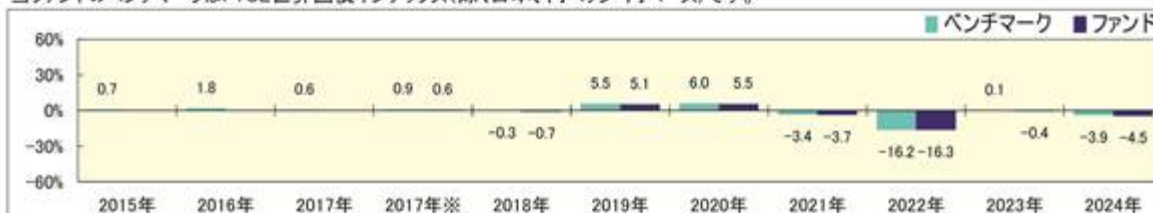
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】(2024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	5,370,730,800	99.81
内 日本	5,370,730,800	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,416,259	0.19
純資産総額	5,381,147,059	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】 (2024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	1,141,628,521	3.6432 4,159,233,364	3.7621 4,294,920,658	79.81
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	557,501,240	1.8542 1,033,767,048	1.9297 1,075,810,142	19.99

(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	99.81%
合計	99.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,406,787,686	1,406,787,686	1.0477	1.0477
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,442,336,372	2,442,336,372	1.0222	1.0222
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,833,746,066	2,833,746,066	1.0673	1.0673
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,462,912,432	2,462,912,432	1.1005	1.1005
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,297,505,349	3,297,505,349	1.1365	1.1365
第6計算期間末 (2022年11月30日)	2,432,981,317	2,432,981,317	1.1571	1.1571
第7計算期間末 (2023年11月30日)	3,650,211,153	3,650,211,153	1.2772	1.2772
2023年12月末日	3,622,621,301	-	1.2756	-
2024年1月末日	3,703,694,528	-	1.2992	-
2月末日	3,764,329,012	-	1.3167	-
3月末日	3,815,205,340	-	1.3300	-
4月末日	5,163,105,334	-	1.3552	-
5月末日	5,231,927,993	-	1.3638	-
6月末日	5,368,910,991	-	1.4042	-
7月末日	5,157,198,375	-	1.3541	-
8月末日	5,053,300,694	-	1.3218	-
9月末日	5,088,593,459	-	1.3295	-
10月末日	5,295,774,791	-	1.3791	-
11月末日	5,184,703,672	-	1.3487	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	5,175,978,833	5,175,978,833	1.3465	1.3465
12月末日	5,381,147,059	-	1.3923	-

## 【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.4
第4計算期間	3.1
第5計算期間	3.3
第6計算期間	1.8
第7計算期間	10.4
第8計算期間	5.4

## (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	1,434,988,289	93,204,954
第2計算期間	1,446,419,314	399,973,906
第3計算期間	1,008,953,213	743,168,804
第4計算期間	695,143,661	1,112,174,309
第5計算期間	1,085,864,243	422,369,928
第6計算期間	442,770,444	1,241,538,970
第7計算期間	1,172,196,883	416,876,633
第8計算期間	1,644,957,223	658,871,873

(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 (2024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	329,561,475,020	97.63
内 ユーロ	98,988,156,413	29.32
内 中国	37,401,130,797	11.08
内 シンガポール	1,183,190,219	0.35



内 マレーシア	1,652,564,172	0.49
内 イスラエル	981,866,029	0.29
内 ノルウェー	449,279,632	0.13
内 スウェーデン	470,488,647	0.14
内 デンマーク	677,336,592	0.20
内 イギリス	16,896,608,775	5.01
内 ポーランド	1,667,863,602	0.49
内 カナダ	6,186,807,335	1.83
内 アメリカ	155,950,958,216	46.20
内 メキシコ	2,303,723,398	0.68
内 オーストラリア	3,954,516,301	1.17
内 ニュージーランド	796,984,892	0.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,000,731,379	2.37
純資産総額	337,562,206,399	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,731,096,765	0.51
内 日本	1,731,096,765	0.51

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

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

(注3) 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 (2024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	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,859,386,851	101.70 1,872,607,291	1.850000 2027/05/15	0.55
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,701,056,647	94.85 1,650,388,429	3.875000 2033/08/15	0.49
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,608,365,710	102.66 1,623,435,886	2.050000 2029/04/15	0.48
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,618,434,488	99.21 1,569,430,324	4.500000 2033/11/15	0.46
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,618,703,394	94.24 1,565,255,953	3.875000 2034/08/15	0.46

6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,422,144,971	82.24 1,392,001,083	1.125000 2031/02/15	0.41
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,323,855,025	102.38 1,330,665,621	2.390000 2026/11/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,364,205,219	88.39 1,328,335,531	2.750000 2032/08/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,356,321,369	81.33 1,325,104,863	1.250000 2031/08/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,363,111,404	98.14 1,319,629,304	4.375000 2034/05/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	91.87 1,351,490,394	89.52 1,316,920,155	2.875000 2032/05/15	0.39
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,292,252,908	103.84 1,304,703,908	2.370000 2029/01/15	0.39
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,307,576,779	98.14 1,288,500,429	4.000000 2029/07/31	0.38
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,319,411,016	81.43 1,288,138,830	1.375000 2031/11/15	0.38
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,289,472,920	81.54 1,264,034,728	0.875000 2030/11/15	0.37
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	98.51 1,277,814,421	95.43 1,237,864,480	4.000000 2034/02/15	0.37
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	96.32 1,177,582,525	96.44 1,179,159,644	1.625000 2026/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,206,951,363	92.70 1,173,151,460	3.500000 2033/02/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	85.94 1,182,773,392	84.06 1,156,805,139	1.625000 2031/05/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,126,423,568	105.44 1,142,128,663	2.540000 2030/12/25	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	94.32 1,163,822,637	91.58 1,129,979,393	3.375000 2033/05/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,096,718,884	98.49 1,090,628,954	3.750000 2027/08/15	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,151,373,238	96.82 1,072,137,712	4.625000 2054/05/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 1,045,275,585	94.39 1,045,231,294	1.125000 2026/10/31	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	99.87 1,058,491,840	97.21 1,030,301,000	4.125000 2032/11/15	0.31

26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 1,042,849,104	80.94 1,024,361,025	0.625000 2030/08/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	95.76 1,014,902,019	94.85 1,005,300,177	2.875000 2028/08/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	90.08 997,441,953	89.61 992,226,758	0.750000 2028/01/31	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	102.43 976,307,555	104.00 991,319,460	2.280000 2031/03/25	0.29
30	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	100.68 959,694,381	103.69 988,374,267	2.110000 2034/08/25	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.63%
合計	97.63%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2025年1月	買建	295,000	57,271,816	58,644,857	0.02%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2025年1月	買建	595,000	52,491,554	52,994,746	0.02%
		オフショア人民元買/円売 2025年1月	買建	26,825,000	556,578,360	580,512,483	0.17%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	3,052,000	475,309,857	482,262,300	0.14%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2025年1月	買建	848,000	11,623,366	12,194,494	0.00%

ノルウェー・クローネ 買/円売 2025年1月	買建	1,911,000	25,771,172	26,608,572	0.01%
カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	671,000	72,177,138	73,596,623	0.02%
メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	14,865,000	108,144,361	115,171,047	0.03%
ユーロ買/円売 2025年1 月	買建	1,997,000	324,038,591	329,111,643	0.10%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

#### (1) 投資状況（2024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	50,237,477,132	97.06
内 中国	5,234,762,800	10.11
内 タイ	4,888,279,344	9.44
内 マレーシア	5,175,469,649	10.00
内 インドネシア	5,060,499,715	9.78
内 インド	3,102,256,219	5.99
内 ポーランド	3,650,743,941	7.05
内 ハンガリー	1,252,286,247	2.42
内 セルビア	165,057,924	0.32
内 ルーマニア	1,739,256,729	3.36
内 トルコ	701,311,135	1.35
内 チェコ	2,725,281,525	5.27
内 メキシコ	5,088,529,215	9.83
内 ドミニカ共和国	128,634,952	0.25
内 コロンビア	1,911,659,466	3.69
内 ペルー	1,077,251,633	2.08
内 チリ	880,598,511	1.70
内 ブラジル	3,117,755,402	6.02
内 ウルグアイ	90,040,975	0.17
内 南アフリカ	4,247,801,750	8.21

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,521,514,018	2.94
純資産総額	51,758,991,150	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)	355,162,950	0.69
内 日本	355,162,950	0.69

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

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

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

## (2) 投資資産 (2024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	31,500,000	80.19 643,421,870	80.25 643,911,311	- 2026/07/01	1.24
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	26,000,000	84.99 562,870,330	86.54 573,178,670	- 2026/01/01	1.11
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	78,020,000	76.12 503,023,339	80.60 532,635,104	8.750000 2048/02/28	1.03
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,650,000	104.12 517,232,238	104.16 517,455,783	10.500000 2026/12/21	1.00
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	63,000,000	92.60 494,133,532	95.85 511,507,873	8.000000 2030/01/31	0.99
6	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	68,700,000	89.43 477,850,957	91.57 489,252,686	5.500000 2027/03/04	0.95
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,500,000	93.00 473,761,903	95.37 485,841,450	5.750000 2026/03/05	0.94
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	61,700,000	86.16 450,271,298	91.14 476,296,728	8.875000 2035/02/28	0.92
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,850,000	89.20 470,733,867	89.34 471,437,286	7.750000 2031/05/29	0.91
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	59,800,000	88.17 446,586,340	92.73 469,718,469	8.250000 2032/03/31	0.91
11	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	21,400,000	93.86 511,638,495	84.48 460,524,794	10.000000 2029/01/01	0.89

12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	60,500,000	93.46 439,750,910	94.98 446,933,402	7.500000 2027/06/03	0.86
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	80.05 398,702,719	85.03 423,499,932	8.500000 2037/01/31	0.82
14	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	18,000,000	96.76 443,669,340	90.92 416,888,799	10.000000 2027/01/01	0.81
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	54,730,000	94.28 401,320,136	94.77 403,410,400	8.500000 2029/05/31	0.78
16	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	53,000,000	94.68 390,270,815	94.70 390,366,054	8.500000 2029/03/01	0.75
17	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	52,000,000	93.53 378,259,118	95.72 387,141,860	7.000000 2026/09/03	0.75
18	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	106.96 388,119,805	106.67 387,074,755	7.500000 2028/07/25	0.75
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	101.83 389,186,124	100.94 385,761,919	6.000000 2033/10/25	0.75
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	62,620,000	80.52 392,169,090	76.85 374,299,941	7.750000 2042/11/13	0.72
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	87.27 365,524,294	88.59 371,052,958	2.750000 2029/10/25	0.72
22	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	85.76 369,537,438	84.58 364,448,909	7.500000 2033/05/26	0.70
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	80.38 336,324,388	85.28 356,851,975	9.000000 2040/01/31	0.69
24	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	96.23 342,339,274	96.20 342,232,552	6.375000 2032/04/15	0.66
25	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	76.61 309,518,955	81.18 328,014,945	8.750000 2044/01/31	0.63
26	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	54,800,000	80.58 343,444,733	75.87 323,355,039	8.000000 2053/07/31	0.62
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,000,000	86.20 321,796,355	83.82 312,927,152	7.750000 2034/11/23	0.60
28	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	94.79 299,712,057	96.19 304,125,585	2.500000 2026/07/25	0.59
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	26,920,000,000	109.07 287,744,111	108.66 286,678,294	8.375000 2034/03/15	0.55
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,400,000	77.35 280,697,416	78.83 286,064,181	1.250000 2030/10/25	0.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.06%
合計	97.06%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	チェコ・コルナ買/円売 2025年1月	買建	19,000,000	124,374,000	124,197,300	0.24%
		米ドル買/円売 2025年1 月	買建	800,000	126,422,640	126,432,000	0.24%
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	5,000,000	38,774,000	38,783,000	0.07%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2025年1月	買建	500,000	18,274,410	19,259,400	0.04%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2025年1月	買建	5,500,000	45,922,375	46,491,250	0.09%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報) 運用実績

## ● FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

2024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	13,923円
純資産総額	53億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.2%
3カ月間	4.7%
6カ月間	-0.8%
1年間	9.1%
3年間	21.3%
5年間	29.2%
設定来	39.2%



※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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円								設定来分配金合計額: 0円	
	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期		
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月		
分配金	0円	0円	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。

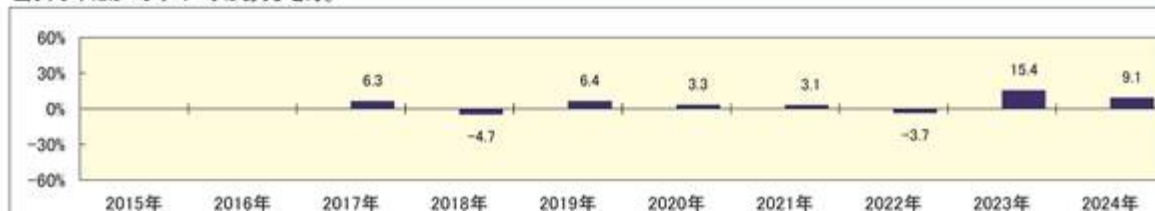
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率	
外国債券	1,286	97.3%	米ドル	37.5%	直接利回り(%)	CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.5%	
			ユーロ	23.9%	最終利回り(%)	CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%	
			オフショア人民元	11.2%	修正デュレーション	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/08/15	0.4%	
コール・ローン、その他	2.7%		英ポンド	4.1%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.4%	
合計	1,286	100.0%	メキシコ・ペソ	2.6%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.4%	
			マレーシア・リンギット	2.4%	AAA	58.6%	CHINA GOVERNMENT BOND	2026/11/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	2.0%	AA	19.8%	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.3%
			タイ・バーツ	1.9%	A	15.5%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.3%
			ポーランド・ズロチ	1.9%	BBB	5.7%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.3%
			その他	12.5%	BB	0.3%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/05/15	0.3%
合計		97.3%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.6%	

※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、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン J - R E I T インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------



親投資信託受益証券	1,986,684,018	99.95
内 日本	1,986,684,018	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,001,851	0.05
純資産総額	1,987,685,869	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】(2024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	636,859,759	3.1073 1,978,967,253	3.1195 1,986,684,018	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年11月30日)	564,311,815	564,311,815	0.9372	0.9372
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,027,403,305	1,027,403,305	1.0585	1.0585
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,183,900,381	1,183,900,381	1.3333	1.3333
第4計算期間末 (2020年11月30日)	1,177,153,445	1,177,153,445	1.0596	1.0596
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,679,344,805	1,679,344,805	1.2998	1.2998
第6計算期間末 (2022年11月30日)	1,673,658,974	1,673,658,974	1.3237	1.3237
第7計算期間末 (2023年11月30日)	1,588,054,197	1,588,054,197	1.2902	1.2902
2023年12月末日	1,573,562,307	-	1.2688	-
2024年1月末日	1,595,489,187	-	1.2674	-
2月末日	1,543,945,514	-	1.2056	-
3月末日	1,802,775,950	-	1.2759	-
4月末日	1,926,253,787	-	1.2888	-
5月末日	1,873,805,491	-	1.2440	-
6月末日	1,892,159,216	-	1.2366	-
7月末日	1,942,148,532	-	1.2403	-
8月末日	2,002,260,995	-	1.2750	-
9月末日	1,968,219,254	-	1.2538	-
10月末日	1,944,265,805	-	1.2254	-
11月末日	1,956,740,383	-	1.2144	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	1,950,033,601	1,950,033,601	1.2103	1.2103
12月末日	1,987,685,869	-	1.2146	-

## 【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
第7計算期間	0.0000

第8計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.3
第2計算期間	12.9
第3計算期間	26.0
第4計算期間	20.5
第5計算期間	22.7
第6計算期間	1.8
第7計算期間	2.5
第8計算期間	6.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	639,909,329	38,785,261
第2計算期間	587,481,644	218,964,687
第3計算期間	281,360,657	364,052,038
第4計算期間	494,302,320	271,347,931
第5計算期間	469,805,021	288,734,255
第6計算期間	340,231,260	367,796,144
第7計算期間	281,356,784	314,867,274
第8計算期間	605,515,174	225,229,007

(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 (2024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	256,272,413,516	96.55
内 日本	256,272,413,516	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,152,197,159	3.45
純資産総額	265,424,610,675	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)		9,153,200,000	3.45
	内 日本	9,153,200,000	3.45

(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 (2024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	156,018	135,124.92 21,081,921,045	122,400.00 19,096,603,200	7.19
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	137,377	118,330.10 16,255,834,641	107,900.00 14,822,978,300	5.58
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	138,698	101,068.66 14,018,022,106	90,200.00 12,510,559,600	4.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	85,621	151,202.24 12,946,087,280	137,700.00 11,790,011,700	4.44
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	74,832	154,542.00 11,564,687,160	149,500.00 11,187,384,000	4.21
6	GLP投資法人	日本	投資証券	89,846	135,128.57 12,140,762,239	123,400.00 11,086,996,400	4.18
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	46,596	267,755.64 12,476,342,176	222,900.00 10,386,248,400	3.91
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	147,371	58,073.25 8,558,313,070	66,200.00 9,755,960,200	3.68
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	39,889	235,181.83 9,381,168,201	231,800.00 9,246,270,200	3.48
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	53,295	155,475.95 8,286,090,852	164,100.00 8,745,709,500	3.29
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	59,401	140,297.92 8,333,836,789	140,800.00 8,363,660,800	3.15
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	26,287	336,149.58 8,836,364,188	292,400.00 7,686,318,800	2.90
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	98,265	68,629.73 6,743,901,313	70,600.00 6,937,509,000	2.61

14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	80,376	80,353.83 6,458,520,073	77,300.00 6,213,064,800	2.34
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	58,304.94	108,254.92 6,311,797,353	101,500.00 5,917,951,816	2.23
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	18,293	352,775.63 6,453,324,612	315,500.00 5,771,441,500	2.17
17	産業ファンド	日本	投資証券	48,974	120,748.00 5,913,512,785	114,900.00 5,627,112,600	2.12
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	9,236	658,381.27 6,080,809,461	587,000.00 5,421,532,000	2.04
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	34,244	144,786.71 4,958,076,180	142,100.00 4,866,072,400	1.83
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,972	277,305.17 4,983,728,613	263,200.00 4,730,230,400	1.78
21	API投資法人	日本	投資証券	13,001	326,026.70 4,238,673,243	328,500.00 4,270,828,500	1.61
22	イオンリート投資	日本	投資証券	32,811	135,026.70 4,430,361,323	126,700.00 4,157,153,700	1.57
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	31,453	127,183.56 4,000,304,679	123,900.00 3,897,026,700	1.47
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	49,622	86,537.49 4,294,163,452	77,700.00 3,855,629,400	1.45
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	13,543	331,568.96 4,490,438,481	277,900.00 3,763,599,700	1.42
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	39,505	101,989.12 4,029,080,581	89,100.00 3,519,895,500	1.33
27	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	27,187	116,411.23 3,164,872,257	119,600.00 3,251,565,200	1.23
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,635	140,160.11 3,312,684,357	137,300.00 3,245,085,500	1.22
29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	9,236	374,273.23 3,456,787,593	346,500.00 3,200,274,000	1.21
30	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	51,557	64,871.65 3,344,587,897	61,600.00 3,175,911,200	1.20

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.55%
合計	96.55%

(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 0703月	買建	5,600	9,004,856,000	9,153,200,000	3.45%

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●FWO J-REITインデックス

2024年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	12,146円
純資産総額	19億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	-3.1%
6カ月間	-1.8%
1年間	-4.3%
3年間	-9.7%
5年間	-6.6%
設定来	21.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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	種別構成	比率	組入上位10銘柄	種別名	比率
国内リート	57	96.5%	各種不動産投資信託	29.6%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	7.2%
国内リート 先物	1	3.4%	オフィス不動産投資信託	23.8%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産投資信託	5.6%
			工業用不動産投資信託	18.4%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産投資信託	4.7%
			店舗用不動産投資信託	8.6%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	4.4%
			集合住宅用不動産投資信託	8.2%	KDX不動産投資法人	各種不動産投資信託	4.2%
			ホテル/リゾート不動産投資信託	7.6%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.2%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.3%	日本プロジスリート	工業用不動産投資信託	3.9%
					インヴェンシブル投資法人	ホテル/リゾート不動産投資信託	3.7%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.5%
コール・ローン、その他		3.5%			TREIT 先物 0703月	-	3.4%
合計	58	-	合計	96.5%	合計		44.8%

※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。

※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REIT指数(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】 (2024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		975,064,802	99.98
	内 日本	975,064,802	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		163,721	0.02
純資産総額		975,228,523	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】（2024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	1,119,348,872	0.9459 1,058,872,407	0.8711 975,064,802	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)



第1計算期間末 (2017年11月30日)	451,251,233	451,251,233	1.0301	1.0301
第2計算期間末 (2018年11月30日)	767,151,864	767,151,864	1.0317	1.0317
第3計算期間末 (2019年12月2日)	839,510,983	839,510,983	1.1735	1.1735
第4計算期間末 (2020年11月30日)	822,409,605	822,409,605	1.0306	1.0306
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,062,472,724	1,062,472,724	1.3476	1.3476
第6計算期間末 (2022年11月30日)	855,553,653	855,553,653	1.0736	1.0736
第7計算期間末 (2023年11月30日)	891,140,513	891,140,513	0.9985	0.9985
2023年12月末日	975,678,292	-	1.1063	-
2024年1月末日	922,042,199	-	1.0501	-
2月末日	931,531,781	-	1.0434	-
3月末日	992,709,897	-	1.0751	-
4月末日	890,176,121	-	1.0115	-
5月末日	914,758,593	-	1.0212	-
6月末日	935,324,929	-	1.0389	-
7月末日	1,008,483,382	-	1.1057	-
8月末日	1,041,221,068	-	1.1430	-
9月末日	1,070,249,375	-	1.1801	-
10月末日	1,046,449,360	-	1.1588	-
11月末日	1,068,202,467	-	1.1763	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	1,062,218,686	1,062,218,686	1.1697	1.1697
12月末日	975,228,523	-	1.0765	-

## 【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
第7計算期間	0.0000

第8計算期間	0.0000
--------	--------

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	0.2
第3計算期間	13.7
第4計算期間	12.2
第5計算期間	30.8
第6計算期間	20.3
第7計算期間	7.0
第8計算期間	17.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	464,575,492	36,518,861
第2計算期間	460,818,025	155,301,672
第3計算期間	207,870,721	236,041,881
第4計算期間	336,517,235	253,930,894
第5計算期間	216,237,612	225,812,573
第6計算期間	256,539,172	248,047,491
第7計算期間	244,526,761	148,947,400
第8計算期間	252,406,519	236,775,308

(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 (2024年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	403,044,617	1.51
内 アメリカ	403,044,617	1.51
投資証券	26,498,004,453	99.35
内 ガーンジー	38,114,699	0.14
内 韓国	46,846,376	0.18
内 香港	232,395,993	0.87
内 シンガポール	854,592,314	3.20

内 イスラエル	38,729,545	0.15
内 イギリス	1,077,933,854	4.04
内 アイルランド	8,846,863	0.03
内 オランダ	32,017,342	0.12
内 ベルギー	198,254,017	0.74
内 フランス	399,300,487	1.50
内 ドイツ	7,533,664	0.03
内 スペイン	97,014,152	0.36
内 イタリア	2,741,538	0.01
内 カナダ	337,348,895	1.26
内 アメリカ	21,044,780,170	78.91
内 オーストラリア	2,057,802,591	7.72
内 ニュージーランド	23,751,953	0.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	230,824,392	0.87
純資産総額	26,670,224,678	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)	1,303,981,380	4.89
内 ドイツ	223,888,795	0.84
内 アメリカ	1,080,092,585	4.05
為替予約取引(売建)	29,732,918,527	111.48
内 日本	29,732,918,527	111.48

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

(注2) 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 (2024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	107,511	19,558.00 2,102,716,171	16,646.86 1,789,720,909	6.71
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	11,200	133,488.26 1,495,069,330	149,109.95 1,670,031,539	6.26
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	68,668	18,685.17 1,283,075,601	19,772.50 1,357,738,030	5.09

4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	36,195	24,003.81 868,818,236	28,178.18 1,019,909,413	3.82
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	35,601	24,928.06 887,468,014	27,208.54 968,651,297	3.63
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	18,294	51,137.37 935,507,235	47,153.45 862,625,361	3.23
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	236,727	3,484.63 824,914,089	3,633.66 860,186,614	3.23
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	101,595	9,545.68 969,811,716	8,329.75 846,261,845	3.17
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,489	33,899.39 558,968,371	34,986.25 576,888,316	2.16
10	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	24,607	26,496.25 651,994,435	23,424.87 576,415,929	2.16
11	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	34,065	17,279.58 588,629,617	16,564.60 564,273,426	2.12
12	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	122,369	5,018.41 614,102,771	4,577.72 560,172,144	2.10
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	48,697	9,316.96 453,712,829	9,315.22 453,623,278	1.70
14	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	39,632	11,296.74 447,713,392	11,322.52 448,734,287	1.68
15	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	28,710	15,024.25 431,346,499	14,038.47 403,044,617	1.51
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	66,134	5,562.39 367,864,835	5,077.57 335,800,543	1.26
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	7,460	45,384.53 338,568,701	44,991.13 335,633,885	1.26
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	13,568	24,324.44 330,035,014	24,320.17 329,976,134	1.24
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	78,248	3,496.88 273,631,871	3,696.66 289,256,768	1.08
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	18,055	17,973.04 324,505,413	15,557.00 280,881,689	1.05
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	13,900	20,882.76 290,271,312	19,560.53 271,891,489	1.02
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	81,192	3,456.07 280,609,251	3,176.25 257,886,447	0.97
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	31,852	7,865.34 250,531,430	7,568.91 241,085,017	0.90

24	UDR INC	アメリカ	投資証券	34,855	6,643.24 231,554,204	6,866.59 239,335,127	0.90
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	22,177	11,294.84 250,486,227	10,534.78 233,629,993	0.88
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	81,144	2,571.69 208,684,467	2,843.28 230,715,559	0.87
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	12,384	18,995.99 235,247,844	18,227.08 225,724,176	0.85
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	644,344	338.74 218,277,261	347.70 224,041,631	0.84
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	18,962	11,136.03 211,164,161	11,697.41 221,806,307	0.83
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	159,462	1,792.57 285,876,155	1,379.20 219,931,362	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.51%
投資証券	99.35%
合計	100.87%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	191	1,127,489,972	1,080,092,585	4.05%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	216	223,973,577	223,888,795	0.84%
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2025年1 月	売建	150,870,800	22,544,756,971	23,831,551,568	89.36%

ユーロ売/円買 2025年1月	売建	5,194,300	819,147,343	855,851,305	3.21%
香港ドル売/円買 2025年1月	売建	12,634,000	242,656,184	257,077,895	0.96%
豪ドル売/円買 2025年1月	売建	21,680,700	2,104,600,780	2,132,548,340	8.00%
カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	3,498,300	373,094,744	383,635,822	1.44%
シンガポール・ドル売/ 円買 2025年1月	売建	7,696,500	858,121,267	895,845,662	3.36%
ニュージーランド・ドル 売/円買 2025年1月	売建	364,200	32,118,178	32,434,377	0.12%
英債券売/円買 2025年 1月	売建	6,553,000	1,243,049,054	1,302,224,610	4.88%
イスラエル・シケル 売/円買 2025年1月	売建	973,800	40,052,394	41,748,948	0.16%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ● FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2024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	10,765円
純資産総額	9.7億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-8.5%
3カ月間	-8.8%
6カ月間	3.6%
1年間	-2.7%
3年間	-24.1%
5年間	-7.0%
設定来	7.7%



※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	直近1年間分配金合計額: 0円								設定来分配金合計額: 0円	
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月	第6期 22年11月	第7期 23年11月	第8期 24年12月		
分配金	0円	0円	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。

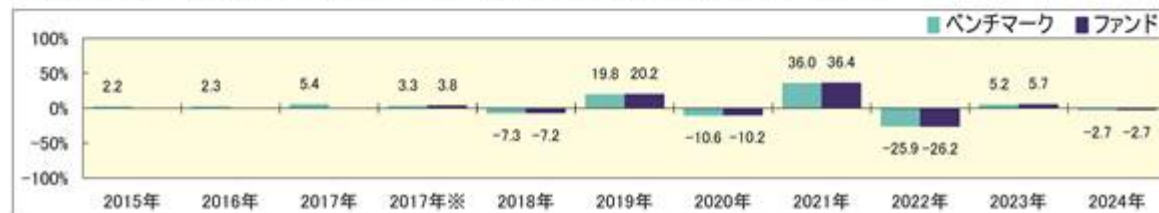
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	290	104.2%	日本円	107.4%	小売	19.5%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.7%
外国投資信託等	2	1.5%	韓国ウォン	0.3%	産業用	15.7%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	6.3%
コール・ローン、その他		-0.8%	ユーロ	0.1%	住宅	14.5%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	5.1%
合計	292	-	イスラエル・シケル	0.0%	ヘルスケア	12.2%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	-	アメリカ	4.0%
国・地域別構成			ニュージーランド・ドル	0.0%	データセンター	10.3%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.8%
アメリカ		84.5%	香港ドル	0.0%	倉庫	8.9%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.6%
オーストラリア		7.7%	シンガポール・ドル	-0.0%	ダイバーシファイド	7.4%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.2%
イギリス		4.0%	カナダ・ドル	-0.1%	オフィススペース	4.4%	GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.2%
シンガポール		3.2%	豪ドル	-0.3%	特殊	3.8%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.2%
その他		6.3%	その他	-7.4%	その他	2.7%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.2%
合計		105.7%	合計	100.0%	合計	99.3%	合計			41.4%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,426,684,276	100.00
内 日本	1,426,684,276	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	56,699	0.00
純資産総額	1,426,740,975	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】 (2024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	348,558,373	4.2090 1,467,107,764	4.0931 1,426,684,276	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11月30日)	312,291,612	312,291,612	1.0273	1.0273
第2計算期間末 (2018年11月30日)	561,256,874	561,256,874	1.0501	1.0501
第3計算期間末 (2019年12月2日)	595,752,247	595,752,247	1.1725	1.1725
第4計算期間末 (2020年11月30日)	602,823,641	602,823,641	0.9969	0.9969
第5計算期間末 (2021年11月30日)	912,628,770	912,628,770	1.4202	1.4202
第6計算期間末 (2022年11月30日)	792,267,249	792,267,249	1.4048	1.4048
第7計算期間末 (2023年11月30日)	905,435,991	905,435,991	1.4726	1.4726
2023年12月末日	964,146,184	-	1.5908	-
2024年1月末日	953,335,929	-	1.5759	-
2月末日	976,742,588	-	1.6034	-
3月末日	1,006,608,143	-	1.6662	-
4月末日	1,266,090,403	-	1.6347	-
5月末日	1,300,855,541	-	1.6608	-
6月末日	1,367,502,736	-	1.7402	-
7月末日	1,394,811,316	-	1.7675	-
8月末日	1,391,300,541	-	1.7584	-
9月末日	1,424,872,740	-	1.8030	-
10月末日	1,484,807,491	-	1.8996	-
11月末日	1,481,998,777	-	1.8955	-
第8計算期間末 (2024年12月2日)	1,469,048,927	1,469,048,927	1.8790	1.8790
12月末日	1,426,740,975	-	1.8263	-

## 【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	2.2
第3計算期間	11.7
第4計算期間	15.0
第5計算期間	42.5
第6計算期間	1.1
第7計算期間	4.8
第8計算期間	27.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	323,203,250	29,221,075
第2計算期間	333,551,014	103,078,923
第3計算期間	146,810,171	173,148,380
第4計算期間	262,282,042	165,703,268
第5計算期間	194,621,133	156,693,618
第6計算期間	125,371,635	204,019,892
第7計算期間	149,533,418	98,661,302
第8計算期間	310,734,109	143,744,169

(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 (2024年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,169,404,968	2.41
内 アメリカ	1,169,404,968	2.41
投資証券	45,980,596,214	94.74
内 ガーンジィ	64,537,239	0.13

内 韓国	74,209,961	0.15
内 香港	400,803,882	0.83
内 シンガポール	1,462,102,253	3.01
内 イスラエル	65,161,614	0.13
内 イギリス	1,884,279,250	3.88
内 アイルランド	13,358,296	0.03
内 オランダ	52,096,823	0.11
内 ベルギー	335,240,995	0.69
内 フランス	686,244,707	1.41
内 ドイツ	12,486,370	0.03
内 スペイン	166,474,234	0.34
内 イタリア	3,909,646	0.01
内 カナダ	578,406,097	1.19
内 アメリカ	36,591,851,397	75.39
内 オーストラリア	3,548,765,058	7.31
内 ニュージーランド	40,668,392	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,385,754,381	2.86
純資産総額	48,535,755,563	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)	1,436,275,772	2.96
内 ドイツ	373,147,992	0.77
内 アメリカ	1,063,127,780	2.19
為替予約取引(買建)	537,788,422	1.11
内 日本	537,788,422	1.11

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

(注2) 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 (2024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	187,400	18,404.24 3,448,984,718	16,646.86 3,119,622,164	6.43

2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,506	154,857.42 3,020,649,077	149,109.95 2,908,538,856	5.99
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	119,635	21,744.53 2,601,414,249	19,772.50 2,365,483,038	4.87
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	63,004	30,837.50 1,942,886,464	28,178.18 1,775,338,380	3.66
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	62,030	28,983.79 1,797,873,247	27,208.54 1,687,745,848	3.48
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	31,803	54,821.23 1,743,482,762	47,153.45 1,499,621,425	3.09
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	408,653	3,725.86 1,522,585,017	3,633.66 1,484,908,103	3.06
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	177,116	9,127.61 1,616,650,730	8,329.75 1,475,333,560	3.04
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	83,300	15,261.20 1,271,261,087	14,038.47 1,169,404,968	2.41
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,697	37,157.43 1,066,308,297	34,986.25 1,004,000,485	2.07
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	42,821	26,924.60 1,152,942,726	23,424.87 1,003,076,624	2.07
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	59,313	19,471.00 1,154,892,856	16,564.60 982,496,689	2.02
13	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	213,300	5,135.47 1,095,403,460	4,577.72 976,429,638	2.01
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	84,845	10,095.68 856,569,400	9,315.22 790,349,858	1.63
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	69,057	12,097.92 835,454,500	11,322.52 781,899,567	1.61
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	115,225	5,407.22 623,052,236	5,077.57 585,063,925	1.21
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,967	48,965.56 634,938,288	44,991.13 583,400,079	1.20
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	23,591	25,912.73 611,310,742	24,320.17 573,737,248	1.18
19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	136,385	4,034.06 550,186,176	3,696.66 504,169,874	1.04
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,460	17,377.33 546,693,617	15,557.00 489,423,314	1.01
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,207	19,960.41 483,182,688	19,560.53 473,501,963	0.98

22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	141,540	3,470.78 491,261,935	3,176.25 449,567,048	0.93
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	55,436	8,142.31 451,380,227	7,568.91 419,590,261	0.86
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	60,760	7,241.63 440,010,983	6,866.59 417,214,239	0.86
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	38,566	11,243.59 433,623,703	10,534.78 406,284,634	0.84
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	141,386	2,912.88 411,858,030	2,843.28 402,000,764	0.83
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	21,568	19,840.20 427,916,350	18,227.08 393,121,692	0.81
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,112,672	362.38 403,265,903	347.70 386,881,618	0.80
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	33,007	11,947.49 394,354,466	11,697.41 386,096,445	0.80
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	279,635	1,551.95 433,993,685	1,379.20 385,674,997	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
投資信託受益証券	2.41%
投資証券	94.74%
合計	97.14%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	188	1,116,450,701	1,063,127,780	2.19%

	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	360	377,907,055	373,147,992	0.77%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1 月	買建	2,330,000	351,544,637	368,078,000	0.76%
		ユーロ買/円売 2025年1 月	買建	1,030,000	162,423,687	169,710,422	0.35%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ● FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	18,263円
純資産総額	14億円

当初設定日(2017年1月11日)～2024年12月30日

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.7%
3カ月間	1.3%
6カ月間	4.9%
1年間	14.8%
3年間	20.7%
5年間	56.9%
設定来	82.6%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 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	第7期	第8期			
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月	22年11月	23年11月	24年12月			
分配金	0円	0円	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。

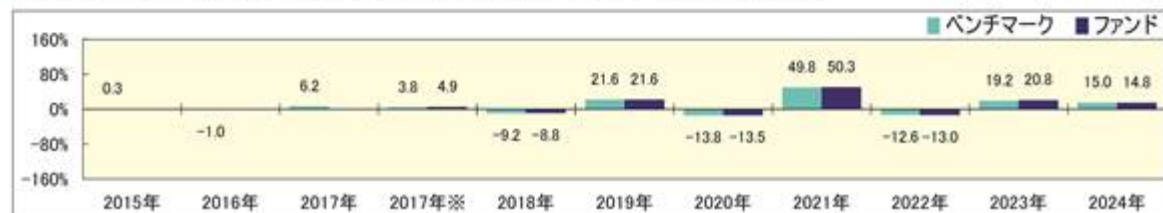
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	291	97.7%	米ドル	79.8%	小売	18.6%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.4%
外国投資信託等	2	2.4%	豪ドル	7.3%	産業用	15.0%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	6.0%
コール・ローン、その他		2.9%	英ポンド	4.2%	住宅	13.9%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	4.9%
合計	293	-	ユーロ	3.3%	ヘルスケア	11.6%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.7%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	2.9%	データセンター	9.9%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.5%
アメリカ		80.0%	カナダ・ドル	1.3%	倉庫	8.5%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.1%
オーストラリア		7.3%	香港ドル	0.9%	ダイバーシファイド	7.1%	GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.1%
イギリス		3.9%	韓国ウォン	0.2%	オフィススペース	4.1%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.0%
シンガポール		3.0%	イスラエル・シェケル	0.2%	特殊	3.6%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.4%
その他		5.9%	その他	0.0%	その他	2.5%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	-	アメリカ	2.2%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	94.7%	合計			38.2%

※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S&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(税引後配当込み、円ベース)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2024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オンライン TOPIXインデックス	0.24%	0.23%	0.00%
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)	0.35%	0.34%	0.02%
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)	0.43%	0.35%	0.08%
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	0.13%	0.13%	0.00%
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)	0.28%	0.26%	0.02%
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)	0.31%	0.27%	0.04%
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	0.24%	0.23%	0.00%
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)	0.38%	0.32%	0.06%
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)	0.38%	0.32%	0.06%

※対象期間は2023年12月1日～2024年12月2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。

#### <FWO 日本債券インデックス>

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

#### <「FWO 日本債券インデックス」以外のファンド>

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FWO T O P I Xインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO J - R E I T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ないます。

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

## 2【換金(解約)手続等】

### <FWO 日本債券インデックス>

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。

### <「FWO 日本債券インデックス」以外のファンド>

原則として、委託会社の各営業日の午後3時30分までに受付けた換金の申込み(当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを)、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

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ください。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

ファンド名	解約代金支払開始日
FWO T O P I Xインデックス FWO 日本債券インデックス	4営業日目
FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし) FWO J - R E I Tインデックス FWO 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり) FWO 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジなし)	5営業日目
FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	6営業日目

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

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

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

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

[別表A]

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

[別表B]

ファンド名	価額
-------	----

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

\*「FWO J - REITインデックス」は除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日

の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします(「FWO TOPIXインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO J-REITインデックス」を除きます。)

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合(「FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」を除きます。)、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をし

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

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

#### 信託約款の変更等

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

## 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

### < 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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

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

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

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

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

< 換金請求権 >

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



### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	11,943,317	8,398,549
親投資信託受益証券	5,715,006,099	7,007,653,097
未収入金	3,520,000	490,000
流動資産合計	5,730,469,416	7,016,541,646
資産合計	5,730,469,416	7,016,541,646
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,411,672	302,813
未払受託者報酬	619,275	753,364
未払委託者報酬	5,883,482	7,157,252
その他未払費用	154,741	188,257
流動負債合計	15,069,170	8,401,686
負債合計	15,069,170	8,401,686
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,201,684,971	1 3,363,216,146
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,513,715,275	3,644,923,814
（分配準備積立金）	1,480,454,900	2,055,214,197
元本等合計	5,715,400,246	7,008,139,960
純資産合計	5,715,400,246	7,008,139,960
負債純資産合計	5,730,469,416	7,016,541,646

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		9,208
有価証券売買等損益		1,103,150,995		972,796,998
営業収益合計		1,103,150,996		972,806,206
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,075		181
受託者報酬		1,126,503		1,435,859
委託者報酬		10,702,530		13,641,385
その他費用		281,464		358,806
営業費用合計		12,112,572		15,436,231
営業利益又は営業損失（ ）		1,091,038,424		957,369,975
経常利益又は経常損失（ ）		1,091,038,424		957,369,975
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,091,038,424		957,369,975
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（ ）		118,768,539		125,104,309
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,402,201,402		2,513,715,275
剰余金増加額又は欠損金減少額		467,710,735		782,545,996
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		467,710,735		782,545,996
剰余金減少額又は欠損金増加額		328,466,747		483,603,123
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		328,466,747		483,603,123
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,513,715,275		3,644,923,814

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	3,053,556,404円	3,201,684,971円
期中追加設定元本額	852,973,955円	766,621,291円
期中一部解約元本額	704,845,388円	605,090,116円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,201,684,971口	3,363,216,146口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2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(972,270,793円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,033,262,251円)及び分配準備積立金(508,184,107円)より分配対象額は2,513,717,151円(1万口当たり7,851.23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(8,888円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(832,255,217円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,589,709,617円)及び分配準備積立金(1,222,950,092円)より分配対象額は3,644,923,814円(1万口当たり10,837.61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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	1,016,153,001	892,502,248
合計	1,016,153,001	892,502,248

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.7851円	2.0838円
(1万口当たり純資産額)	(17,851円)	(20,838円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,514,898,479	7,007,653,097	
親投資信託受益証券 合計			7,007,653,097	
合計			7,007,653,097	

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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		11,318,400,016	25,585,460,365
株式	2 3	278,401,688,320	391,517,177,670
派生商品評価勘定		145,283,800	176,529,100
未収入金		17,079,700	62,700,000
未収配当金		1,959,196,490	2,027,187,340
未収利息		550,242	-
その他未収収益	4	13,627,126	37,026,196
差入委託証拠金		53,472,780	284,044,537
流動資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208
資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,249,200	20,967,200
前受金		129,325,000	17,562,000
未払金		20,441,625	444,285,079
未払解約金		105,766,530	46,343,940
未払利息		-	3,063,770
受入担保金		7,260,574,102	15,559,156,640
流動負債合計		7,517,356,457	16,091,378,629
負債合計		7,517,356,457	16,091,378,629
純資産の部			
元本等			
元本	1	166,904,971,223	202,433,131,578
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		117,486,970,794	201,165,615,001
元本等合計		284,391,942,017	403,598,746,579
純資産合計		284,391,942,017	403,598,746,579
負債純資産合計		291,909,298,474	419,690,125,208

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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、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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	147,745,976,638円	166,904,971,223円
期中追加設定元本額	33,173,755,669円	53,547,584,471円
期中一部解約元本額	14,014,761,084円	18,019,424,116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	2,805,574,007円	2,769,295,099円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,373,834,835円	3,756,385,932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	911,362円	904,928円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,019,052円	8,959,470円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	192,250,160円	133,303,700円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	13,126,071円	11,283,120円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	414,927,130円	308,944,173円
国内株式ファンド(適格機関投 資家専用)	335,163,355円	1,175,871,836円
日本株式インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	677,458,015円	863,762,165円
アセット・アロケーションファ ンド(リスク判断付き)2023-07 (適格機関投資家専用)	-円	1,591,364,318円
D-I's TOPIXインデッ クス	13,684,283円	11,681,440円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	248,960,497円	249,887,779円
iFree TOPIXインデッ クス	7,247,259,131円	9,987,610,465円
iFree 8資産バランス	4,606,729,135円	5,194,586,600円
iFree 年金バランス	999,756,008円	1,226,436,928円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	638,850円	4,267,029円
DCダイワ日本株式インデッ クス	70,849,239,578円	73,323,264,253円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,130,739,193円	2,984,565,474円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,922,236,693円	5,200,504,890円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,657,702,841円	6,246,948,097円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	7,362,939,711円	10,605,345,409円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	54,910,538円	50,268,884円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	75,461,317円	76,509,117円
ダイワつみたてインデックス日 本株式	4,784,147,220円	6,548,376,674円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	12,447,223円	12,566,747円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	11,579,092円	14,112,652円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	29,768,814円	74,843,139円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	11,296,011,297円	23,412,332,129円

ダイワ世界バランスファンド4 0VA	54,608,372円	47,104,361円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	20,876,356円	19,806,181円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,793,959,218円	3,013,743,783円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	350,586,677円	280,960,285円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	51,746,439円	39,319,630円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	73,719,521円	55,931,105円
ダイワ・ノーロードTOPIX ファンド	236,956,098円	243,752,682円
ダイワファンドラップTOPI Xインデックス	12,428,283,316円	15,501,409,759円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	6,094,958,950円	14,241,732,223円
ダイワファンドラップオンライ ンTOPIXインデックス	3,354,073,654円	3,514,898,479円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	835,518円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	-円	6,046,890円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	8,560,607円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	-円	362,454円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	-円	11,046,182円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	-円	12,686,752円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	-円	560,029円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	-円	8,978,957円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	-円	27,048,309円
ダイワ国内株式インデックス (投資一任専用)	-円	5,000,018円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,171,702,165円	994,378,310円

	ダイワライフスタイル25	108,414,945円	93,262,550円
	ダイワライフスタイル50	483,952,477円	433,705,855円
	ダイワライフスタイル75	404,489,561円	379,825,506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）	8,144,168,066円	7,647,992,706円
計		166,904,971,223円	202,433,131,578円
2.	期末日における受益権の総数	166,904,971,223口	202,433,131,578口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 6,909,195,160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 14,884,104,090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 1,209,560,000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 997,940,000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2023年12月1日 至2024年12月2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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,884,432,916	13,137,588,921
合計	5,884,432,916	13,137,588,921

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000	12,908,783,000	-	13,064,610,000	155,827,000
合計	5,273,120,000	-	5,417,280,000	144,160,000	12,908,783,000	-	13,064,610,000	155,827,000

## (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。
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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.7039円	1.9937円
(1万口当たり純資産額)	(17,039円)	(19,937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	5,900	3,970.00	23,423,000	
ニッスイ	141,300	938.90	132,666,570	
マルハニチロ	21,000	3,012.00	63,252,000	
雪国まいたけ	12,000	1,040.00	12,480,000	
カネコ種苗	4,000	1,374.00	5,496,000	
サカタのタネ	15,700	3,410.00	53,537,000	
ホクト	12,600	1,742.00	21,949,200	

ホクリヨウ	300	1,100.00	330,000	貸付株式数	200株
ショーボンドHD	18,600	5,185.00	96,441,000		
ミライト・ワン	46,200	2,149.00	99,283,800	貸付株式数	6,300株
タマホーム	8,900	3,605.00	32,084,500	貸付株式数	3,400株
サンヨーホームズ	200	710.00	142,000	貸付株式数	100株 (100株)
日本アクア	800	783.00	626,400		
ファーストコーポレーション	500	806.00	403,000	貸付株式数	400株
ベステラ	400	998.00	399,200	貸付株式数	300株 (300株)
キャンディル	300	551.00	165,300	貸付株式数	100株
住石ホールディングス	15,500	842.00	13,051,000	貸付株式数	7,500株
日鉄鉱業	5,700	4,180.00	23,826,000		
三井松島HLDGS	6,900	3,435.00	23,701,500	貸付株式数	2,700株
I N P E X	427,100	1,991.50	850,569,650		
石油資源開発	77,500	1,091.00	84,552,500		
K&Oエナジーグループ	6,400	3,360.00	21,504,000		
リョーサン菱洋HD	18,000	2,276.00	40,968,000		
ダイセキ環境ソリューション	400	1,263.00	505,200	貸付株式数	300株
第一カッター興業	4,100	1,446.00	5,928,600		
明豊ファシリティワークス	600	858.00	514,800		
安藤・間	81,900	1,163.00	95,249,700		
東急建設	44,300	690.00	30,567,000		
コムシスホールディングス	50,100	3,296.00	165,129,600		
ビーアールホールディングス	20,700	336.00	6,955,200		
高松コンストラクションGP	10,500	2,626.00	27,573,000		
東建コーポレーション	3,600	11,090.00	39,924,000		
ソネック	200	835.00	167,000	貸付株式数	100株
ヤマウラ	7,200	1,167.00	8,402,400	貸付株式数	2,300株
オリエンタル白石	52,300	386.00	20,187,800		
大成建設	89,700	6,623.00	594,083,100		
大林組	326,300	2,141.00	698,608,300		
清水建設	280,300	1,190.50	333,697,150		
長谷工コーポレーション	90,700	2,022.50	183,440,750	貸付株式数	4,000株
松井建設	9,200	844.00	7,764,800	貸付株式数	3,400株
銭高組	100	3,790.00	379,000		
鹿島建設	219,200	2,762.50	605,540,000		

不動テトラ	6,200	2,042.00	12,660,400	貸付株式数	2,400株
大末建設	500	1,588.00	794,000		
鉄建建設	6,500	2,261.00	14,696,500		
西松建設	15,800	5,085.00	80,343,000		
三井住友建設	79,700	405.00	32,278,500		
大豊建設	2,700	3,315.00	8,950,500		
佐田建設	700	971.00	679,700		
ナカノフドー建設	900	659.00	593,100		
奥村組	17,500	3,855.00	67,462,500	貸付株式数	6,800株
東鉄工業	10,900	3,200.00	34,880,000		
イチケン	300	2,540.00	762,000		
富士ピー・エス	500	402.00	201,000	貸付株式数	400株
浅沼組	39,600	642.00	25,423,200		
戸田建設	121,600	936.80	113,914,880	貸付株式数	17,600株
熊谷組	16,300	3,580.00	58,354,000		
北野建設	200	4,080.00	816,000		
植木組	300	1,536.00	460,800		
矢作建設	13,400	1,477.00	19,791,800		
ピーエス・コンストラクション	7,200	1,042.00	7,502,400		
日本ハウスHLDGS	21,100	335.00	7,068,500	貸付株式数	8,100株
大東建託	33,800	16,880.00	570,544,000		
新日本建設	13,900	1,510.00	20,989,000		
東亜道路	17,100	1,279.00	21,870,900	貸付株式数	5,200株
日本道路	9,900	1,743.00	17,255,700		
東亜建設	29,800	1,178.00	35,104,400		
日本国土開発	28,100	507.00	14,246,700	貸付株式数	10,800株
若築建設	2,900	3,640.00	10,556,000		
東洋建設	28,500	1,279.00	36,451,500		
五洋建設	129,400	616.50	79,775,100		
世紀東急	14,100	1,506.00	21,234,600	貸付株式数	5,500株
福田組	3,700	5,290.00	19,573,000	貸付株式数	1,400株
日本ドライケミカル	300	3,855.00	1,156,500	貸付株式数	100株
住友林業	85,400	5,640.00	481,656,000		
日本基礎技術	800	597.00	477,600		
巴コーポレーション	1,200	1,026.00	1,231,200		
大和ハウス	298,300	4,743.00	1,414,836,900		
ライト工業	20,100	2,188.00	43,978,800		
積水ハウス	299,900	3,584.00	1,074,841,600		
日特建設	9,400	989.00	9,296,600		



北陸電気工事	6,800	1,103.00	7,500,400	
ユアテック	19,100	1,423.00	27,179,300	
日本リーテック	7,700	1,141.00	8,785,700	貸付株式数 2,900株
四電工	12,400	1,475.00	18,290,000	
中電工	15,300	3,370.00	51,561,000	
関電工	54,200	2,223.00	120,486,600	
きんでん	68,700	3,098.00	212,832,600	
東京エネシス	10,500	1,046.00	10,983,000	
トーエネック	16,400	966.00	15,842,400	
住友電設	8,100	4,810.00	38,961,000	
日本電設工業	18,600	1,903.00	35,395,800	
エクシオグループ	104,700	1,741.00	182,282,700	貸付株式数 41,300株
新日本空調	6,400	3,945.00	25,248,000	
九電工	21,400	5,182.00	110,894,800	
三機工業	20,600	2,836.00	58,421,600	
日揮ホールディングス	97,800	1,300.50	127,188,900	
中外炉工業	3,200	3,285.00	10,512,000	
ヤマト	1,000	1,198.00	1,198,000	貸付株式数 400株
太平電業	6,300	4,975.00	31,342,500	貸付株式数 700株
高砂熱学	23,800	6,000.00	142,800,000	
三晃金属	100	4,330.00	433,000	
NECネットエスアイ	37,900	3,255.00	123,364,500	
朝日工業社	9,200	1,939.00	17,838,800	
明星工業	17,000	1,335.00	22,695,000	
大気社	12,700	4,720.00	59,944,000	
ダイダン	13,000	3,600.00	46,800,000	
日比谷総合設備	8,100	3,975.00	32,197,500	
ニッポン	32,700	2,130.00	69,651,000	貸付株式数 12,000株
日清製粉G本社	103,200	1,843.50	190,249,200	
日東富士製粉	1,800	6,570.00	11,826,000	
昭和産業	8,400	2,787.00	23,410,800	
鳥越製粉	1,000	687.00	687,000	
中部飼料	13,700	1,312.00	17,974,400	
フィード・ワン	14,500	799.00	11,585,500	
東洋精糖	200	1,436.00	287,200	
日本甜菜糖	5,200	2,386.00	12,407,200	貸付株式数 2,100株
DM三井製糖ホールディ	9,800	3,190.00	31,262,000	
塩水港精糖	1,500	304.00	456,000	貸付株式数 200株
ウェルネオシュガー	5,900	2,158.00	12,732,200	
LIFULL	25,300	190.00	4,807,000	

MIXI	19,500	2,793.00	54,463,500	
ジェイエイシーリクルートメント	37,400	692.00	25,880,800	
日本M&Aセンターホールディングス	152,400	635.40	96,834,960	
メンバーズ	4,000	1,035.00	4,140,000	
中広	200	436.00	87,200	
UTグループ	13,500	2,033.00	27,445,500	貸付株式数 5,200株
アイティメディア	5,600	1,505.00	8,428,000	貸付株式数 100株
ケアネット	21,200	589.00	12,486,800	貸付株式数 3,400株
E・Jホールディングス	6,100	1,663.00	10,144,300	
オープンアップグループ	31,100	1,811.00	56,322,100	
コシダカホールディングス	31,400	1,133.00	35,576,200	貸付株式数 12,200株
アルトナー	500	1,867.00	933,500	貸付株式数 400株
パソナグループ	12,600	1,965.00	24,759,000	貸付株式数 2,200株
CDS	300	1,825.00	547,500	
リンクアンドモチベーション	25,500	547.00	13,948,500	貸付株式数 9,600株
エス・エム・エス	39,600	1,678.00	66,448,800	
サニーサイドアップG	400	575.00	230,000	
パーソルホールディングス	966,800	232.40	224,684,320	
リニカル	800	344.00	275,200	
クックパッド	28,300	158.00	4,471,400	貸付株式数 10,900株
エスクリ	500	187.00	93,500	貸付株式数 200株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホールディング	800	722.00	577,600	貸付株式数 400株 (400株)
森永製菓	41,500	2,783.00	115,494,500	
中村屋	2,500	3,195.00	7,987,500	
江崎グリコ	28,400	4,427.00	125,726,800	
名糖産業	4,400	1,935.00	8,514,000	貸付株式数 1,400株
井村屋グループ	5,400	2,420.00	13,068,000	
不二家	6,800	2,671.00	18,162,800	貸付株式数 2,600株
山崎製パン	66,400	2,832.00	188,044,800	
第一屋製パン	300	586.00	175,800	貸付株式数 200株
モロゾフ	3,200	4,430.00	14,176,000	貸付株式数 1,000株
亀田製菓	6,300	4,175.00	26,302,500	貸付株式数 2,400株
寿スピリッツ	58,700	2,148.00	126,087,600	貸付株式数 23,200株
カルビー	45,400	3,170.00	143,918,000	貸付株式数 3,000株
森永乳業	38,100	2,932.00	111,709,200	
六甲バター	7,300	1,393.00	10,168,900	貸付株式数 2,200株

ヤクルト	141,800	3,078.00	436,460,400	貸付株式数	1,400株
明治ホールディングス	132,700	3,206.00	425,436,200		
雪印メグミルク	26,700	2,736.00	73,051,200		
プリマハム	13,300	2,173.00	28,900,900		
日本ハム	42,700	5,146.00	219,734,200		
林兼産業	400	463.00	185,200	貸付株式数	300株
丸大食品	10,000	1,707.00	17,070,000	貸付株式数	3,700株
S Foods	10,900	2,656.00	28,950,400	貸付株式数	4,300株
柿安本店	3,900	2,759.00	10,760,100	貸付株式数	1,200株
伊藤ハム米久HLDGS	15,200	3,790.00	57,608,000		
学情	5,300	1,761.00	9,333,300		
スタジオアリス	5,200	2,090.00	10,868,000	貸付株式数	1,800株 (800株)
クロスキャット	5,800	1,063.00	6,165,400	貸付株式数	1,600株
エプコ	300	783.00	234,900		
システナ	144,500	356.00	51,442,000		
N J S	2,600	3,685.00	9,581,000	貸付株式数	1,000株
デジタルアーツ	6,400	5,920.00	37,888,000	貸付株式数	2,500株
日鉄ソリューションズ	34,500	4,115.00	141,967,500	貸付株式数	13,600株
総合警備保障	173,100	1,133.50	196,208,850	貸付株式数	68,300株
キューブシステム	5,300	1,039.00	5,506,700	貸付株式数	1,600株
いちご	84,000	367.00	30,828,000		
日本駐車場開発	118,100	224.00	26,454,400		
コア	4,500	1,813.00	8,158,500		
カカクコム	74,700	2,499.50	186,712,650	貸付株式数	29,500株
アイロムグループ	4,200	2,573.00	10,806,600		
セントケア・ホールディング	6,600	741.00	4,890,600	貸付株式数	2,000株
サイネックス	200	739.00	147,800	貸付株式数	100株
ルネサンス	8,100	1,019.00	8,253,900	貸付株式数	2,700株
ディップ	18,100	2,528.00	45,756,800	貸付株式数	6,800株
SBSホールディングス	9,000	2,472.00	22,248,000		
デジタルホールディングス	5,300	1,242.00	6,582,600		
新日本科学	11,000	1,617.00	17,787,000	貸付株式数	4,200株
キャリアデザインセンター	200	1,808.00	361,600		
エムスリー	204,800	1,491.00	305,356,800	貸付株式数	80,800株
ツカダ・グローバルHOLD	900	444.00	399,600	貸付株式数	600株
プラス	200	537.00	107,400	貸付株式数	100株
ウェルネット	1,000	864.00	864,000		

ワールドホールディングス	4,100	2,087.00	8,556,700	貸付株式数	1,600株
ディー・エヌ・エー	41,400	2,437.50	100,912,500		
博報堂D Y HLDGS	117,500	1,142.50	134,243,750	貸付株式数	49,700株
ぐるなび	19,200	312.00	5,990,400	貸付株式数	7,400株
タカミヤ	14,000	414.00	5,796,000		
ファンコミュニケーションズ	14,500	417.00	6,046,500		
ライク	3,900	1,381.00	5,385,900	貸付株式数	1,400株 (1,200株)
A o b a B B T	500	317.00	158,500	貸付株式数	400株
エスプール	32,700	315.00	10,300,500	貸付株式数	12,900株
WDBホールディングス	5,300	1,684.00	8,925,200	貸付株式数	1,800株
手間いらず	1,700	3,450.00	5,865,000	貸付株式数	600株
ティア	800	427.00	341,600	貸付株式数	300株
アドウェイズ	12,700	320.00	4,064,000		
パリュコマース	9,100	1,137.00	10,346,700		
インフォマート	97,900	279.00	27,314,100	貸付株式数	1,800株
サッポロホールディングス	32,700	8,855.00	289,558,500		
アサヒグループホールディングン	745,200	1,615.00	1,203,498,000		
麒麟HD	413,400	2,113.50	873,720,900		
シマダヤ	2,900	1,437.00	4,167,300		
宝ホールディングス	66,900	1,289.50	86,267,550	貸付株式数	9,300株
オエノンホールディングス	32,100	414.00	13,289,400		
養命酒	3,300	2,516.00	8,302,800		
飛島ホールディングス	10,100	1,566.00	15,816,600		
コカ・コーラボトラーズJHD	70,000	2,429.00	170,030,000		
サントリー食品インター	69,900	5,132.00	358,726,800		
ダイドーグループHD	11,200	3,465.00	38,808,000	貸付株式数	4,300株
伊藤園	33,200	3,300.00	109,560,000		
キーコーヒー	11,100	2,063.00	22,899,300	貸付株式数	4,200株
ユニカフェ	400	945.00	378,000	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	14,000	5,030.00	70,420,000		
不二製油グループ	19,800	3,517.00	69,636,600		
かどや製油	100	3,585.00	358,500		
J - オイルミルズ	11,400	2,168.00	24,715,200		
サンエー	18,100	2,722.00	49,268,200	貸付株式数	2,600株
カワチ薬品	8,300	2,539.00	21,073,700		
エービーシー・マート	46,700	3,117.00	145,563,900		

ハードオフコーポレーション	4,200	1,789.00	7,513,800	
高千穂交易	4,200	3,815.00	16,023,000	貸付株式数 1,600株
アスクル	25,200	1,863.00	46,947,600	貸付株式数 200株
ゲオホールディングス	12,000	1,620.00	19,440,000	
アダストリア	14,700	3,665.00	53,875,500	
ジーフット	1,000	283.00	283,000	貸付株式数 900株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	522.00	104,400	貸付株式数 100株
オルバヘルスケアHLDGS	200	1,958.00	391,600	
伊藤忠食品	2,400	6,980.00	16,752,000	
くら寿司	12,500	3,880.00	48,500,000	貸付株式数 200株
キャンドウ	3,800	3,335.00	12,673,000	貸付株式数 1,400株
エレマテック	9,400	2,396.00	22,522,400	
IKホールディングス	400	382.00	152,800	貸付株式数 300株
パルグループHLDGS	24,400	3,250.00	79,300,000	
エディオン	46,400	1,799.00	83,473,600	
あらた	16,300	3,040.00	49,552,000	貸付株式数 2,900株
サーラコーポレーション	22,400	803.00	17,987,200	貸付株式数 8,400株
ワッツ	500	678.00	339,000	貸付株式数 400株
トーメンデバイス	1,500	6,680.00	10,020,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,200	4,045.00	16,989,000	
JPホールディングス	26,500	627.00	16,615,500	貸付株式数 10,400株
フジオフードG本社	12,000	1,207.00	14,484,000	貸付株式数 4,600株 (300株)
あみやき亭	7,700	1,622.00	12,489,400	貸付株式数 3,000株
東京エレクトロデバイス	10,600	3,110.00	32,966,000	
ひらまつ	2,700	168.00	453,600	貸付株式数 1,000株
円谷フィールズホールディ	17,300	2,195.00	37,973,500	貸付株式数 6,800株
双日	118,700	3,084.00	366,070,800	
アルフレッサホールディングス	99,400	2,189.50	217,636,300	
大黒天物産	3,300	9,870.00	32,571,000	貸付株式数 1,200株
ハニーズホールディングス	9,500	1,650.00	15,675,000	貸付株式数 3,300株
ファーマライズHD	300	601.00	180,300	貸付株式数 100株
キッコーマン	328,800	1,640.00	539,232,000	貸付株式数 14,500株
味の素	229,900	6,360.00	1,462,164,000	貸付株式数 32,600株
ブルドックソ - ス	5,300	1,841.00	9,757,300	
キューピー	53,300	3,480.00	185,484,000	貸付株式数 14,100株
ハウス食品G本社	33,400	2,851.50	95,240,100	

カゴメ	42,500	2,985.00	126,862,500	
アリアケジャパン	9,900	5,460.00	54,054,000	貸付株式数 3,900株
ピエトロ	200	1,742.00	348,400	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,700	2,855.00	7,708,500	
やまみ	200	4,010.00	802,000	貸付株式数 100株
ニチレイ	40,400	4,278.00	172,831,200	
横浜冷凍	26,800	804.00	21,547,200	
東洋水産	46,000	10,745.00	494,270,000	
イトアンドHLDGS	5,100	2,133.00	10,878,300	貸付株式数 1,900株
大冷	200	1,900.00	380,000	
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,400	1,333.00	7,198,200	貸付株式数 800株
日清食品HD	127,900	4,014.00	513,390,600	貸付株式数 50,500株
一正蒲鉾	500	734.00	367,000	貸付株式数 200株 (200株)
フジッコ	10,200	1,718.00	17,523,600	貸付株式数 3,800株
ロックフィールド	12,100	1,491.00	18,041,100	貸付株式数 4,700株
日本たばこ産業	603,000	4,221.00	2,545,263,000	
ケンコーマヨネーズ	6,200	2,129.00	13,199,800	
わらべや日洋HD	6,600	1,987.00	13,114,200	貸付株式数 400株
なとり	6,200	2,112.00	13,094,400	
イフジ産業	200	1,658.00	331,600	貸付株式数 100株
ファーマフーズ	13,200	984.00	12,988,800	貸付株式数 5,200株
北の達人コーポ	42,700	145.00	6,191,500	貸付株式数 16,800株 (1,300株)
ユーグレナ	61,700	400.00	24,680,000	貸付株式数 23,800株 (600株)
紀文食品	8,600	1,100.00	9,460,000	貸付株式数 1,700株
ピクルスホールディングス	5,800	1,032.00	5,985,600	貸付株式数 1,900株
スター・マイカ・HLDGS	10,300	674.00	6,942,200	
SREホールディングス	3,700	3,295.00	12,191,500	貸付株式数 1,600株
ADワークスグループ	2,700	210.00	567,000	貸付株式数 100株
片倉工業	9,300	1,992.00	18,525,600	貸付株式数 3,600株
グンゼ	7,200	5,180.00	37,296,000	
ヒューリック	231,500	1,390.00	321,785,000	
神栄	200	1,580.00	316,000	
ラサ商事	5,900	1,348.00	7,953,200	貸付株式数 900株
アルペン	8,800	2,006.00	17,652,800	貸付株式数 3,400株
ハブ	400	731.00	292,400	貸付株式数 300株

ラクーンホールディングス	7,500	690.00	5,175,000	貸付株式数	400株
クオールホールディングス	13,200	1,474.00	19,456,800		
アルコニックス	15,200	1,474.00	22,404,800		
神戸物産	82,500	3,708.00	305,910,000		
ソリトンシステムズ	5,200	1,158.00	6,021,600		
ジンスホールディングス	8,100	6,010.00	48,681,000	貸付株式数	3,200株
ビックカメラ	63,800	1,664.00	106,163,200	貸付株式数	25,200株
DCMホールディングス	55,200	1,410.00	77,832,000	貸付株式数	11,200株
ペッパーフードサービス	31,500	197.00	6,205,500	貸付株式数	12,200株
ハイパー	300	287.00	86,100		
MonotaRO	151,200	2,670.50	403,779,600		
東京一番フーズ	300	500.00	150,000		
DDグループ	800	1,300.00	1,040,000	貸付株式数	700株
あいホールディングス	17,100	2,098.00	35,875,800		
ディーブイエックス	200	883.00	176,600		
きちりホールディングス	400	889.00	355,600	貸付株式数	300株
J. フロント リテイリング	122,400	1,803.00	220,687,200		
ドトール・日レスHD	18,900	2,274.00	42,978,600		
マツキヨココカラ&カンパニー	188,000	2,124.50	399,406,000	貸付株式数	60,900株
ブロンコビリー	6,300	3,850.00	24,255,000	貸付株式数	2,400株
ZOZO	79,300	4,740.00	375,882,000		
トレジャー・ファクトリー	7,300	1,283.00	9,365,900	貸付株式数	2,800株
物語コーポレーション	19,000	3,585.00	68,115,000	貸付株式数	7,200株
三越伊勢丹HD	161,800	2,167.50	350,701,500	貸付株式数	66,400株
東洋紡	43,600	927.00	40,417,200	貸付株式数	17,200株
ユニチカ	32,700	194.00	6,343,800	貸付株式数	12,900株
富士紡ホールディングス	4,000	5,450.00	21,800,000		
日清紡ホールディングス	76,500	877.40	67,121,100		
倉敷紡績	7,200	5,670.00	40,824,000		
ダイワボウHD	47,200	3,084.00	145,564,800		
シキボウ	7,200	993.00	7,149,600	貸付株式数	1,800株
日東紡績	11,400	5,840.00	66,576,000		
トヨタ紡織	42,400	1,918.00	81,323,200		
マクニカホールディングス	82,600	1,784.00	147,358,400	貸付株式数	13,300株
Hamee	4,300	1,072.00	4,609,600		
マーケットエンタープライズ	100	831.00	83,100		
ラクト・ジャパン	4,500	2,903.00	13,063,500	貸付株式数	1,700株
ウエルシアHD	55,300	1,924.00	106,397,200		

クリエイトSDH	15,100	2,874.00	43,397,400	貸付株式数	5,600株
グリムス	4,500	2,681.00	12,064,500	貸付株式数	1,700株
バイタルKSKHD	14,700	1,233.00	18,125,100		
八洲電機	8,600	1,591.00	13,682,600	貸付株式数	3,200株
メディアスホールディングス	6,200	785.00	4,867,000	貸付株式数	2,300株
レスター	9,100	2,380.00	21,658,000		
ジオリーブグループ	300	1,051.00	315,300		
丸善CHI HD	1,700	319.00	542,300	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
大光	600	585.00	351,000	貸付株式数	500株
OCHIホールディングス	300	1,306.00	391,800		
TOKAIホールディングス	57,900	918.00	53,152,200	貸付株式数	22,300株
黒谷	300	553.00	165,900	貸付株式数	100株
ミサワ	200	682.00	136,400		
ティーライフ	200	1,203.00	240,600	貸付株式数	100株
Cominix	200	874.00	174,800		
エー・ピーホールディングス	300	929.00	278,700	貸付株式数	200株
三洋貿易	10,900	1,530.00	16,677,000		
チムニー	400	1,241.00	496,400	貸付株式数	300株
シュッピン	10,500	1,008.00	10,584,000	貸付株式数	3,700株
ビューティガレージ	3,400	1,393.00	4,736,200	貸付株式数	1,200株
オイシックス・ラ・大地	17,200	1,516.00	26,075,200	貸付株式数	6,800株
ウイン・パートナーズ	7,800	1,237.00	9,648,600	貸付株式数	2,300株
ネクステージ	24,400	1,396.00	34,062,400	貸付株式数	9,600株
ジョイフル本田	29,600	1,796.00	53,161,600	貸付株式数	11,600株
エターナルホスピタリティ グル	3,900	3,250.00	12,675,000		
ホットランド	8,200	2,134.00	17,498,800	貸付株式数	3,000株 (200株)
すかいらくHD	145,800	2,305.00	336,069,000	貸付株式数	57,600株
SFPホールディングス	6,000	1,917.00	11,502,000	貸付株式数	2,300株
綿半ホールディングス	8,300	1,522.00	12,632,600	貸付株式数	3,200株
日本毛織	25,900	1,258.00	32,582,200		
ダイトウボウ	2,000	102.00	204,000	貸付株式数	1,800株
トーア紡コーポレーション	500	410.00	205,000	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	1,100	883.00	971,300	貸付株式数	1,000株
ヨシックスホールディングス	3,500	3,170.00	11,095,000		



ユニテッド・スーパー マーケ	45,258	850.00	38,469,300	貸付株式数 13,400株 (300株)
野村不動産HLDGS	62,200	3,745.00	232,939,000	
三重交通グループHD	21,200	499.00	10,578,800	貸付株式数 7,600株
地主	8,800	2,130.00	18,744,000	貸付株式数 3,400株
プレサンスコーポレーシ ョン	13,200	1,860.00	24,552,000	貸付株式数 4,900株
フィル・カンパニー	2,000	1,008.00	2,016,000	貸付株式数 700株
ハウスコム	200	1,330.00	266,000	貸付株式数 100株
J P M C	5,700	1,159.00	6,606,300	
サンセイランディック	400	953.00	381,200	貸付株式数 300株
エストラスト	100	690.00	69,000	
フージャースHD	15,300	1,012.00	15,483,600	
オープンハウスグループ	36,400	5,550.00	202,020,000	貸付株式数 13,600株
東急不動産HD	298,400	995.80	297,146,720	貸付株式数 6,700株
飯田GHD	95,100	2,258.00	214,735,800	
イーランド	200	1,370.00	274,000	貸付株式数 100株
帝国繊維	11,400	2,456.00	27,998,400	貸付株式数 4,400株
日本コークス工業	102,600	95.00	9,747,000	貸付株式数 40,000株
ゴルフダイジェスト・オン	6,200	394.00	2,442,800	貸付株式数 2,400株
ミタチ産業	400	1,189.00	475,600	貸付株式数 300株
B E E N O S	6,700	3,655.00	24,488,500	貸付株式数 2,400株
あさひ	8,900	1,581.00	14,070,900	
日本調剤	7,000	1,437.00	10,059,000	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	18,100	7,442.00	134,700,200	
シップヘルスケアHD	42,200	2,204.00	93,008,800	
トーエル	500	771.00	385,500	貸付株式数 100株
ソフトクリエイイトHD	7,300	2,227.00	16,257,100	
セブン&アイ・HLDGS	1,178,000	2,606.00	3,069,868,000	
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	80,200	1,176.00	94,315,200	貸付株式数 31,600株
明治電機工業	4,000	1,385.00	5,540,000	
ツルハホールディングス	22,400	8,248.00	184,755,200	
デリカフーズHLDGS	500	499.00	249,500	
スターティアホールディン グス	400	2,181.00	872,400	貸付株式数 300株
サンマルクホールディン グス	8,600	2,532.00	21,775,200	
フェリシモ	300	838.00	251,400	

トリドールホールディングス	30,000	3,717.00	111,510,000	貸付株式数	11,800株
帝人	97,000	1,321.00	128,137,000		
東レ	737,900	962.70	710,376,330		
クラレ	147,100	2,075.50	305,306,050		
旭化成	683,000	1,067.50	729,102,500		
TOKYO BASE	11,400	286.00	3,260,400	貸付株式数	4,400株
稲葉製作所	5,800	1,760.00	10,208,000	貸付株式数	700株
宮地エンジニアリングG	12,500	1,881.00	23,512,500	貸付株式数	3,300株
トーカロ	30,000	1,773.00	53,190,000		
アルファCO	400	1,048.00	419,200		
SUMCO	198,000	1,201.50	237,897,000	貸付株式数	78,200株
川田テクノロジーズ	6,700	2,702.00	18,103,400		
RS TECHNOLOGIES	8,000	3,275.00	26,200,000		
ジェイテックコーポレーション	200	1,360.00	272,000		
信和	800	749.00	599,200	貸付株式数	700株
ビーロッド	700	1,506.00	1,054,200	貸付株式数	600株
ファーストブラザーズ	300	999.00	299,700		
AND DOホールディングス	6,000	988.00	5,928,000	貸付株式数	300株
シーアールイー	4,400	1,217.00	5,354,800		
ケイアイスター不動産	5,400	4,235.00	22,869,000	貸付株式数	300株
アグレ都市デザイン	300	1,590.00	477,000	貸付株式数	200株
ジェイ・エス・ビー	4,100	2,749.00	11,270,900		
ロードスターキャピタル	5,700	2,502.00	14,261,400		
イノベーションホールディングク	400	925.00	370,000	貸付株式数	200株
グローバルリンクマネジメント	200	2,860.00	572,000	貸付株式数	100株
フェイスネットワーク	400	1,650.00	660,000	貸付株式数	300株
霞ヶ関キャピタル	4,100	12,360.00	50,676,000	貸付株式数	1,600株
SUMINOE	300	1,967.00	590,100	貸付株式数	200株 (200株)
日本フェルト	600	478.00	286,800		
イチカワ	100	1,535.00	153,500		
エコナックホールディングス	1,100	115.00	126,500	貸付株式数	1,000株
日東製網	200	1,466.00	293,200	貸付株式数	100株
芦森工業	200	2,472.00	494,400		
アツギ	800	995.00	796,000		

ウイルプラスHLDGS	200	973.00	194,600	
JMホールディングス	7,700	2,694.00	20,743,800	
コメダホールディングス	27,900	2,873.00	80,156,700	
サツドラホールディングス	500	778.00	389,000	貸付株式数 400株
アレンザホールディングス	8,000	1,068.00	8,544,000	貸付株式数 3,000株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,200	1,431.00	4,579,200	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	12,400	785.00	9,734,000	貸付株式数 4,900株
クスリのアオキHLDGS	35,600	3,435.00	122,286,000	
ダイニック	400	749.00	299,600	
共和レザー	700	635.00	444,500	
ピーバンドットコム	200	429.00	85,800	貸付株式数 100株
力の源HD	8,000	1,016.00	8,128,000	貸付株式数 3,100株
FOOD&LIFE COMPAN	56,900	3,437.00	195,565,300	
アセンテック	4,100	850.00	3,485,000	
セーレン	19,500	2,774.00	54,093,000	
ソトー	300	677.00	203,100	貸付株式数 100株
東海染工	100	694.00	69,400	
小松マテーレ	14,600	794.00	11,592,400	
ワコールホールディングス	20,900	5,091.00	106,401,900	
ホギメディカル	13,600	4,785.00	65,076,000	貸付株式数 5,300株
クラウディアHLDGS	300	341.00	102,300	貸付株式数 200株
T S Iホールディングス	31,900	890.00	28,391,000	貸付株式数 12,600株
マツオカコーポレーション	300	1,914.00	574,200	
ワールド	15,600	2,239.00	34,928,400	貸付株式数 3,800株
T I S	106,800	3,690.00	394,092,000	貸付株式数 28,500株
テクミラホールディングス	600	315.00	189,000	貸付株式数 500株
グリー	33,900	428.00	14,509,200	
GMOベパボ	1,200	1,600.00	1,920,000	貸付株式数 200株
コーエーテクモHD	76,000	1,760.50	133,798,000	貸付株式数 29,900株
三菱総合研究所	5,000	4,370.00	21,850,000	
ボルテージ	300	229.00	68,700	貸付株式数 100株
電算	100	1,420.00	142,000	
A G S	500	803.00	401,500	貸付株式数 400株
ファインデックス	8,000	781.00	6,248,000	貸付株式数 3,000株
ブレインパッド	8,400	1,016.00	8,534,400	
K L a b	25,500	174.00	4,437,000	貸付株式数 6,100株

ポールトゥウィンホールディング	14,400	466.00	6,710,400	
ネクソン	222,100	2,111.50	468,964,150	
アイスタイル	33,800	422.00	14,263,600	貸付株式数 13,200株
エムアップホールディングス	12,400	1,623.00	20,125,200	
エイチーム	6,700	657.00	4,401,900	貸付株式数 400株
エニグモ	11,300	304.00	3,435,200	貸付株式数 4,600株
テクノスジャパン	1,000	747.00	747,000	
e n i s h	1,500	160.00	240,000	貸付株式数 800株
コロプラ	34,300	463.00	15,880,900	貸付株式数 13,300株
オルトプラス	1,100	88.00	96,800	貸付株式数 900株
ブロードリーフ	40,600	696.00	28,257,600	
クロス・マーケティングG	500	654.00	327,000	貸付株式数 400株
デジタルハーツHLDGS	7,200	809.00	5,824,800	
メディアドゥ	4,600	1,333.00	6,131,800	貸付株式数 1,500株
じげん	25,300	523.00	13,231,900	
バイキューブ	13,900	222.00	3,085,800	貸付株式数 5,300株
エンカレッジ・テクノロジー	300	584.00	175,200	貸付株式数 200株
サイバーリンクス	500	743.00	371,500	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	124.00	533,200	
フィクスターズ	10,100	1,626.00	16,422,600	貸付株式数 4,000株
CARTA HOLDINGS	5,700	1,475.00	8,407,500	貸付株式数 2,200株
オプティム	10,400	720.00	7,488,000	貸付株式数 3,900株
セレス	4,600	2,456.00	11,297,600	貸付株式数 1,800株
S H I F T	6,700	17,435.00	116,814,500	貸付株式数 2,500株
特種東海製紙	4,900	3,530.00	17,297,000	貸付株式数 300株
セック	1,700	4,150.00	7,055,000	
テクマトリックス	21,800	2,441.00	53,213,800	
プロシップ	4,400	1,539.00	6,771,600	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エンター	25,100	2,984.00	74,898,400	
GMOペイメントゲートウェイ	23,100	7,926.00	183,090,600	貸付株式数 8,600株
ザッパラス	200	402.00	80,400	貸付株式数 100株
システムリサーチ	6,900	1,378.00	9,508,200	貸付株式数 700株
インターネットイニシアティブ	55,200	3,061.00	168,967,200	
さくらインターネット	15,800	4,525.00	71,495,000	貸付株式数 3,300株
GMOグローバルサインHD	3,100	2,498.00	7,743,800	貸付株式数 200株

SRAホールディングス	5,700	4,330.00	24,681,000	
システムインテグレータ	400	306.00	122,400	貸付株式数 200株
朝日ネット	10,900	625.00	6,812,500	
e B A S E	14,200	681.00	9,670,200	貸付株式数 4,800株
アバントグループ	12,800	2,007.00	25,689,600	
アドソル日進	4,300	2,130.00	9,159,000	
ODKソリューションズ	300	549.00	164,700	貸付株式数 200株
フリービット	4,400	1,410.00	6,204,000	
コムチュア	13,400	2,186.00	29,292,400	
アステリア	7,900	505.00	3,989,500	貸付株式数 3,000株
アイル	5,700	3,270.00	18,639,000	貸付株式数 1,900株
王子ホールディングス	382,300	553.10	211,450,130	
日本製紙	52,600	861.00	45,288,600	貸付株式数 21,400株
三菱製紙	1,500	477.00	715,500	貸付株式数 1,400株
北越コーポレーション	56,700	1,518.00	86,070,600	貸付株式数 22,200株
中越パルプ	500	1,500.00	750,000	貸付株式数 300株
巴川コーポレーション	400	715.00	286,000	貸付株式数 300株
大王製紙	51,000	829.00	42,279,000	
阿波製紙	300	462.00	138,600	貸付株式数 200株
マークラインズ	6,000	2,405.00	14,430,000	
メディカル・データ・ビジ	12,100	444.00	5,372,400	貸付株式数 4,700株
g u m i	16,400	358.00	5,871,200	貸付株式数 6,300株
ショーケース	300	369.00	110,700	
モバイルファクトリー	300	935.00	280,500	貸付株式数 200株
テラスカイ	3,900	1,975.00	7,702,500	貸付株式数 1,500株
デジタル・インフォメーション	5,300	2,173.00	11,516,900	
PCIホールディングス	400	938.00	375,200	
アイピーシー	200	627.00	125,400	
ネオジャパン	2,700	1,875.00	5,062,500	
P R T I M E S	2,000	1,598.00	3,196,000	貸付株式数 700株
ラクス	47,800	2,069.00	98,898,200	
ランドコンピュータ	500	671.00	335,500	
ダブルスタンダード	3,600	1,674.00	6,026,400	貸付株式数 1,000株
オープンドア	7,100	691.00	4,906,100	貸付株式数 2,700株
マイネット	400	348.00	139,200	貸付株式数 100株
アカツキ	4,900	2,448.00	11,995,200	
ベネフィットジャパン	100	1,095.00	109,500	
UBICOMホールディングス	3,200	1,281.00	4,099,200	

カナミックネットワーク	12,700	493.00	6,261,100	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	119.00	142,800	
レンゴー	91,900	885.50	81,377,450	
トーモク	5,800	2,199.00	12,754,200	貸付株式数 700株
ザ・パック	7,500	3,595.00	26,962,500	貸付株式数 1,100株
チェンジホールディングス	25,100	1,340.00	33,634,000	
シンクロ・フード	700	419.00	293,300	貸付株式数 200株
オークネット	4,700	2,687.00	12,628,900	貸付株式数 1,800株
キャピタル・アセット・プラン	200	750.00	150,000	
セグエグループ	1,000	628.00	628,000	貸付株式数 900株
エイトレッド	200	1,589.00	317,800	
マクロミル	19,400	1,196.00	23,202,400	
ビーグリー	200	1,317.00	263,400	
オロ	4,300	2,388.00	10,268,400	貸付株式数 1,600株
ユーザーローカル	4,300	2,020.00	8,686,000	貸付株式数 1,500株
テモナ	300	183.00	54,900	貸付株式数 200株
ニーズウェル	1,200	298.00	357,600	貸付株式数 900株
マネーフォワード	24,800	4,926.00	122,164,800	
サインポスト	500	445.00	222,500	貸付株式数 400株
レゾナック・ホールディング	90,600	4,055.00	367,383,000	
住友化学	812,000	370.00	300,440,000	
住友精化	4,700	4,690.00	22,043,000	
日産化学	51,900	5,195.00	269,620,500	
ラサ工業	3,600	2,684.00	9,662,400	
クレハ	20,900	2,813.00	58,791,700	貸付株式数 4,800株
多木化学	3,900	3,455.00	13,474,500	貸付株式数 1,500株
テイカ	7,400	1,628.00	12,047,200	貸付株式数 1,000株
石原産業	16,700	1,458.00	24,348,600	
片倉コープアグリ	300	965.00	289,500	貸付株式数 200株
日本曹達	21,400	2,702.00	57,822,800	
東ソー	134,800	2,071.00	279,170,800	
トクヤマ	32,600	2,680.50	87,384,300	
セントラル硝子	12,700	3,300.00	41,910,000	
東亜合成	48,500	1,530.00	74,205,000	
大阪ソーダ	35,300	1,469.00	51,855,700	貸付株式数 2,600株
関東電化	21,700	1,057.00	22,936,900	貸付株式数 8,400株
SUN ASTERISK	7,200	711.00	5,119,200	貸付株式数 2,700株

デンカ	36,700	2,126.50	78,042,550	
イビデン	58,400	4,344.00	253,689,600	貸付株式数 23,000株
信越化学	905,300	5,546.00	5,020,793,800	
日本カ - バイド	5,300	1,652.00	8,755,600	
電算システムHD	4,500	2,465.00	11,092,500	貸付株式数 1,600株
堺化学	7,000	2,641.00	18,487,000	
第一稀元素化学工	11,000	710.00	7,810,000	貸付株式数 4,200株
エア・ウォーター	95,300	1,861.00	177,353,300	
日本酸素HLDGS	97,900	4,361.00	426,941,900	
日本化学工業	3,700	2,403.00	8,891,100	
東邦アセチレン	1,100	359.00	394,900	
日本パ - カライジング	45,000	1,279.00	57,555,000	
高压ガス	14,700	796.00	11,701,200	
チタン工業	200	846.00	169,200	貸付株式数 100株
四国化成ホールディング	11,400	2,049.00	23,358,600	
戸田工業	2,300	1,410.00	3,243,000	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	5,500	3,970.00	21,835,000	
保土谷化学	3,200	3,850.00	12,320,000	
日本触媒	64,700	1,824.00	118,012,800	
大日精化	7,000	2,883.00	20,181,000	
カネカ	24,900	3,496.00	87,050,400	
協和キリン	118,900	2,478.50	294,693,650	
APPIER GROUP	30,800	1,438.00	44,290,400	貸付株式数 12,100株
三菱瓦斯化学	81,900	2,832.00	231,940,800	貸付株式数 32,300株
三井化学	90,800	3,450.00	313,260,000	貸付株式数 21,600株
東京応化工業	48,200	3,547.00	170,965,400	
大阪有機化学	8,400	2,662.00	22,360,800	貸付株式数 3,300株
三菱ケミカルグループ	738,000	793.20	585,381,600	
KHネオケム	18,200	2,054.00	37,382,800	貸付株式数 7,100株
ビジョナル	12,000	7,884.00	94,608,000	貸付株式数 4,600株
ダイセル	114,800	1,372.00	157,505,600	
住友ベ - クライト	31,800	3,673.00	116,801,400	
積水化学	201,000	2,408.50	484,108,500	
日本ゼオン	77,900	1,405.50	109,488,450	
アイカ工業	25,500	3,259.00	83,104,500	
UBE	52,000	2,415.00	125,580,000	貸付株式数 12,000株
積水樹脂	13,800	2,108.00	29,090,400	貸付株式数 2,000株
旭有機材	6,700	4,285.00	28,709,500	貸付株式数 2,600株
ニチバン	6,300	1,925.00	12,127,500	貸付株式数 800株

リケンテクノス	18,900	1,073.00	20,279,700		
大倉工業	4,700	3,090.00	14,523,000	貸付株式数	1,800株
積水化成成品	14,200	363.00	5,154,600	貸付株式数	5,400株
群栄化学	2,400	2,686.00	6,446,400		
タイガース ポリマー	600	675.00	405,000		
ミライアル	400	1,423.00	569,200	貸付株式数	300株
ダイキアクシス	500	727.00	363,500	貸付株式数	300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	22,300	610.00	13,603,000		
竹本容器	400	838.00	335,200		
森六ホールディングス	5,600	1,974.00	11,054,400		
恵和	6,500	989.00	6,428,500	貸付株式数	2,500株
日本化薬	70,700	1,278.50	90,389,950	貸付株式数	15,900株
カーリット	10,000	1,319.00	13,190,000	貸付株式数	3,900株
ソルクシーズ	900	313.00	281,700	貸付株式数	600株
CLホールディングス	2,500	837.00	2,092,500	貸付株式数	900株
プレステージ・インター	48,500	673.00	32,640,500		
フェイス	300	1,216.00	364,800	貸付株式数	200株
プロトコーポレーション	11,100	1,322.00	14,674,200		
ハイマックス	3,200	1,379.00	4,412,800		
アミューズ	6,300	1,370.00	8,631,000	貸付株式数	2,400株
野村総合研究所	219,100	4,570.00	1,001,287,000	貸付株式数	86,400株
ドリームインキュベータ	2,500	3,140.00	7,850,000	貸付株式数	100株
クイック	7,200	2,011.00	14,479,200		
T A C	500	184.00	92,000	貸付株式数	300株
C Eホールディングス	500	563.00	281,500		
日本システム技術	9,400	1,921.00	18,057,400		
電通グループ	110,200	3,890.00	428,678,000		
インテージホールディングス	11,400	1,627.00	18,547,800	貸付株式数	4,300株
テイクアンドギヴニーズ	5,000	923.00	4,615,000	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	4,700	1,434.00	6,739,800	貸付株式数	1,500株
ぴあ	3,500	3,100.00	10,850,000	貸付株式数	1,300株
イオンファンタジー	4,500	3,050.00	13,725,000	貸付株式数	1,700株
ソースネクスト	51,200	188.00	9,625,600	貸付株式数	20,100株
シーティーエス	14,200	886.00	12,581,200		
NEXYZ.GROUP	400	792.00	316,800		
メディカルシステムネットワーク	10,400	420.00	4,368,000		



日本精化	6,700	2,484.00	16,642,800	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	9,400	3,410.00	32,054,000		
トリケミカル	11,000	2,801.00	30,811,000	貸付株式数	4,200株
シンプレクスHD	19,800	2,508.00	49,658,400		
HEROZ	4,000	1,014.00	4,056,000	貸付株式数	1,500株
ラクスル	24,500	1,124.00	27,538,000		
メルカリ	49,400	1,925.50	95,119,700	貸付株式数	19,400株
I P S	2,900	2,657.00	7,705,300		
F I G	1,300	301.00	391,300	貸付株式数	1,200株
システムサポート	3,900	1,810.00	7,059,000		
A D E K A	35,200	2,720.00	95,744,000		
日油	118,800	2,260.00	268,488,000		
ミヨシ油脂	400	1,600.00	640,000		
新日本理化	1,600	199.00	318,400	貸付株式数	1,500株
ハリマ化成グループ	7,900	855.00	6,754,500		
イーソル	6,800	645.00	4,386,000	貸付株式数	2,100株
東海ソフト	200	1,320.00	264,000		
ウイングアーク1ST	10,500	3,400.00	35,700,000		
ヒト・コミュニケーションズHD	3,400	852.00	2,896,800	貸付株式数	1,200株
サーバーワークス	1,800	2,316.00	4,168,800	貸付株式数	600株
東名	200	2,403.00	480,600		
ヴィッツ	100	810.00	81,000		
トピラスシステムズ	300	763.00	228,900		
S a n s a n	33,300	2,135.00	71,095,500	貸付株式数	13,100株
LINK-Uグループ	200	470.00	94,000		
ギフティ	8,900	1,395.00	12,415,500	貸付株式数	2,800株
花王	245,800	6,530.00	1,605,074,000		
第一工業製薬	3,600	3,800.00	13,680,000		
石原ケミカル	4,400	2,588.00	11,387,200	貸付株式数	1,600株
日華化学	500	1,158.00	579,000		
ニイタカ	200	1,855.00	371,000	貸付株式数	100株
三洋化成	6,200	3,950.00	24,490,000		
メドレー	11,100	4,370.00	48,507,000	貸付株式数	4,300株
ベース	5,000	3,260.00	16,300,000	貸付株式数	1,000株
J M D C	12,300	4,150.00	51,045,000	貸付株式数	6,000株
武田薬品	899,400	4,119.00	3,704,628,600		
アステラス製薬	886,700	1,584.00	1,404,532,800		
住友ファーマ	90,000	571.00	51,390,000		
塩野義製薬	335,300	2,123.50	712,009,550		

わかもと製薬	1,300	239.00	310,700	貸付株式数	500株
日本新薬	26,500	4,345.00	115,142,500		
中外製薬	316,400	6,605.00	2,089,822,000		
科研製薬	17,300	4,317.00	74,684,100		
エーザイ	134,100	4,641.00	622,358,100		
理研ビタミン	8,600	2,487.00	21,388,200		
ロート製薬	106,800	2,908.00	310,574,400		
小野薬品	206,800	1,733.00	358,384,400		
久光製薬	22,500	4,234.00	95,265,000	貸付株式数	8,400株
有機合成薬品	900	262.00	235,800		
持田製薬	12,700	3,385.00	42,989,500		
参天製薬	192,100	1,705.00	327,530,500		
扶桑薬品	3,900	2,595.00	10,120,500		
日本ケミファ	100	1,533.00	153,300		
ツムラ	34,700	4,890.00	169,683,000		
テルモ	674,200	3,068.00	2,068,445,600	貸付株式数	86,500株
HUグループHD	30,300	2,448.50	74,189,550	貸付株式数	9,400株
キッセイ薬品工業	16,700	3,700.00	61,790,000		
生化学工業	19,300	801.00	15,459,300		
栄研化学	16,000	2,187.00	34,992,000	貸付株式数	3,800株
鳥居薬品	5,400	4,730.00	25,542,000		
JCRファーマ	34,200	739.00	25,273,800		
東和薬品	13,600	2,797.00	38,039,200		
富士製薬工業	7,500	1,635.00	12,262,500	貸付株式数	2,900株
ゼリア新薬工業	16,000	2,323.00	37,168,000		
ネクセラファーマ	47,400	1,128.00	53,467,200	貸付株式数	17,800株
第一三共	954,000	4,871.00	4,646,934,000		
杏林製薬	21,900	1,472.00	32,236,800	貸付株式数	8,500株
大幸薬品	22,900	359.00	8,221,100	貸付株式数	8,800株
ダイト	7,500	2,090.00	15,675,000		
大塚ホールディングス	252,300	8,849.00	2,232,602,700		
ペプチドリーム	49,000	2,984.50	146,240,500	貸付株式数	1,200株
大日本塗料	11,200	1,137.00	12,734,400		
日本ペイントHOLD	446,700	1,042.50	465,684,750		
関西ペイント	84,500	2,142.50	181,041,250		
神東塗料	900	129.00	116,100	貸付株式数	800株
中国塗料	22,800	2,340.00	53,352,000		
日本特殊塗料	800	1,249.00	999,200		
藤倉化成	12,800	524.00	6,707,200		
太陽ホールディングス	17,600	4,255.00	74,888,000		

D I C	35,900	3,275.00	117,572,500	
サカティンクス	22,500	1,528.00	34,380,000	
ARTIENCE	18,100	3,170.00	57,377,000	
アルプス技研	9,000	2,565.00	23,085,000	
サニックス	14,800	262.00	3,877,600	
日本空調サービス	11,100	1,006.00	11,166,600	
オリエンタルランド	616,800	3,488.00	2,151,398,400	貸付株式数 61,900株
フォーカスシステムズ	6,800	1,097.00	7,459,600	
ダスキン	22,600	3,750.00	84,750,000	
パーク24	77,400	1,795.00	138,933,000	
明光ネットワークジャパン	12,600	720.00	9,072,000	貸付株式数 4,400株
ファルコホールディングス	4,200	2,250.00	9,450,000	
クレスコ	16,600	1,240.00	20,584,000	
フジ・メディア・HD	97,100	1,732.50	168,225,750	
秀英予備校	200	264.00	52,800	
田谷	200	333.00	66,600	
ラウンドワン	97,800	1,079.00	105,526,200	
リゾートトラスト	40,900	3,050.00	124,745,000	貸付株式数 11,000株
オービック	187,700	4,937.00	926,674,900	
ジャストシステム	14,500	3,500.00	50,750,000	
TDCソフト	17,000	1,320.00	22,440,000	
LINEヤフー	1,617,100	418.30	676,432,930	
ビー・エム・エル	12,800	2,833.00	36,262,400	
トレンドマイクロ	53,100	8,315.00	441,526,500	
IDホールディングス	6,800	1,636.00	11,124,800	
リソー教育	64,800	292.00	18,921,600	
日本オラクル	19,300	15,250.00	294,325,000	貸付株式数 6,700株
早稲田アカデミー	5,700	1,835.00	10,459,500	貸付株式数 2,100株 (900株)
アルファシステムズ	3,200	3,460.00	11,072,000	
フューチャー	25,200	1,898.00	47,829,600	
CAC HOLDINGS	6,200	1,736.00	10,763,200	
トーセ	300	615.00	184,500	貸付株式数 200株
ユー・エス・エス	213,100	1,393.00	296,848,300	
オービックビジネスC	17,100	7,178.00	122,743,800	貸付株式数 5,500株
アイティフォー	11,900	1,400.00	16,660,000	
東京個別指導学院	12,300	390.00	4,797,000	貸付株式数 400株
東計電算	2,800	4,340.00	12,152,000	
サイバーエージェント	229,000	1,029.50	235,755,500	
楽天グループ	730,000	847.20	618,456,000	貸付株式数 297,500株

エクスネット	200	1,449.00	289,800	貸付株式数	100株
クリーク・アンド・リバー社	5,200	1,591.00	8,273,200		
SBIグローバルアセット	20,300	672.00	13,641,600		
テー・オー・ダブリュー	20,300	312.00	6,333,600		
大塚商会	114,600	3,763.00	431,239,800	貸付株式数	45,200株
サイボウズ	13,900	2,144.00	29,801,600	貸付株式数	5,200株
山田コンサルティングGP	5,200	2,031.00	10,561,200		
セントラルスポーツ	3,900	2,414.00	9,414,600	貸付株式数	1,400株
パラカ	3,100	1,779.00	5,514,900		
電通総研	9,800	5,400.00	52,920,000		
A C C E S S	10,500	947.00	9,943,500	貸付株式数	4,100株
デジタルガレージ	16,200	3,775.00	61,155,000		
イーエムシステムズ	16,900	724.00	12,235,600		
ウェザーニューズ	6,200	2,897.00	17,961,400	貸付株式数	1,800株
C I J	25,200	448.00	11,289,600		
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,855.00	9,252,000	貸付株式数	500株
日本エンタープライズ	1,100	105.00	115,500		
WOWOW	7,600	993.00	7,546,800	貸付株式数	2,900株
スカラ	9,400	443.00	4,164,200	貸付株式数	3,600株
インテリジェント ウェイブ	600	1,098.00	658,800		
フルキャストホールディングス	8,500	1,462.00	12,427,000		
エン・ジャパン	16,900	2,076.00	35,084,400		
セルソース	6,700	1,085.00	7,269,500	貸付株式数	2,500株
あすか製薬HD	9,200	2,000.00	18,400,000		
サイワグループHD	59,500	2,154.00	128,163,000	貸付株式数	14,200株
富士フイルムHLDGS	609,500	3,403.00	2,074,128,500		
コニカミノルタ	227,300	661.50	150,358,950		
資生堂	211,100	2,666.50	562,898,150		
ライオン	128,600	1,794.00	230,708,400		
高砂香料	6,800	5,460.00	37,128,000		
マンダム	20,000	1,286.00	25,720,000		
ミルボン	16,200	3,460.00	56,052,000		
コーセー	20,600	6,636.00	136,701,600	貸付株式数	8,100株
コタ	10,200	1,610.00	16,422,000		
シーボン	200	1,117.00	223,400	貸付株式数	100株
ポーラ・オルビスHD	51,800	1,382.00	71,587,600	貸付株式数	19,100株
ノエビアホールディングス	9,000	4,925.00	44,325,000		

アジュバンホールディング	300	821.00	246,300	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,800	1,929.00	11,188,200	貸付株式数 2,100株
アクシーシア	6,700	557.00	3,731,900	貸付株式数 2,500株
エステー	8,200	1,491.00	12,226,200	
アグロカネショウ	3,400	1,896.00	6,446,400	
コニシ	31,800	1,357.00	43,152,600	貸付株式数 12,500株
長谷川香料	19,300	3,300.00	63,690,000	貸付株式数 1,700株
小林製薬	26,500	5,905.00	156,482,500	
荒川化学工業	9,300	1,114.00	10,360,200	
メック	8,300	3,365.00	27,929,500	貸付株式数 3,200株
日本高純度化学	2,500	3,250.00	8,125,000	
タカラバイオ	31,800	1,034.00	32,881,200	
JCU	11,200	3,995.00	44,744,000	
新田ゼラチン	800	749.00	599,200	貸付株式数 700株
OATアグリオ	4,200	2,017.00	8,471,400	貸付株式数 1,600株
デクセリアルズ	88,500	2,439.00	215,851,500	貸付株式数 14,700株
アース製薬	9,200	5,440.00	50,048,000	
北興化学	9,000	1,311.00	11,799,000	
大成ラミック	2,900	2,505.00	7,264,500	
クミアイ化学	40,200	789.00	31,717,800	貸付株式数 6,900株
日本農薬	15,400	675.00	10,395,000	
富士興産	300	1,392.00	417,600	
ニチレキグループ	10,700	2,410.00	25,787,000	
ユシロ化学	5,200	2,090.00	10,868,000	
ピーピー・カストロール	500	882.00	441,000	貸付株式数 400株
富士石油	26,500	292.00	7,738,000	
MORESCO	400	1,269.00	507,600	
出光興産	472,400	1,004.50	474,525,800	
ENEOSホールディングス	1,714,600	819.70	1,405,457,620	
コスモエネルギーHLDGS	33,300	6,557.00	218,348,100	
テスホールディングス	21,200	276.00	5,851,200	貸付株式数 8,000株
インフロニアHD	103,600	1,207.50	125,097,000	
横浜ゴム	51,100	3,047.00	155,701,700	
TOYO TIRE	58,100	2,353.50	136,738,350	
ブリヂストン	295,900	5,356.00	1,584,840,400	貸付株式数 116,800株
住友ゴム	99,100	1,643.00	162,821,300	
藤倉コンポジット	9,700	1,472.00	14,278,400	
オカモト	5,400	5,510.00	29,754,000	
アキレス	5,500	1,444.00	7,942,000	貸付株式数 2,100株

フコク	6,000	1,719.00	10,314,000	貸付株式数	2,100株
ニッタ	9,900	3,545.00	35,095,500	貸付株式数	1,000株
クリエートメディック	400	908.00	363,200		
住友理工	19,600	1,541.00	30,203,600		
三ツ星ベルト	14,100	4,100.00	57,810,000	貸付株式数	2,900株
バンドー化学	15,000	1,807.00	27,105,000		
A G C	98,300	4,709.00	462,894,700		
日本板硝子	51,700	334.00	17,267,800	貸付株式数	19,900株
石塚硝子	200	2,400.00	480,000	貸付株式数	100株
有沢製作所	15,200	1,441.00	21,903,200		
日本山村硝子	500	1,684.00	842,000		
日本電気硝子	37,500	3,419.00	128,212,500		
オハラ	4,800	1,205.00	5,784,000	貸付株式数	1,800株
住友大阪セメント	18,100	3,340.00	60,454,000	貸付株式数	6,100株
太平洋セメント	62,400	3,818.00	238,243,200		
リソルホールディングス	200	5,010.00	1,002,000		
日本ヒユ - ム	8,800	1,303.00	11,466,400	貸付株式数	3,200株
日本コンクリ - ト	19,600	381.00	7,467,600	貸付株式数	7,400株
三谷セキサン	4,200	5,670.00	23,814,000	貸付株式数	700株
アジアパイルHD	14,400	835.00	12,024,000		
東海カーボン	93,300	907.80	84,697,740	貸付株式数	36,600株
日本カーボン	5,800	4,420.00	25,636,000		
東洋炭素	7,100	4,415.00	31,346,500	貸付株式数	2,800株
ノリタケ	11,200	3,740.00	41,888,000		
TOTO	73,400	4,018.00	294,921,200	貸付株式数	25,000株
日本碍子	117,600	1,971.50	231,848,400		
日本特殊陶業	82,600	4,647.00	383,842,200		
ダントーホールディングス	400	309.00	123,600	貸付株式数	200株
MARUWA	4,200	43,490.00	182,658,000	貸付株式数	1,400株
品川リフラクトリーズ	12,400	1,666.00	20,658,400	貸付株式数	3,500株
黒崎播磨	6,900	2,350.00	16,215,000		
ヨータイ	5,200	1,550.00	8,060,000		
東京窯業	1,300	410.00	533,000		
ニッカトー	500	517.00	258,500		
フジインコーポレーテッド	27,200	2,372.00	64,518,400		
クニミネ工業	400	1,008.00	403,200	貸付株式数	300株
エーアンドエーマテリアル	300	1,243.00	372,900		
ニチアス	25,600	5,895.00	150,912,000		
日本製鉄	526,600	3,060.00	1,611,396,000		

神戸製鋼所	209,100	1,557.50	325,673,250	貸付株式数	60,300株
中山製鋼所	21,400	726.00	15,536,400	貸付株式数	8,400株
合同製鐵	5,800	3,815.00	22,127,000	貸付株式数	2,200株
J F Eホールディングス	313,300	1,711.50	536,212,950	貸付株式数	49,700株
東京製鐵	29,000	1,477.00	42,833,000	貸付株式数	11,400株
共英製鋼	10,200	1,733.00	17,676,600		
大和工業	19,600	7,730.00	151,508,000		
東京鐵鋼	4,600	6,370.00	29,302,000	貸付株式数	1,700株
大阪製鐵	4,800	3,380.00	16,224,000	貸付株式数	1,800株
淀川製鋼所	9,600	5,200.00	49,920,000	貸付株式数	3,700株
中部鋼鈹	6,800	2,174.00	14,783,200	貸付株式数	2,600株
丸一鋼管	31,700	3,235.00	102,549,500		
モリ工業	2,600	4,680.00	12,168,000		
大同特殊鋼	65,500	1,170.00	76,635,000		
日本高周波	500	374.00	187,000	貸付株式数	400株
日本冶金工	7,000	3,940.00	27,580,000		
山陽特殊製鋼	10,300	1,812.00	18,663,600		
愛知製鋼	6,000	4,800.00	28,800,000		
日本金属	300	651.00	195,300	貸付株式数	200株
ミガロホールディングス	400	1,625.00	650,000	貸付株式数	300株
大平洋金属	9,600	1,409.00	13,526,400	貸付株式数	2,200株
新日本電工	62,100	289.00	17,946,900		
栗本鉄工所	4,800	4,115.00	19,752,000		
虹 技	200	1,166.00	233,200	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	200	1,100.00	220,000	貸付株式数	100株
日本製鋼所	30,800	6,549.00	201,709,200		
三菱製鋼	7,700	1,389.00	10,695,300		
日亜鋼業	1,100	301.00	331,100		
日本精線	8,200	1,273.00	10,438,600		
エンビプロHD	10,200	414.00	4,222,800	貸付株式数	3,900株 (1,400株)
大紀アルミニウム	14,800	1,061.00	15,702,800	貸付株式数	4,900株
日本軽金属HD	30,400	1,529.00	46,481,600		
三井金属	26,000	4,811.00	125,086,000		
東邦亜鉛	8,200	826.00	6,773,200	貸付株式数	3,100株
三菱マテリアル	74,300	2,426.00	180,251,800	貸付株式数	26,200株
住友鋳山	131,500	3,707.00	487,470,500	貸付株式数	34,700株
DOWAホールディングス	28,000	4,499.00	125,972,000	貸付株式数	11,000株
古河機金	13,700	1,580.00	21,646,000		

エス・サイエンス	6,800	22.00	149,600	貸付株式数	6,400株
大阪チタニウム	18,000	2,001.00	36,018,000	貸付株式数	7,000株
東邦チタニウム	21,500	1,074.00	23,091,000	貸付株式数	8,200株
U A C J	14,600	5,450.00	79,570,000		
C Kサンエツ	2,500	3,725.00	9,312,500	貸付株式数	500株
古河電工	34,600	6,418.00	222,062,800		
住友電工	359,100	2,949.00	1,058,985,900		
フジクラ	111,500	5,662.00	631,313,000		
S W C C	13,900	7,900.00	109,810,000	貸付株式数	5,400株
カナレ電気	200	1,422.00	284,400		
平河ヒューテック	6,600	1,490.00	9,834,000	貸付株式数	1,500株
いよぎんホールディング	129,900	1,592.00	206,800,800		
しずおかフィナンシャル	218,600	1,367.00	298,826,200		
ちゅうぎんフィナンシャ	83,600	1,693.50	141,576,600		
楽天銀行	46,000	4,466.00	205,436,000	貸付株式数	9,300株
京都フィナンシャルG	124,900	2,369.00	295,888,100	貸付株式数	33,000株
リョービ	11,100	2,150.00	23,865,000		
アーレステイ	1,200	513.00	615,600		
AREホールディングス	42,100	1,723.00	72,538,300		
東洋製罐グループHD	66,300	2,389.00	158,390,700		
ホッカンホールディングス	5,600	1,703.00	9,536,800		
コロナ	5,800	940.00	5,452,000		
横河ブリッジHLDGS	17,900	2,758.00	49,368,200		
駒井ハルテック	200	1,552.00	310,400		
高田機工	300	1,002.00	300,600		
三和ホールディングス	102,700	4,553.00	467,593,100		
文化シャツタ -	27,200	1,858.00	50,537,600		
三協立山	13,100	699.00	9,156,900	貸付株式数	3,500株
アルインコ	7,900	973.00	7,686,700	貸付株式数	1,100株
東洋シャツタ -	300	781.00	234,300		
L I X I L	151,600	1,703.00	258,174,800		
日本フィルコン	800	499.00	399,200	貸付株式数	700株
ノーリツ	14,600	1,708.00	24,936,800		
長府製作所	11,600	1,896.00	21,993,600		
リンナイ	55,300	3,186.00	176,185,800	貸付株式数	20,800株
ユニプレス	18,100	969.00	17,538,900	貸付株式数	7,000株
ダイニチ工業	600	617.00	370,200		
日東精工	15,100	617.00	9,316,700		
三洋工業	100	2,869.00	286,900		
岡 部	18,600	788.00	14,656,800		



ジーテクト	11,600	1,577.00	18,293,200		
東 プ レ	18,300	1,892.00	34,623,600	貸付株式数	2,300株
高周波熱錬	15,400	974.00	14,999,600	貸付株式数	5,400株
東京製綱	6,100	1,241.00	7,570,100	貸付株式数	2,400株
サンコール	11,600	304.00	3,526,400	貸付株式数	4,400株
モリテックスチル	1,000	165.00	165,000	貸付株式数	400株
パイオラックス	14,000	2,442.00	34,188,000	貸付株式数	700株
エイチワン	10,700	1,019.00	10,903,300		
日本発条	92,000	1,740.00	160,080,000	貸付株式数	36,200株
中央発條	6,700	1,320.00	8,844,000		
アドバネクス	100	772.00	77,200		
三浦工業	47,200	3,841.00	181,295,200		
タ ク マ	34,400	1,643.00	56,519,200		
テクノプロ・ホールディング グ	60,200	2,788.50	167,867,700		
アトラグループ	400	131.00	52,400	貸付株式数	200株
アイ・アールジャパンHD	5,400	790.00	4,266,000	貸付株式数	2,000株
K e e P e r 技研	6,400	4,255.00	27,232,000	貸付株式数	2,500株
樂待	400	705.00	282,000	貸付株式数	300株
三機サービス	200	939.00	187,800	貸付株式数	100株
G u n o s y	8,200	699.00	5,731,800	貸付株式数	300株
デザインワン・ジャパン	600	113.00	67,800	貸付株式数	200株
イー・ガーディアン	4,900	1,835.00	8,991,500		
リブセンス	600	151.00	90,600	貸付株式数	500株
ジャパンマテリアル	31,700	1,655.00	52,463,500		
ベクトル	14,100	975.00	13,747,500		
ウチヤマホールディングス	600	314.00	188,400	貸付株式数	500株 (400株)
チャームケアコーポレー ション	8,600	1,290.00	11,094,000		
キャリアリンク	3,800	2,461.00	9,351,800		
I B J	7,900	622.00	4,913,800	貸付株式数	2,200株
アサンテ	5,100	1,641.00	8,369,100	貸付株式数	1,800株
バリューHR	9,300	1,932.00	17,967,600	貸付株式数	3,500株 (400株)
M&Aキャピタルパートナー	8,400	2,628.00	22,075,200		
ライドオンエクスプレスHD	4,100	997.00	4,087,700		
ERIホールディングス	400	2,135.00	854,000	貸付株式数	300株
アビスト	200	3,025.00	605,000	貸付株式数	100株

シグマクシス・ホールディング	30,200	920.00	27,784,000	
ウィルグループ	8,700	959.00	8,343,300	
エスクローA J	1,400	142.00	198,800	
メドピア	8,300	486.00	4,033,800	貸付株式数 3,200株
レアジョブ	300	392.00	117,600	
リクルートホールディングス	808,400	10,620.00	8,585,208,000	
エラン	13,700	676.00	9,261,200	
ツガミ	21,700	1,363.00	29,577,100	
オークマ	17,800	3,155.00	56,159,000	
芝浦機械	13,100	3,445.00	45,129,500	貸付株式数 3,700株
アマダ	141,400	1,455.00	205,737,000	
アイダエンジニア	22,800	783.00	17,852,400	
F U J I	44,200	2,171.00	95,958,200	
牧野フライス	11,300	6,640.00	75,032,000	
オーエスジー	44,900	1,769.00	79,428,100	
ダイジェット	200	700.00	140,000	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	25,400	806.00	20,472,400	
DMG森精機	64,200	2,573.50	165,218,700	
ソディック	26,800	719.00	19,269,200	
ディスコ	49,000	41,330.00	2,025,170,000	
日東工器	3,900	2,705.00	10,549,500	貸付株式数 1,700株
日進工具	8,500	740.00	6,290,000	
パンチ工業	1,200	398.00	477,600	貸付株式数 1,100株
富士ダイス	7,500	773.00	5,797,500	貸付株式数 1,900株
土木管理総合試験	500	307.00	153,500	
日本郵政	1,160,400	1,545.00	1,792,818,000	
ベルシステム24HLDGS	11,100	1,243.00	13,797,300	
鎌倉新書	8,800	535.00	4,708,000	貸付株式数 2,100株 (1,700株)
S M N	300	318.00	95,400	
一蔵	200	401.00	80,200	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	200	701.00	140,200	
エアトリ	7,600	1,085.00	8,246,000	貸付株式数 2,900株
アトラエ	7,300	880.00	6,424,000	貸付株式数 2,800株
ストライク	5,100	3,860.00	19,686,000	貸付株式数 1,800株
ソラスト	28,500	466.00	13,281,000	
セラク	3,100	1,317.00	4,082,700	貸付株式数 1,100株

インソース	22,500	1,073.00	24,142,500	
豊田自動織機	86,000	11,255.00	967,930,000	
豊和工業	700	1,095.00	766,500	
石川製作所	300	1,400.00	420,000	貸付株式数 200株
リケンN P R	12,800	2,400.00	30,720,000	貸付株式数 5,000株
東洋機械金属	1,000	640.00	640,000	
津田駒工業	300	350.00	105,000	貸付株式数 200株
エンシュウ	300	568.00	170,400	
島精機製作所	16,200	1,062.00	17,204,400	貸付株式数 6,200株
オプトラン	16,700	1,857.00	31,011,900	
イワキポンプ	6,800	2,631.00	17,890,800	貸付株式数 800株
フリーユ	9,600	1,089.00	10,454,400	
ヤマシンフィルタ	21,500	599.00	12,878,500	貸付株式数 8,400株
日阪製作所	12,300	995.00	12,238,500	
やまびこ	16,600	2,514.00	41,732,400	
野村マイクロ・サイエンス	16,800	1,757.00	29,517,600	貸付株式数 6,600株 (100株)
平田機工	4,900	5,200.00	25,480,000	貸付株式数 600株
P E G A S U S	11,200	433.00	4,849,600	
マルマエ	4,400	1,591.00	7,000,400	貸付株式数 1,700株
タツモ	7,300	2,562.00	18,702,600	貸付株式数 2,800株
ナプテスコ	63,900	2,434.50	155,564,550	
三井海洋開発	12,900	3,175.00	40,957,500	
レオン自動機	10,700	1,415.00	15,140,500	
S M C	30,500	64,590.00	1,969,995,000	
ホソカワミクロン	7,100	3,935.00	27,938,500	
ユニオンツール	4,500	5,320.00	23,940,000	
瑞 光	6,500	1,252.00	8,138,000	貸付株式数 2,700株
オイレス工業	13,800	2,376.00	32,788,800	
日精エーエスピー	3,500	5,070.00	17,745,000	
サト - ホールディングス	12,700	2,230.00	28,321,000	
技研製作所	9,600	1,731.00	16,617,600	貸付株式数 3,600株
日本エアーテック	4,800	1,229.00	5,899,200	
カ ワ タ	400	798.00	319,200	
日精樹脂工業	6,700	910.00	6,097,000	
オカダアイヨン	400	1,830.00	732,000	
ワイエイシイホールディングス	5,100	1,914.00	9,761,400	貸付株式数 2,000株
小松製作所	501,800	4,066.00	2,040,318,800	
住友重機械	60,200	3,249.00	195,589,800	

日立建機	40,500	3,383.00	137,011,500	貸付株式数	16,000株
日工	15,100	707.00	10,675,700		
巴工業	4,000	3,810.00	15,240,000		
井関農機	9,500	946.00	8,987,000	貸付株式数	3,500株
TOWA	31,200	1,587.00	49,514,400	貸付株式数	12,600株
丸山製作所	200	2,026.00	405,200		
北川鉄工所	4,000	1,204.00	4,816,000		
シンニッタン	1,400	200.00	280,000		
ローツェ	53,200	1,663.00	88,471,600	貸付株式数	17,100株
タカキタ	400	389.00	155,600	貸付株式数	100株
クボタ	532,200	1,871.50	996,012,300		
荏原実業	4,900	4,330.00	21,217,000		
東洋エンジニア	14,500	713.00	10,338,500	貸付株式数	5,700株
三菱化工機	3,600	3,200.00	11,520,000		
月島ホールディングス	13,800	1,494.00	20,617,200		
帝国電機製作所	7,000	2,760.00	19,320,000		
東京機械	300	356.00	106,800		
新東工業	22,600	922.00	20,837,200	貸付株式数	4,500株
渋谷工業	9,500	3,895.00	37,002,500		
アイチ コーポレーション	16,900	1,382.00	23,355,800		
小森コーポレーション	25,100	1,132.00	28,413,200		
鶴見製作所	7,800	3,575.00	27,885,000		
日本ギア工業	500	460.00	230,000	貸付株式数	300株
酒井重工業	4,000	2,371.00	9,484,000		
荏原製作所	209,000	2,264.50	473,280,500		
西島製作所	8,800	2,400.00	21,120,000		
北越工業	10,200	1,689.00	17,227,800	貸付株式数	3,900株
ダイキン工業	132,600	18,170.00	2,409,342,000		
オルガノ	15,700	8,860.00	139,102,000	貸付株式数	600株
ト・ヨ・カネツ	3,800	4,160.00	15,808,000		
栗田工業	56,900	5,706.00	324,671,400	貸付株式数	3,000株
椿本チエイン	46,100	1,892.00	87,221,200		
大同工業	500	737.00	368,500		
日機装	26,100	953.00	24,873,300		
木村化工機	7,800	966.00	7,534,800		
レイズネクスト	14,300	1,524.00	21,793,200		
アネスト岩田	17,300	1,408.00	24,358,400		
ダイフク	171,800	3,221.00	553,367,800		
サムコ	2,400	2,855.00	6,852,000	貸付株式数	900株
加藤製作所	700	1,327.00	928,900		

油研工業	200	2,539.00	507,800		
タダノ	58,600	1,153.50	67,595,100	貸付株式数	4,600株
フジテック	32,700	5,824.00	190,444,800		
C K D	28,200	2,486.00	70,105,200		
平和	33,900	2,095.00	71,020,500		
理想科学工業	8,100	3,450.00	27,945,000	貸付株式数	3,000株
S A N K Y O	117,600	2,130.50	250,546,800		
日本金銭機械	12,300	1,022.00	12,570,600	貸付株式数	4,700株
マースグループHLDGS	6,900	3,245.00	22,390,500	貸付株式数	2,200株
フクシマガリレイ	7,500	5,500.00	41,250,000		
オーイズミ	400	336.00	134,400	貸付株式数	100株
ダイコク電機	4,500	3,295.00	14,827,500	貸付株式数	1,700株
竹内製作所	18,500	4,850.00	89,725,000	貸付株式数	7,200株
ア マ ノ	28,900	4,312.00	124,616,800		
J U K I	15,800	385.00	6,083,000	貸付株式数	5,900株
サンデン	2,000	149.00	298,000	貸付株式数	1,700株
ジャノメ	8,800	1,076.00	9,468,800		
ブラザー工業	136,000	2,664.00	362,304,000		
マックス	12,500	3,440.00	43,000,000	貸付株式数	2,700株
モリタホールディングス	15,900	2,138.00	33,994,200		
グローリー	26,700	2,523.50	67,377,450		
新晃工業	30,900	1,439.00	44,465,100	貸付株式数	4,500株
大和冷機工業	15,600	1,487.00	23,197,200		
セガサミーホールディングス	90,900	2,635.00	239,521,500	貸付株式数	35,800株
T P R	12,900	2,331.00	30,069,900	貸付株式数	1,000株
ツバキ・ナカシマ	25,100	524.00	13,152,400		
ホシザキ	65,500	6,154.00	403,087,000		
大豊工業	8,800	611.00	5,376,800	貸付株式数	3,400株
日本精工	188,400	666.30	125,530,920		
N T N	240,800	239.60	57,695,680	貸付株式数	95,200株
ジェイテクト	90,600	1,058.00	95,854,800		
不二越	7,500	3,095.00	23,212,500	貸付株式数	2,900株
ミネベアミツミ	177,100	2,469.00	437,259,900		
日本トムソン	27,700	486.00	13,462,200		
T H K	58,700	3,682.00	216,133,400		
ユーシン精機	9,400	670.00	6,298,000		
前澤給装工業	7,300	1,348.00	9,840,400		
イーグル工業	11,300	1,916.00	21,650,800	貸付株式数	4,100株

前澤工業	700	1,184.00	828,800	
PILLAR	9,400	4,395.00	41,313,000	
キッツ	34,100	1,111.00	37,885,100	
日立	2,621,200	3,946.00	10,343,255,200	
三菱電機	1,035,400	2,568.50	2,659,424,900	
富士電機	61,900	8,692.00	538,034,800	
東洋電機製造	400	1,078.00	431,200	
安川電機	110,600	3,963.00	438,307,800	貸付株式数 8,200株
シンフォニアテクノロジー	10,100	5,850.00	59,085,000	
明電舎	17,200	4,005.00	68,886,000	
オリジン	200	1,153.00	230,600	
山洋電気	4,400	8,320.00	36,608,000	
デンヨー	7,800	2,748.00	21,434,400	
PHCホールディングス	19,000	923.00	17,537,000	貸付株式数 7,100株
KOKUSAI ELECTRIC	71,300	2,500.00	178,250,000	貸付株式数 28,100株
ソシオネクスト	101,400	2,479.00	251,370,600	貸付株式数 10,900株
ベイカレント	76,100	5,633.00	428,671,300	
ORCHESTRA HLDGS	2,300	813.00	1,869,900	
アイモバイル	13,100	538.00	7,047,800	
ディスラプターズ	700	155.00	108,500	貸付株式数 200株
MS - J a p a n	5,700	1,054.00	6,007,800	貸付株式数 500株
船場	200	1,302.00	260,400	
ジャパンエレベーターSHD	40,300	2,770.00	111,631,000	
フルテック	200	1,187.00	237,400	貸付株式数 100株 (100株)
グリーンズ	400	1,811.00	724,400	
ツナググループHLDGS	300	641.00	192,300	貸付株式数 100株
GAMEWITH	500	220.00	110,000	貸付株式数 400株
MS&CONSULTING	100	452.00	45,200	
エル・ティー・エス	1,400	2,394.00	3,351,600	貸付株式数 500株
ミダックホールディングス	6,300	1,673.00	10,539,900	貸付株式数 2,400株
キュービーネットHLDGS	5,900	1,018.00	6,006,200	
オープングループ	16,400	197.00	3,230,800	貸付株式数 5,200株
三桜工業	14,000	728.00	10,192,000	貸付株式数 5,400株
マキタ	126,600	4,700.00	595,020,000	
東芝テック	15,200	3,635.00	55,252,000	
芝浦メカトロニクス	7,400	7,790.00	57,646,000	
マブチモーター	44,700	2,224.00	99,412,800	
ニデック	449,500	2,748.50	1,235,450,750	

ユーエムシーエレクトロニクス	6,400	324.00	2,073,600	貸付株式数	2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,287.00	6,177,600		
東光高岳	5,500	2,003.00	11,016,500	貸付株式数	2,100株
ダブル・スコープ	31,200	284.00	8,860,800	貸付株式数	12,000株
宮越ホールディングス	4,500	1,871.00	8,419,500	貸付株式数	1,700株
ダイヘン	9,700	7,050.00	68,385,000		
ヤーマン	19,800	766.00	15,166,800	貸付株式数	7,600株 (200株)
JVCケンウッド	80,400	1,499.00	120,519,600		
ミマキエンジニアリング	8,500	1,456.00	12,376,000		
I - P E X	5,400	2,944.00	15,897,600		
大崎電気	21,800	765.00	16,677,000		
オムロン	93,300	4,741.00	442,335,300	貸付株式数	9,300株
日東工業	13,700	2,829.00	38,757,300	貸付株式数	5,200株
I D E C	15,000	2,423.00	36,345,000		
正興電機製作所	400	1,216.00	486,400	貸付株式数	100株
不二電機工業	300	1,139.00	341,700	貸付株式数	200株
ジーエス・ユアサ コーポ	45,400	2,587.00	117,449,800	貸付株式数	17,900株
サクサ	300	2,830.00	849,000		
メルコホールディングス	2,300	2,196.00	5,050,800		
テクノメディカ	2,000	1,802.00	3,604,000	貸付株式数	900株
ダイヤモンドエレクトリック HD	4,100	529.00	2,168,900	貸付株式数	1,600株
日本電気	144,000	13,060.00	1,880,640,000		
富士通	936,700	2,863.00	2,681,772,100		
沖電気	49,300	938.00	46,243,400		
電気興業	4,100	1,677.00	6,875,700		
サンケン電気	10,400	6,300.00	65,520,000	貸付株式数	1,800株
ナカヨ	200	1,131.00	226,200		
アイホン	6,200	2,709.00	16,795,800		
ルネサスエレクトロニクス	775,500	2,017.50	1,564,571,250		
セイコーエプソン	130,600	2,750.00	359,150,000	貸付株式数	49,100株
ワコム	71,500	713.00	50,979,500		
アルバック	22,300	6,299.00	140,467,700		
アクセル	5,100	1,285.00	6,553,500		
E I Z O	13,300	2,183.00	29,033,900		
ジャパンディスプレイ	61,700	20.00	1,234,000		
日本信号	23,200	913.00	21,181,600		

京三製作所	23,700	529.00	12,537,300	
能美防災	13,800	2,962.00	40,875,600	
ホーチキ	6,500	2,373.00	15,424,500	
星和電機	500	537.00	268,500	
エレコム	24,300	1,446.00	35,137,800	
パナソニック ホールディング	1,202,600	1,453.00	1,747,377,800	
シャープ	147,100	951.90	140,024,490	貸付株式数 58,000株
アンリツ	71,700	1,159.50	83,136,150	貸付株式数 28,300株
富士通ゼネラル	28,900	2,053.00	59,331,700	
ソニーグループ	3,529,500	3,014.00	10,637,913,000	
T D K	879,200	2,009.50	1,766,752,400	
帝国通信工業	4,500	2,964.00	13,338,000	貸付株式数 1,600株
タムラ製作所	40,600	506.00	20,543,600	
アルプスアルパイン	82,600	1,539.50	127,162,700	貸付株式数 18,400株
池上通信機	400	633.00	253,200	
日本電波工業	9,600	925.00	8,880,000	貸付株式数 3,600株
鈴木	5,400	1,947.00	10,513,800	
メイコー	10,100	9,300.00	93,930,000	
日本トリム	2,300	3,675.00	8,452,500	
フオスタ - 電機	10,400	1,441.00	14,986,400	
S M K	2,400	2,468.00	5,923,200	
ヨコオ	9,000	1,676.00	15,084,000	
ティアック	1,700	83.00	141,100	貸付株式数 1,600株
ホシデン	25,500	2,363.00	60,256,500	
ヒロセ電機	14,800	18,045.00	267,066,000	
日本航空電子	26,500	2,615.00	69,297,500	
T O A	10,300	919.00	9,465,700	
マクセル	20,600	1,728.00	35,596,800	
古野電気	12,000	2,544.00	30,528,000	
スミダコーポレーション	13,700	982.00	13,453,400	
アイコム	3,900	2,676.00	10,436,400	貸付株式数 300株
リオン	4,200	2,571.00	10,798,200	
横河電機	111,400	3,415.00	380,431,000	
新電元工業	3,900	2,406.00	9,383,400	貸付株式数 1,500株
アズビル	277,300	1,218.00	337,751,400	
東亜ディーケーケー	500	722.00	361,000	
日本光電工業	90,200	2,103.50	189,735,700	貸付株式数 31,500株
チノー	4,200	2,051.00	8,614,200	貸付株式数 1,300株
共和電業	1,200	426.00	511,200	



日本電子材料	6,200	2,088.00	12,945,600	
堀場製作所	19,100	8,639.00	165,004,900	
アドバンテスト	317,600	8,421.00	2,674,509,600	
小野測器	500	570.00	285,000	貸付株式数 200株
エスペック	9,000	2,619.00	23,571,000	
キーエンス	100,800	65,260.00	6,578,208,000	
日置電機	5,300	7,570.00	40,121,000	貸付株式数 800株
シスメックス	260,900	3,149.00	821,574,100	
日本マイクロニクス	16,600	3,805.00	63,163,000	
メガチップス	7,800	6,170.00	48,126,000	
OBARA GROUP	6,300	4,155.00	26,176,500	貸付株式数 2,400株
IMAGICA GROUP	10,100	504.00	5,090,400	貸付株式数 3,400株
澤藤電機	100	926.00	92,600	
デンソー	1,069,100	2,167.50	2,317,274,250	
原田工業	600	534.00	320,400	
コーセル	10,800	1,196.00	12,916,800	貸付株式数 4,100株
イリソ電子工業	10,200	2,643.00	26,958,600	
オプテックスグループ	18,500	1,932.00	35,742,000	
千代田インテグレ	3,500	3,585.00	12,547,500	
レーザーテック	46,200	16,305.00	753,291,000	
スタンレー電気	63,100	2,539.00	160,210,900	貸付株式数 20,700株
ウシオ電機	44,600	2,039.50	90,961,700	
岡谷電機	900	222.00	199,800	貸付株式数 800株
ヘリオステクノH	1,200	952.00	1,142,400	
エノモト	400	1,457.00	582,800	
日本セラミック	9,200	2,631.00	24,205,200	貸付株式数 3,500株
遠藤照明	600	1,412.00	847,200	
古河電池	7,400	1,370.00	10,138,000	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,200	2,304.00	18,892,800	貸付株式数 1,900株
図研	9,200	4,370.00	40,204,000	
日本電子	23,300	5,270.00	122,791,000	貸付株式数 9,500株
カシオ	80,600	1,152.50	92,891,500	
ファナック	487,700	3,930.00	1,916,661,000	
日本シイエムケイ	29,500	412.00	12,154,000	貸付株式数 11,300株
エンプラス	2,900	5,230.00	15,167,000	貸付株式数 200株 (100株)
大真空	12,300	526.00	6,469,800	貸付株式数 2,100株
ローム	182,600	1,412.50	257,922,500	貸付株式数 72,000株
浜松ホトニクス	161,800	1,824.00	295,123,200	貸付株式数 13,400株

三井ハイテック	44,600	770.00	34,342,000	貸付株式数	17,400株
新光電気工業	35,700	5,277.00	188,388,900		
京セラ	626,200	1,486.00	930,533,200		
協栄産業	100	2,225.00	222,500		
太陽誘電	44,200	2,170.50	95,936,100		
村田製作所	900,300	2,494.50	2,245,798,350		
双葉電子工業	19,200	458.00	8,793,600		
日東電工	319,600	2,407.50	769,437,000		
北陸電気工業	400	1,565.00	626,000		
東海理化電機	28,400	2,089.00	59,327,600		
ニチコン	26,500	1,042.00	27,613,000		
日本ケミコン	12,400	1,088.00	13,491,200	貸付株式数	4,700株
K O A	16,800	973.00	16,346,400	貸付株式数	6,400株
三井E & S	54,400	1,522.00	82,796,800	貸付株式数	21,500株
カナデビア	83,400	948.00	79,063,200		
三菱重工業	1,780,100	2,246.00	3,998,104,600		
川崎重工業	75,900	5,588.00	424,129,200		
I H I	81,600	7,960.00	649,536,000		
名村造船所	28,800	1,538.00	44,294,400	貸付株式数	11,300株
サノヤスホールディングス	1,600	167.00	267,200	貸付株式数	1,500株
スプリックス	300	820.00	246,000	貸付株式数	100株
マネジメントソリューションズ	5,100	1,749.00	8,919,900	貸付株式数	2,000株
プロレド・パートナーズ	2,500	527.00	1,317,500	貸付株式数	1,000株
AND FACTORY	300	227.00	68,100		
テノ.ホールディングス	100	499.00	49,900		
フロンティア・マネジメント	3,100	787.00	2,439,700		
ピアラ	200	256.00	51,200		
コプロ・ホールディングス	500	1,781.00	890,500		
ギークス	300	411.00	123,300		
アンビスホールディングス	22,200	883.00	19,602,600	貸付株式数	8,700株
カーブスホールディングス	28,300	813.00	23,007,900		
フォーラムエンジニアリング	12,100	977.00	11,821,700		
FAST FITNESS JAP	3,500	1,405.00	4,917,500		
日本車輛	3,900	2,244.00	8,751,600		
三菱ロジスネクスト	16,100	1,155.00	18,595,500	貸付株式数	6,300株
近畿車輛	200	1,440.00	288,000		
一家ホールディングス	300	665.00	199,500	貸付株式数	200株

フルサト・マルカHD	8,500	2,298.00	19,533,000	貸付株式数	3,200株
ヤマエグループHD	11,500	2,066.00	23,759,000	貸付株式数	4,500株
ジャパクラフトホール ディ	900	139.00	125,100	貸付株式数	800株
F P G	35,400	2,916.00	103,226,400		
島根銀行	300	496.00	148,800	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	1,000	310.00	310,000	貸付株式数	900株
全国保証	26,000	5,383.00	139,958,000		
めぶきフィナンシャルG	498,300	670.60	334,159,980	貸付株式数	90,000株
ジャパンインベストメントA	16,100	1,080.00	17,388,000	貸付株式数	6,300株
東京きらぼしFG	12,700	4,395.00	55,816,500		
九州フィナンシャルG	174,600	751.40	131,194,440		
かんぼ生命保険	115,500	3,198.00	369,369,000		
ゆうちょ銀行	818,100	1,464.00	1,197,698,400		
あんしん保証	500	156.00	78,000	貸付株式数	100株
富山第一銀行	31,500	1,152.00	36,288,000	貸付株式数	12,400株
コンコルディア・フィナン シャル	528,100	931.90	492,136,390	貸付株式数	208,800株
ジェイリース	7,400	1,375.00	10,175,000		
西日本フィナンシャルHD	61,100	2,047.00	125,071,700		
イントラスト	400	797.00	318,800		
日本モーゲージサービス	600	428.00	256,800	貸付株式数	100株
C a s a	400	855.00	342,000	貸付株式数	300株
S B I アルヒ	10,100	822.00	8,302,200	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	16,800	2,647.00	44,469,600		
日産自動車	1,259,800	360.40	454,031,920	貸付株式数	499,000株
いすゞ自動車	311,300	2,027.50	631,160,750		
トヨタ自動車	5,357,700	2,611.00	13,988,954,700		
日野自動車	151,600	405.10	61,413,160		
三菱自動車工業	393,100	393.50	154,684,850	貸付株式数	155,200株
エフテック	800	493.00	394,400	貸付株式数	700株
レシップホールディングス	600	497.00	298,200		
G M B	300	1,024.00	307,200	貸付株式数	200株
ファルテック	200	432.00	86,400		
武蔵精密工業	24,700	3,340.00	82,498,000		
日産車体	15,300	1,111.00	16,998,300		
新明和工業	29,000	1,299.00	37,671,000		
極東開発工業	13,600	2,302.00	31,307,200		
トピー工業	8,200	1,906.00	15,629,200	貸付株式数	3,100株
ティラド	2,200	3,400.00	7,480,000		

タチエス	18,600	1,704.00	31,694,400	
N O K	39,200	2,255.00	88,396,000	貸付株式数 15,000株
フタバ産業	30,400	664.00	20,185,600	
カヤバ	17,200	2,475.00	42,570,000	
市光工業	18,200	402.00	7,316,400	
大同メタル工業	19,700	475.00	9,357,500	
プレス工業	39,400	530.00	20,882,000	貸付株式数 8,300株
ミクニ	1,400	314.00	439,600	
太平洋工業	23,100	1,297.00	29,960,700	貸付株式数 9,100株
河西工業	1,900	118.00	224,200	貸付株式数 1,700株
アイシン	213,400	1,596.00	340,586,400	
マ ッ ダ	309,600	971.50	300,776,400	
今仙電機製作所	700	498.00	348,600	貸付株式数 600株
本田技研	2,388,000	1,302.00	3,109,176,000	
スズキ	814,500	1,626.00	1,324,377,000	
SUBARU	303,900	2,470.50	750,784,950	
安永	600	491.00	294,600	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	425,500	1,312.00	558,256,000	貸付株式数 38,300株
小糸製作所	104,400	1,943.50	202,901,400	
T B K	1,300	265.00	344,500	貸付株式数 500株
エクセディ	16,500	4,460.00	73,590,000	
ミツバ	18,900	849.00	16,046,100	
豊田合成	28,900	2,480.50	71,686,450	貸付株式数 7,400株
愛三工業	19,100	1,332.00	25,441,200	
盟和産業	200	1,217.00	243,400	
日本プラスト	900	344.00	309,600	
ヨ ロ ズ	10,400	1,154.00	12,001,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	17,700	2,998.00	53,064,600	
新家工業	200	4,590.00	918,000	
シマノ	43,800	21,450.00	939,510,000	
テイ・エス テック	41,000	1,658.00	67,978,000	
3 3 F G	8,900	2,093.00	18,627,700	貸付株式数 3,500株
第四北越フィナンシャルG	31,200	2,867.00	89,450,400	貸付株式数 2,400株
ひろぎんHLDGS	139,700	1,163.00	162,471,100	貸付株式数 53,700株
マーキュリアホールディングス	500	895.00	447,500	貸付株式数 300株 (300株)
おきなわF G	7,800	2,474.00	19,297,200	
ダイレクトマーケティングミクス	12,500	262.00	3,275,000	
ポピンズ	1,900	1,280.00	2,432,000	

LITALICO	9,400	944.00	8,873,600	貸付株式数	700株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,589.00	317,800	貸付株式数	100株
十六FG	13,900	4,400.00	61,160,000		
北國FHD	9,700	5,300.00	51,410,000		
ネットプロHD	33,000	422.00	13,926,000	貸付株式数	300株
プロクレアホールディングス	11,300	1,797.00	20,306,100	貸付株式数	1,500株
あいちフィナンシャルグル	18,500	2,482.00	45,917,000		
ジャムコ	6,100	1,381.00	8,424,100	貸付株式数	2,300株
小野建	11,700	1,486.00	17,386,200	貸付株式数	2,400株
はるやまHLDGS	500	599.00	299,500	貸付株式数	400株
南陽	500	1,106.00	553,000		
ノジマ	34,800	2,341.00	81,466,800	貸付株式数	11,300株
佐島電機	7,400	1,820.00	13,468,000		
カッパ・クリエイト	16,800	1,575.00	26,460,000	貸付株式数	6,400株
エコートレーディング	300	924.00	277,200	貸付株式数	100株
伯東	6,100	4,345.00	26,504,500	貸付株式数	2,300株
コンドーテック	8,200	1,379.00	11,307,800	貸付株式数	1,000株
中山福	600	363.00	217,800		
ライトオン	900	209.00	188,100	貸付株式数	800株
ナガイレーベン	13,500	2,125.00	28,687,500	貸付株式数	2,600株
三菱食品	9,800	4,790.00	46,942,000		
良品計画	127,000	3,119.00	396,113,000		
パリミキホールディングス	1,600	294.00	470,400		
松田産業	8,100	3,080.00	24,948,000		
第一興商	41,300	1,855.00	76,611,500	貸付株式数	16,300株
メディパルHD	115,700	2,429.50	281,093,150		
アドヴァングループ	9,100	967.00	8,799,700	貸付株式数	3,500株
S P K	4,300	2,024.00	8,703,200		
萩原電気HLDGS	4,600	3,155.00	14,513,000		
アルピス	3,500	2,602.00	9,107,000		
アズワン	33,100	2,704.50	89,518,950		
スズデン	4,600	1,838.00	8,454,800		
尾家産業	300	1,968.00	590,400		
シモジマ	7,100	1,285.00	9,123,500		
ドウシシャ	9,900	2,103.00	20,819,700		
小津産業	300	1,652.00	495,600	貸付株式数	200株
コナカ	1,400	241.00	337,400		
高速	6,300	2,425.00	15,277,500		

ハウス ローゼ	100	1,451.00	145,100	
G-7ホールディングス	11,600	1,439.00	16,692,400	
たけびし	4,500	2,093.00	9,418,500	貸付株式数 1,700株
イオン北海道	26,300	864.00	22,723,200	貸付株式数 10,100株
コジマ	20,600	1,089.00	22,433,400	貸付株式数 7,900株 (2,100株)
ヒマラヤ	400	848.00	339,200	貸付株式数 300株
コーナン商事	11,800	3,590.00	42,362,000	
ネットワンシステムズ	41,800	4,489.00	187,640,200	
エコス	4,000	2,008.00	8,032,000	貸付株式数 1,400株
ワタミ	12,900	1,015.00	13,093,500	貸付株式数 4,400株
マルシェ	400	203.00	81,200	貸付株式数 300株
リックス	2,400	2,760.00	6,624,000	
システムソフト	35,200	58.00	2,041,600	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	215,400	3,796.00	817,658,400	
丸文	9,500	1,058.00	10,051,000	
西松屋チェーン	23,600	2,340.00	55,224,000	貸付株式数 8,200株
ゼンショーホールディングス	60,600	9,099.00	551,399,400	
ハピネット	8,200	4,240.00	34,768,000	貸付株式数 3,400株
幸楽苑	7,900	1,308.00	10,333,200	貸付株式数 2,700株
ハークスレイ	400	677.00	270,800	
橋本総業HLDGS	4,200	1,187.00	4,985,400	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	28,600	1,315.00	37,609,000	
サイゼリヤ	15,800	5,240.00	82,792,000	貸付株式数 6,000株
タカショー	8,600	450.00	3,870,000	貸付株式数 3,300株
V Tホールディングス	41,600	474.00	19,718,400	
アルゴグラフィックス	9,300	5,230.00	48,639,000	貸付株式数 2,800株
魚力	3,700	2,397.00	8,868,900	貸付株式数 1,300株
IDOM	36,300	1,120.00	40,656,000	
日本エム・ディ・エム	8,000	611.00	4,888,000	
ポプラ	400	210.00	84,000	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,900	1,973.00	9,667,700	
ユナイテッドアローズ	11,400	2,568.00	29,275,200	
進和	6,500	2,812.00	18,278,000	貸付株式数 2,300株
エスケイジャパン	300	643.00	192,900	
ダイトロン	4,600	2,729.00	12,553,400	
ハイデイ日高	17,300	2,801.00	48,457,300	貸付株式数 6,300株

シークス	15,200	1,133.00	17,221,600	貸付株式数	5,800株
京都きもの友禅HD	600	72.00	43,200		
コロワイド	60,200	1,689.50	101,707,900	貸付株式数	10,700株
田中商事	300	671.00	201,300		
オーハシテクニカ	5,100	1,944.00	9,914,400		
壱番屋	42,100	1,011.00	42,563,100	貸付株式数	6,600株
白銅	3,000	2,301.00	6,903,000	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	400	135.00	54,000	貸付株式数	200株
P L A N T	300	1,534.00	460,200	貸付株式数	200株
スギホールディングス	57,300	2,510.00	143,823,000		
ダイコー通産	100	1,231.00	123,100		
薬王堂ホールディングス	5,200	2,053.00	10,675,600		
島津製作所	145,100	4,233.00	614,208,300	貸付株式数	100株
J M S	9,300	438.00	4,073,400		
クボテック	400	212.00	84,800	貸付株式数	300株
長野計器	6,600	2,410.00	15,906,000	貸付株式数	2,600株
ブイ・テクノロジー	4,900	2,218.00	10,868,200		
スター精密	17,200	1,829.00	31,458,800		
東京計器	7,100	3,315.00	23,536,500	貸付株式数	600株
愛知時計	4,800	1,978.00	9,494,400		
インターアクション	6,100	997.00	6,081,700	貸付株式数	1,200株
オーバル	1,100	366.00	402,600	貸付株式数	1,000株
東京精密	20,700	7,245.00	149,971,500		
マニー	40,300	1,731.00	69,759,300	貸付株式数	15,900株
ニコン	159,000	1,782.00	283,338,000	貸付株式数	54,800株
トプコン	57,200	1,602.50	91,663,000		
オリンパス	577,000	2,344.00	1,352,488,000		
理研計器	14,300	3,755.00	53,696,500	貸付株式数	5,600株
SCREENホールディングス	42,100	9,784.00	411,906,400		
キヤノン電子	9,500	2,478.00	23,541,000		
タムロン	13,900	4,285.00	59,561,500		
H O Y A	196,900	19,525.00	3,844,472,500		
シード	900	480.00	432,000		
ノーリツ銅機	9,500	4,360.00	41,420,000		
A&Dホロンホールディングス	12,600	1,915.00	24,129,000		
朝日インテック	122,900	2,609.00	320,646,100	貸付株式数	6,100株
キヤノン	502,700	4,904.00	2,465,240,800		
リコー	265,500	1,738.50	461,571,750		
シチズン時計	92,700	886.00	82,132,200		

リズム	300	3,730.00	1,119,000	貸付株式数	200株
大研医器	1,000	505.00	505,000		
メニコン	37,600	1,520.00	57,152,000	貸付株式数	9,800株
シンシア	100	533.00	53,300		
KYORITSU	1,600	152.00	243,200		
中本ボックス	400	1,707.00	682,800		
パラマウントベッドHD	23,300	2,531.00	58,972,300		
トランザクション	6,600	2,242.00	14,797,200	貸付株式数	2,500株
粧美堂	300	515.00	154,500	貸付株式数	200株
ニホンフラッシュ	8,500	830.00	7,055,000		
前田工織	18,000	1,800.00	32,400,000		
永大産業	1,300	209.00	271,700		
アートネイチャー	10,400	811.00	8,434,400		
フルヤ金属	9,600	3,435.00	32,976,000		
バンダイナムコHLDGS	273,600	3,179.00	869,774,400		
アイフィスジャパン	300	568.00	170,400	貸付株式数	100株
SHOEI	28,300	2,396.00	67,806,800	貸付株式数	100株
フランスベッドHLDGS	14,500	1,249.00	18,110,500	貸付株式数	5,500株
マーベラス	18,800	572.00	10,753,600	貸付株式数	7,200株
パイロットコーポレーション	15,800	4,790.00	75,682,000		
萩原工業	6,700	1,371.00	9,185,700	貸付株式数	1,200株
エイベックス	19,000	1,509.00	28,671,000		
フジシールインターナショナル	22,700	2,504.00	56,840,800	貸付株式数	1,800株
タカラトミー	42,300	4,225.00	178,717,500	貸付株式数	16,500株
広済堂ホールディングス	38,000	572.00	21,736,000	貸付株式数	14,900株
エステールホールディングス	200	601.00	120,200		
レック	12,900	1,267.00	16,344,300	貸付株式数	4,300株
タカノ	400	693.00	277,200		
三光合成	12,700	581.00	7,378,700		
プロネクサス	10,400	1,246.00	12,958,400		
ホクシン	900	100.00	90,000		
ウッドワン	400	807.00	322,800	貸付株式数	300株
きもと	1,800	288.00	518,400		
TOPPANホールディングス	132,100	4,034.00	532,891,400		
大日本印刷	209,000	2,251.00	470,459,000		
共同印刷	2,800	4,055.00	11,354,000		
NISSHA	17,300	1,629.00	28,181,700		



光村印刷	100	1,448.00	144,800	
ZACROS	8,000	4,125.00	33,000,000	貸付株式数 3,000株
ヴィア・ホールディングス	2,300	128.00	294,400	
TAKARA & COMPANY	5,900	2,715.00	16,018,500	
前澤化成工業	7,100	1,784.00	12,666,400	貸付株式数 2,500株
未来工業	3,600	3,950.00	14,220,000	貸付株式数 1,300株
アシックス	372,100	3,134.00	1,166,161,400	
ツ ツ ミ	2,400	2,082.00	4,996,800	
ウェーブロックHLDGS	400	641.00	256,400	
ジェイ エス ピー	8,300	2,104.00	17,463,200	貸付株式数 2,300株
ニチハ	12,700	2,885.00	36,639,500	貸付株式数 4,300株
ローランド	7,400	3,810.00	28,194,000	
エフピコ	22,300	2,743.00	61,168,900	
小松ウオール工業	7,400	1,503.00	11,122,200	
ヤマハ	184,200	1,105.00	203,541,000	
河合楽器	3,100	2,861.00	8,869,100	
クリナップ	9,900	688.00	6,811,200	
ビジョン	64,200	1,477.00	94,823,400	
天馬	8,400	3,010.00	25,284,000	貸付株式数 2,100株
キングジム	8,900	848.00	7,547,200	貸付株式数 3,400株 (200株)
象印マホービン	30,100	1,534.00	46,173,400	
リンテック	20,200	3,020.00	61,004,000	貸付株式数 5,300株
信越ポリマー	21,800	1,670.00	36,406,000	
東リ	2,900	457.00	1,325,300	
イトーキ	20,100	1,572.00	31,597,200	
任天堂	636,300	8,855.00	5,634,436,500	
三菱鉛筆	14,000	2,400.00	33,600,000	貸付株式数 5,400株
松風	10,100	2,028.00	20,482,800	
タカラスタンダード	23,200	1,635.00	37,932,000	
コクヨ	50,400	2,825.00	142,380,000	
ナカバヤシ	10,900	510.00	5,559,000	
ニフコ	37,800	3,568.00	134,870,400	
立川ブラインド	4,700	1,355.00	6,368,500	貸付株式数 1,800株
グローブライド	10,000	1,900.00	19,000,000	貸付株式数 3,000株
オカムラ	30,300	1,960.00	59,388,000	
バルカー	7,700	3,305.00	25,448,500	
MUTOHホールディングス	200	2,432.00	486,400	
伊藤忠	716,800	7,502.00	5,377,433,600	

丸 紅	876,300	2,282.00	1,999,716,600	
スクロール	15,900	1,025.00	16,297,500	
高 島	800	1,224.00	979,200	貸付株式数 600株
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,844.00	18,624,400	貸付株式数 3,800株
三陽商会	5,200	2,728.00	14,185,600	
長瀬産業	47,600	3,083.00	146,750,800	
ナイガイ	400	238.00	95,200	貸付株式数 300株
蝶 理	5,700	3,925.00	22,372,500	貸付株式数 1,900株
豊田通商	320,300	2,648.50	848,314,550	
オンワードホールディングス	65,500	529.00	34,649,500	
三共生興	13,900	606.00	8,423,400	
兼 松	44,600	2,524.50	112,592,700	
美 津 濃	10,000	8,380.00	83,800,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,088.00	217,600	
ルックホールディングス	3,200	2,560.00	8,192,000	
三井物産	1,566,800	3,197.00	5,009,059,600	
日本紙パルプ	51,000	651.00	33,201,000	
東京エレクトロン	213,300	23,640.00	5,042,412,000	
カメイ	11,300	1,842.00	20,814,600	
東都水産	100	5,490.00	549,000	
OUGホールディングス	200	2,619.00	523,800	
スターゼン	7,400	2,837.00	20,993,800	
セイコーグループ	15,600	4,190.00	65,364,000	
山 善	35,900	1,306.00	46,885,400	貸付株式数 13,600株
椿本興業	5,900	1,918.00	11,316,200	貸付株式数 2,400株
住友商事	639,000	3,264.00	2,085,696,000	
B I P R O G Y	34,100	4,630.00	157,883,000	
内田洋行	4,300	6,950.00	29,885,000	
三菱商事	1,970,800	2,565.00	5,055,102,000	
第一実業	10,000	2,430.00	24,300,000	貸付株式数 3,200株
キャノンマーケティングJPN	20,900	4,843.00	101,218,700	
西華産業	5,100	4,840.00	24,684,000	
佐藤商事	7,400	1,383.00	10,234,200	
東京産業	10,800	720.00	7,776,000	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	9,200	4,325.00	39,790,000	
神鋼商事	2,300	6,000.00	13,800,000	
トルク	800	212.00	169,600	
阪和興業	17,600	4,840.00	85,184,000	

正栄食品	7,100	4,270.00	30,317,000	貸付株式数 2,800株 (1,100株)
カナデン	8,000	1,430.00	11,440,000	
R Y O D E N	8,600	2,318.00	19,934,800	
ニプロ	84,000	1,379.00	115,836,000	貸付株式数 32,100株
岩谷産業	105,900	1,863.00	197,291,700	貸付株式数 41,800株
ナイス	2,500	1,541.00	3,852,500	
ニチモウ	400	1,898.00	759,200	
極東貿易	6,400	1,580.00	10,112,000	
アステナホールディングス	20,100	486.00	9,768,600	貸付株式数 7,700株
三愛オブリ	24,900	1,911.00	47,583,900	
稲畑産業	28,900	3,250.00	93,925,000	
G S I クレオス	5,700	2,090.00	11,913,000	貸付株式数 2,100株
明和産業	15,200	633.00	9,621,600	
クワザワホールディングス	400	630.00	252,000	貸付株式数 300株
ゴ - ルドウイン	17,900	8,835.00	158,146,500	貸付株式数 3,100株
ユニ・チャ - ム	210,600	3,916.00	824,709,600	
キ ン グ	400	723.00	289,200	
ワ キ タ	15,700	1,572.00	24,680,400	
ヤマトインタ - ナショナル	800	323.00	258,400	
東邦ホールディングス	28,800	4,284.00	123,379,200	貸付株式数 10,100株
サンゲツ	26,800	2,899.00	77,693,200	
ミツウロコグループ	13,600	1,672.00	22,739,200	
シナネンホールディングス	3,000	6,390.00	19,170,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	26,400	1,646.00	43,454,400	
サンリオ	86,600	5,018.00	434,558,800	貸付株式数 34,100株
サンワ テクノス	4,800	2,197.00	10,545,600	
新光商事	14,300	1,000.00	14,300,000	貸付株式数 4,800株
トーホー	4,600	2,792.00	12,843,200	貸付株式数 100株 (100株)
三信電気	4,300	1,888.00	8,118,400	
東陽テクニカ	9,800	1,440.00	14,112,000	
モスフード サービス	15,700	3,615.00	56,755,500	貸付株式数 5,000株
加賀電子	21,600	2,633.00	56,872,800	貸付株式数 2,500株
都築電気	6,100	2,464.00	15,030,400	
ソーダニツカ	10,400	1,120.00	11,648,000	
立花エレテック	6,400	2,625.00	16,800,000	
木曽路	16,100	2,057.00	33,117,700	貸付株式数 6,200株
SRSホールディングス	17,600	1,124.00	19,782,400	貸付株式数 6,600株

千趣会	21,600	303.00	6,544,800	貸付株式数	900株
タカキユー	900	129.00	116,100	貸付株式数	700株
リテールパートナーズ	15,800	1,251.00	19,765,800	貸付株式数	5,500株
上新電機	10,600	2,295.00	24,327,000		
日本瓦斯	51,000	2,058.50	104,983,500		
ロイヤルホールディングス	18,800	2,435.00	45,778,000	貸付株式数	7,200株
東天紅	100	857.00	85,700		
チヨダ	10,200	1,426.00	14,545,200		
ライフコーポレーション	11,200	3,375.00	37,800,000	貸付株式数	1,800株
リンガーハット	13,800	2,209.00	30,484,200	貸付株式数	5,300株
MrMaxHD	13,400	684.00	9,165,600		
テナライド	1,900	268.00	509,200	貸付株式数	1,600株
AOKIホールディングス	22,900	1,244.00	28,487,600		
オークワ	17,000	922.00	15,674,000	貸付株式数	6,500株
コメリ	14,400	3,220.00	46,368,000		
青山商事	22,800	2,265.00	51,642,000		
しまむら	25,000	8,519.00	212,975,000	貸付株式数	3,100株
はせがわ	600	305.00	183,000		
高島屋	148,200	1,218.00	180,507,600	貸付株式数	58,500株
松屋	18,100	877.00	15,873,700	貸付株式数	7,000株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	51,900	2,093.50	108,652,650	貸付株式数	16,500株
近鉄百貨店	6,100	2,028.00	12,370,800	貸付株式数	1,600株
丸井グループ	70,800	2,443.00	172,964,400		
クレディセゾン	62,900	3,608.00	226,943,200	貸付株式数	12,900株
アクシアルリテイリング	29,100	900.00	26,190,000		
井筒屋	500	409.00	204,500	貸付株式数	200株
イオン	394,300	3,618.00	1,426,577,400	貸付株式数	89,000株
イズミ	16,200	3,137.00	50,819,400	貸付株式数	2,300株
フオーバル	4,200	1,356.00	5,695,200	貸付株式数	1,000株
平和堂	17,500	2,286.00	40,005,000	貸付株式数	6,500株
フジ	19,600	2,038.00	39,944,800	貸付株式数	7,500株
ヤオコー	12,600	9,175.00	115,605,000	貸付株式数	3,800株
ゼビオホールディングス	14,400	1,117.00	16,084,800		
ケーズホールディングス	71,600	1,412.50	101,135,000	貸付株式数	26,400株
PALTAC	16,600	4,337.00	71,994,200	貸付株式数	3,900株
三谷産業	18,600	317.00	5,896,200		
OLYMPICグループ	600	461.00	276,600	貸付株式数	500株
日産東京販売HD	1,700	430.00	731,000		

あおぞら銀行	68,500	2,480.50	169,914,250	貸付株式数	17,900株
三菱UFJフィナンシャルG	6,510,000	1,826.50	11,890,515,000		
りそなホールディングス	1,225,900	1,297.50	1,590,605,250		
三井住友トラストグループ	353,400	3,800.00	1,342,920,000		
三井住友フィナンシャルG	2,070,800	3,823.00	7,916,668,400		
千葉銀行	307,400	1,292.00	397,160,800		
群馬銀行	172,400	1,112.50	191,795,000	貸付株式数	46,700株
武蔵野銀行	15,100	2,977.00	44,952,700		
千葉興業銀行	23,500	1,429.00	33,581,500	貸付株式数	5,200株
筑波銀行	43,400	245.00	10,633,000	貸付株式数	17,200株
七十七銀行	31,800	4,525.00	143,895,000		
秋田銀行	6,700	2,144.00	14,364,800		
山形銀行	11,000	982.00	10,802,000		
岩手銀行	6,300	2,689.00	16,940,700		
東邦銀行	85,600	281.00	24,053,600	貸付株式数	32,900株
東北銀行	600	1,123.00	673,800		
ふくおかフィナンシャルG	86,400	4,266.00	368,582,400		
スルガ銀行	63,000	1,059.00	66,717,000		
八十二銀行	232,400	1,044.00	242,625,600		
山梨中央銀行	11,100	1,826.00	20,268,600		
大垣共立銀行	18,900	1,901.00	35,928,900		
福井銀行	8,900	1,883.00	16,758,700	貸付株式数	1,900株
清水銀行	4,000	1,500.00	6,000,000	貸付株式数	1,100株
富山銀行	200	1,535.00	307,000	貸付株式数	100株
滋賀銀行	15,000	3,895.00	58,425,000		
南都銀行	14,900	3,180.00	47,382,000		
百五銀行	93,400	628.00	58,655,200	貸付株式数	33,700株
紀陽銀行	35,500	2,112.00	74,976,000		
ほくほくフィナンシャルG	55,800	1,878.50	104,820,300	貸付株式数	22,000株
山陰合同銀行	62,100	1,257.00	78,059,700	貸付株式数	7,000株
鳥取銀行	400	1,232.00	492,800	貸付株式数	100株
百十四銀行	9,700	3,165.00	30,700,500		
四国銀行	14,600	1,113.00	16,249,800		
阿波銀行	13,900	2,885.00	40,101,500		
大分銀行	6,000	3,150.00	18,900,000		
宮崎銀行	6,500	3,075.00	19,987,500		
佐賀銀行	5,800	2,142.00	12,423,600		
琉球銀行	22,700	1,031.00	23,403,700	貸付株式数	8,900株
セブン銀行	355,500	329.70	117,208,350	貸付株式数	122,000株
みずほフィナンシャルG	1,339,800	3,879.00	5,197,084,200		

高知銀行	400	862.00	344,800	
山口フィナンシャルG	97,300	1,641.00	159,669,300	貸付株式数 12,200株
芙蓉総合リース	9,100	11,280.00	102,648,000	貸付株式数 3,300株
みずほリース	74,600	1,005.00	74,973,000	
東京センチュリー	74,200	1,521.50	112,895,300	貸付株式数 29,300株
SBIホールディングス	159,700	3,908.00	624,107,600	
日本証券金融	36,500	2,106.00	76,869,000	
アイフル	164,400	330.00	54,252,000	
日本アジア投資	700	215.00	150,500	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,200	6,460.00	40,052,000	
北洋銀行	135,400	466.00	63,096,400	
大光銀行	400	1,427.00	570,800	貸付株式数 200株
愛媛銀行	14,500	1,052.00	15,254,000	
トマト銀行	400	1,135.00	454,000	貸付株式数 100株
京葉銀行	44,600	816.00	36,393,600	
栃木銀行	45,500	282.00	12,831,000	
北日本銀行	3,500	2,848.00	9,968,000	
東和銀行	18,200	649.00	11,811,800	
福島銀行	1,200	221.00	265,200	貸付株式数 1,100株
大東銀行	500	708.00	354,000	貸付株式数 100株
リコーリース	9,400	5,180.00	48,692,000	貸付株式数 3,200株
イオンフィナンシャルサー ビス	57,000	1,282.00	73,074,000	
アコム	236,200	385.00	90,937,000	
ジャックス	11,900	3,755.00	44,684,500	貸付株式数 4,700株
オリコ	32,400	832.00	26,956,800	貸付株式数 5,600株
オリックス	595,300	3,419.00	2,035,330,700	
三菱HCキャピタル	497,600	1,020.00	507,552,000	
ジャフコグループ	29,600	2,116.50	62,648,400	貸付株式数 10,800株
九州リースサービス	400	1,045.00	418,000	
トモニホールディングス	94,800	459.00	43,513,200	
大和証券G本社	709,800	1,026.50	728,609,700	
野村ホールディングス	1,669,300	921.40	1,538,093,020	
岡三証券グループ	78,400	644.00	50,489,600	貸付株式数 17,200株
丸三証券	33,000	983.00	32,439,000	貸付株式数 8,000株
東洋証券	29,600	614.00	18,174,400	
東海東京HD	117,900	483.00	56,945,700	
光世証券	300	423.00	126,900	貸付株式数 200株
水戸証券	27,200	553.00	15,041,600	

いちよし証券	20,000	1,002.00	20,040,000	
松井証券	68,400	816.00	55,814,400	
SOMPOホールディングス	485,300	4,101.00	1,990,215,300	
日本取引所グループ	590,500	1,842.00	1,087,701,000	
マネックスG	97,200	1,050.00	102,060,000	
極東証券	12,400	1,387.00	17,198,800	貸付株式数 4,800株
岩井コスモホールディング	11,300	2,275.00	25,707,500	
アイザワ証券グループ	14,300	1,781.00	25,468,300	貸付株式数 5,500株
フィデアホール	10,300	1,412.00	14,543,600	貸付株式数 3,900株
池田泉州HD	137,700	404.00	55,630,800	
アニコムホールディングス	33,700	678.00	22,848,600	
MS&AD	727,400	3,438.00	2,500,801,200	
マネーパートナーズGP	1,100	474.00	521,400	
スパークス・グループ	11,100	1,451.00	16,106,100	
小林洋行	500	270.00	135,000	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	466,800	4,305.00	2,009,574,000	
東京海上HD	969,100	5,709.00	5,532,591,900	
アドバンテッジリスクマネ	600	683.00	409,800	
イー・ギャランティ	16,200	1,675.00	27,135,000	
アサックス	400	714.00	285,600	貸付株式数 300株
NECキャピタルソリューション	4,900	3,700.00	18,130,000	
T&Dホールディングス	266,500	2,902.00	773,383,000	
アドバンスクリエイト	7,800	622.00	4,851,600	貸付株式数 2,900株
三井不動産	1,377,600	1,266.00	1,744,041,600	
三菱地所	575,000	2,113.50	1,215,262,500	
平和不動産	16,100	4,265.00	68,666,500	
東京建物	86,700	2,581.00	223,772,700	
京阪神ビルディング	16,700	1,549.00	25,868,300	
住友不動産	161,500	4,674.00	754,851,000	
太平洋興発	400	713.00	285,200	貸付株式数 200株
テーオーシー	17,700	654.00	11,575,800	
スターツコーポレーション	16,300	3,740.00	60,962,000	
フジ住宅	12,500	784.00	9,800,000	
空港施設	14,000	579.00	8,106,000	
明和地所	8,000	1,013.00	8,104,000	貸付株式数 2,800株
ゴールドクレスト	6,700	3,160.00	21,172,000	貸付株式数 1,500株
リログループ	57,700	1,844.50	106,427,650	
エスリード	4,700	4,340.00	20,398,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	15,900	529.00	8,411,100	貸付株式数 5,200株

日本エスコン	26,000	978.00	25,428,000	貸付株式数	3,800株
MIRARTHホールディング	58,200	509.00	29,623,800		
A V A N T I A	600	770.00	462,000	貸付株式数	500株
イオンモール	60,000	2,030.00	121,800,000		
毎日コムネット	400	708.00	283,200	貸付株式数	100株
ファースト住建	500	988.00	494,000	貸付株式数	400株
ランド	640,600	9.00	5,765,400	貸付株式数	119,600株
カチタス	26,700	2,128.00	56,817,600		
東祥	8,700	627.00	5,454,900		
トーセイ	16,500	2,430.00	40,095,000	貸付株式数	6,200株
穴吹興産	300	1,994.00	598,200	貸付株式数	200株
サンフロンティア不動産	16,500	1,857.00	30,640,500		
インテリックス	300	714.00	214,200		
ランドビジネス	400	203.00	81,200	貸付株式数	300株
サンネクスタグループ	400	1,003.00	401,200	貸付株式数	100株
グランディハウス	9,300	550.00	5,115,000	貸付株式数	2,900株
東武鉄道	106,200	2,572.00	273,146,400		
相鉄ホールディングス	33,300	2,444.00	81,385,200	貸付株式数	13,000株
東急	282,600	1,725.50	487,626,300		
京浜急行	124,700	1,340.00	167,098,000		
小田急電鉄	166,700	1,584.50	264,136,150	貸付株式数	65,700株
京王電鉄	53,300	3,916.00	208,722,800		
京成電鉄	58,500	4,523.00	264,595,500	貸付株式数	24,400株
富士急行	12,400	2,300.00	28,520,000		
東日本旅客鉄道	555,800	2,935.50	1,631,550,900		
西日本旅客鉄道	257,500	2,842.00	731,815,000		
東海旅客鉄道	388,200	3,099.00	1,203,031,800		
東京地下鉄	168,500	1,677.50	282,658,750		
西武ホールディングス	109,700	3,042.00	333,707,400	貸付株式数	22,000株
鴻池運輸	17,200	3,000.00	51,600,000	貸付株式数	1,600株
西日本鉄道	29,200	2,277.50	66,503,000	貸付株式数	11,400株
ハマキョウレックス	34,400	1,293.00	44,479,200		
サカイ引越センター	12,800	2,369.00	30,323,200		
近鉄グループHLDGS	107,800	3,174.00	342,157,200		
阪急阪神HLDGS	134,200	4,150.00	556,930,000	貸付株式数	50,400株
南海電鉄	44,900	2,425.50	108,904,950	貸付株式数	7,900株
京阪ホールディングス	55,500	3,438.00	190,809,000	貸付株式数	7,500株
神戸電鉄	2,700	2,360.00	6,372,000	貸付株式数	1,000株
名古屋鉄道	111,200	1,732.50	192,654,000	貸付株式数	33,000株



山陽電鉄	7,600	2,020.00	15,352,000	貸付株式数	2,700株
トランコム	1,200	10,250.00	12,300,000		
ヤマトホールディングス	122,300	1,712.50	209,438,750		
山 九	24,300	5,164.00	125,485,200		
日 新	6,900	4,360.00	30,084,000		
丸 運	700	471.00	329,700	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	6,200	6,490.00	40,238,000	貸付株式数	2,100株
センコーグループHLDGS	59,200	1,503.00	88,977,600	貸付株式数	23,300株
トナミホールディングス	2,200	5,440.00	11,968,000		
ニッコンホールディングス	57,200	1,996.00	114,171,200	貸付株式数	22,400株
日石輸送	100	2,898.00	289,800		
福山通運	10,800	3,795.00	40,986,000		
セイノーホールディングス	49,500	2,450.00	121,275,000	貸付株式数	21,800株
神奈川中央交通	2,800	3,800.00	10,640,000		
AZ-COM丸和ホールディ	31,200	1,008.00	31,449,600	貸付株式数	12,200株
日本郵船	208,500	4,835.00	1,008,097,500		
商船三井	191,300	5,153.00	985,768,900		
川崎汽船	229,000	2,012.00	460,748,000		
NSユナイテッド海運	6,300	4,035.00	25,420,500	貸付株式数	2,400株
明海グループ	1,200	662.00	794,400	貸付株式数	900株
飯野海運	36,900	1,115.00	41,143,500	貸付株式数	600株
共栄タンカー	200	1,082.00	216,400	貸付株式数	100株
九州旅客鉄道	77,100	3,961.00	305,393,100		
SGホールディングス	169,000	1,462.50	247,162,500	貸付株式数	9,100株
NIPPON EXPRESS	36,100	7,728.00	278,980,800		
ID&E ホールディングス	6,000	6,480.00	38,880,000		
日本航空	230,700	2,519.50	581,248,650		
ANAホールディングス	273,800	2,924.00	800,591,200		
ビーウィズ	2,100	1,502.00	3,154,200	貸付株式数	800株
TREホールディングス	23,800	1,635.00	38,913,000		
人・夢・技術グループ	4,300	1,495.00	6,428,500		
西本WISMETTAC HD	6,300	1,927.00	12,140,100	貸付株式数	600株
シルバーライフ	2,900	736.00	2,134,400	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	100	2,330.00	233,000		
GENKY DRUGSTORES	9,300	3,100.00	28,830,000		
コア商事HLDGS	7,900	602.00	4,755,800	貸付株式数	2,100株
KPPグループホールディン	22,100	650.00	14,365,000		
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	200	1,274.00	254,800	貸付株式数	100株

ブックオフGHD	7,700	1,439.00	11,080,300	貸付株式数	2,900株
ギフトホールディングス	5,300	3,310.00	17,543,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	105,000	1,104.00	115,920,000		
三井倉庫HOLD	10,400	7,510.00	78,104,000		
住友倉庫	29,900	2,727.00	81,537,300		
渋沢倉庫	4,600	3,080.00	14,168,000		
ヤマタネ	4,300	3,685.00	15,845,500		
東陽倉庫	300	1,468.00	440,400		
乾汽船	12,800	1,544.00	19,763,200	貸付株式数	4,500株
日本トランスシティ	20,200	1,036.00	20,927,200		
ケイヒン	200	1,946.00	389,200		
中央倉庫	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数	2,100株
川西倉庫	200	1,049.00	209,800	貸付株式数	100株
安田倉庫	6,900	1,737.00	11,985,300	貸付株式数	2,400株
ファイズホールディングス	200	943.00	188,600		
NISSOHD	9,000	766.00	6,894,000	貸付株式数	3,400株
大栄環境	22,600	3,080.00	69,608,000	貸付株式数	5,500株
日本管財ホールディング	10,900	2,568.00	27,991,200		
東洋埠頭	300	1,255.00	376,500		
上組	46,500	3,372.00	156,798,000		
サンリツ	300	780.00	234,000		
キムラユニティー	500	1,445.00	722,500		
キューソー流通システム	6,700	2,414.00	16,173,800	貸付株式数	1,800株
東海運	600	320.00	192,000	貸付株式数	500株
エーアイテイー	6,300	1,740.00	10,962,000		
内外トランスライン	4,000	2,804.00	11,216,000	貸付株式数	1,500株
ショーエイコーポ	400	572.00	228,800	貸付株式数	300株
日本コンセプト	3,700	1,795.00	6,641,500		
TBSホールディングス	50,800	3,820.00	194,056,000	貸付株式数	19,100株
日本テレビHLDS	89,500	2,500.00	223,750,000	貸付株式数	7,700株
朝日放送グループHD	9,500	616.00	5,852,000	貸付株式数	3,100株
テレビ朝日HD	24,500	2,213.00	54,218,500		
スカパーJSATHD	78,500	886.00	69,551,000		
テレビ東京HD	6,200	3,045.00	18,879,000	貸付株式数	2,400株
日本BS放送	400	887.00	354,800	貸付株式数	300株
ビジョン	15,100	1,420.00	21,442,000	貸付株式数	5,800株
スマートバリュー	300	300.00	90,000	貸付株式数	200株
U-NEXT HOLDINGS	33,900	1,661.00	56,307,900	貸付株式数	12,500株
ワイヤレスゲート	500	215.00	107,500		

日本通信	81,400	138.00	11,233,200	貸付株式数	33,900株
クロップス	100	986.00	98,600		
日本電信電話	30,067,400	155.20	4,666,460,480	貸付株式数	5,224,500株
KDDI	743,500	4,957.00	3,685,529,500		
ソフトバンク	16,175,000	195.00	3,154,125,000		
光通信	11,700	33,060.00	386,802,000	貸付株式数	400株
エムティーアイ	6,900	1,280.00	8,832,000	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	32,900	2,606.00	85,737,400		
ファイバーゲート	5,400	937.00	5,059,800	貸付株式数	1,700株
アイドママーケティングコ ミュ	300	225.00	67,500	貸付株式数	200株
KADOKAWA	53,400	4,384.00	234,105,600	貸付株式数	9,300株
学研ホールディングス	18,500	1,026.00	18,981,000		
ゼンリン	17,300	810.00	14,013,000		
昭文社ホールディングス	500	394.00	197,000		
インプレスホールディング ス	1,100	138.00	151,800	貸付株式数	1,000株
東京電力HD	847,900	542.30	459,816,170	貸付株式数	326,500株
中部電力	371,400	1,611.00	598,325,400		
関西電力	505,600	1,995.50	1,008,924,800	貸付株式数	167,500株
中国電力	175,100	961.30	168,323,630		
北陸電力	103,100	904.40	93,243,640	貸付株式数	38,700株
東北電力	265,300	1,256.00	333,216,800		
四国電力	93,900	1,255.00	117,844,500		
九州電力	232,300	1,529.50	355,302,850		
北海道電力	105,500	873.80	92,185,900	貸付株式数	41,500株
沖縄電力	25,700	956.00	24,569,200	貸付株式数	9,000株
電源開発	75,900	2,522.50	191,457,750		
エフオン	7,300	409.00	2,985,700		
イーレックス	19,600	626.00	12,269,600	貸付株式数	7,600株
レノバ	27,500	786.00	21,615,000	貸付株式数	10,700株
東京瓦斯	190,500	4,521.00	861,250,500		
大阪瓦斯	198,000	3,297.00	652,806,000		
東邦瓦斯	39,700	3,814.00	151,415,800	貸付株式数	15,600株
北海道瓦斯	30,100	540.00	16,254,000	貸付株式数	5,000株
広島ガス	21,300	375.00	7,987,500		
西部ガスHLDGS	10,500	1,735.00	18,217,500	貸付株式数	4,000株
静岡ガス	23,000	1,017.00	23,391,000		
メタウォーター	13,800	1,790.00	24,702,000		

アイネット	6,100	1,615.00	9,851,500	貸付株式数	2,300株
松竹	5,800	10,700.00	62,060,000	貸付株式数	1,500株
東宝	63,300	6,535.00	413,665,500		
エイチ・アイ・エス	33,100	1,790.00	59,249,000	貸付株式数	5,300株
東映	16,700	6,300.00	105,210,000	貸付株式数	6,500株
ラックランド	4,300	1,898.00	8,161,400	貸付株式数	1,200株
NTTデータグループ	264,300	2,879.50	761,051,850		
共立メンテナンス	32,500	2,747.00	89,277,500	貸付株式数	12,800株 (600株)
イチネンホールディングス	10,100	1,877.00	18,957,700		
建設技術研究所	5,300	4,855.00	25,731,500	貸付株式数	1,600株
スペース	7,500	1,143.00	8,572,500		
アインホールディングス	14,700	5,020.00	73,794,000	貸付株式数	4,300株
燦ホールディングス	8,700	1,037.00	9,021,900		
ピー・シー・エー	6,600	2,142.00	14,137,200		
スバル興業	4,000	2,935.00	11,740,000	貸付株式数	600株
東京テアトル	400	1,086.00	434,400	貸付株式数	200株
タナベコンサルティンググループ	4,500	1,198.00	5,391,000	貸付株式数	1,100株
ビジネスB太田昭和	4,300	2,095.00	9,008,500		
ナガワ	2,800	6,120.00	17,136,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	7,600	4,285.00	32,566,000	貸付株式数	3,000株
カナモト	16,100	2,922.00	47,044,200		
D T S	18,300	4,240.00	77,592,000		
スクウェア・エニックス・HD	50,800	6,040.00	306,832,000		
シーイーシー	12,800	2,042.00	26,137,600		
カプコン	200,900	3,510.00	705,159,000		
ニシオホールディングス	8,600	3,720.00	31,992,000		
アイ・エス・ビー	4,700	1,388.00	6,523,600	貸付株式数	1,200株
アゴーラホスピタリティーズG	7,200	45.00	324,000	貸付株式数	6,800株
日本空港ビルデング	35,100	5,099.00	178,974,900	貸付株式数	8,300株
トランス・コスモス	13,200	3,435.00	45,342,000		
乃村工藝社	45,200	775.00	35,030,000		
S C S K	82,500	3,043.00	251,047,500		
藤田観光	4,600	8,930.00	41,078,000	貸付株式数	1,000株
KNT-CTホールディングス	6,200	1,200.00	7,440,000	貸付株式数	1,000株
トーカイ	9,200	2,190.00	20,148,000		
白洋舎	200	2,244.00	448,800	貸付株式数	100株

セコム	211,000	5,256.00	1,109,016,000	
N S W	4,500	3,080.00	13,860,000	
セントラル警備保障	5,600	2,687.00	15,047,200	
アイネス	7,900	1,731.00	13,674,900	
丹青社	21,900	808.00	17,695,200	
メイテックグループホール デ	38,200	2,823.50	107,857,700	
T K C	18,000	3,875.00	69,750,000	貸付株式数 3,500株
富士ソフト	26,300	9,568.00	251,638,400	
応用地質	9,700	2,410.00	23,377,000	
船井総研ホールディング ン	20,700	2,401.00	49,700,700	貸付株式数 6,600株
N S D	38,900	3,430.00	133,427,000	貸付株式数 9,400株
進学会ホールディングス	400	201.00	80,400	貸付株式数 200株 (200株)
丸紅建材リース	100	2,900.00	290,000	
オ オ バ	800	989.00	791,200	
コナミグループ	37,900	14,960.00	566,984,000	
いであ	300	2,498.00	749,400	
学 究 社	4,100	1,916.00	7,855,600	
イオンディライト	11,100	4,495.00	49,894,500	
ナック	10,500	579.00	6,079,500	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータHLDS	7,000	2,901.00	20,307,000	
ダイセキ	25,000	3,945.00	98,625,000	貸付株式数 2,600株
ステップ	3,800	2,027.00	7,702,600	
泉州電業	7,300	5,160.00	37,668,000	貸付株式数 2,800株
GENKI GLOBAL DIN	6,000	3,700.00	22,200,000	貸付株式数 200株
トラスコ中山	22,400	2,164.00	48,473,600	
ヤマダホールディングス	328,000	450.80	147,862,400	
オートバックスセブン	37,100	1,428.00	52,978,800	
モリト	8,500	1,485.00	12,622,500	
アーケランズ	31,700	1,676.00	53,129,200	
ニトリホールディングス	38,800	19,190.00	744,572,000	
グルメ杵屋	8,600	1,064.00	9,150,400	貸付株式数 2,500株
愛 眼	800	145.00	116,000	
ケーユーホールディングス	6,200	1,132.00	7,018,400	
吉野家ホールディングス	41,700	3,235.00	134,899,500	貸付株式数 16,400株 (4,400株)
加藤産業	13,200	4,495.00	59,334,000	
北恵	300	783.00	234,900	
イノテック	7,200	1,385.00	9,972,000	

イエローハット	18,800	2,551.00	47,958,800	貸付株式数	7,400株
松屋フーズHLDGS	5,000	6,470.00	32,350,000		
JBCCホールディングス	6,700	4,720.00	31,624,000		
JKホールディングス	8,200	1,048.00	8,593,600		
サガミホールディングス	17,100	1,739.00	29,736,900	貸付株式数	5,400株 (5,400株)
日 伝	6,100	3,060.00	18,666,000	貸付株式数	2,300株
ミロク情報サービス	9,200	1,938.00	17,829,600	貸付株式数	900株
北沢産業	800	356.00	284,800	貸付株式数	700株
杉本商事	9,500	1,349.00	12,815,500	貸付株式数	1,500株
因幡電機産業	29,800	3,854.00	114,849,200		
王将フードサービス	21,100	3,015.00	63,616,500	貸付株式数	6,000株
ミニストップ	8,900	1,777.00	15,815,300	貸付株式数	3,400株 (1,200株)
アークス	17,900	2,532.00	45,322,800		
パローホールディングス	20,300	2,131.00	43,259,300		
東 テ ク	10,500	2,469.00	25,924,500	貸付株式数	4,200株
ミスミグループ本社	161,100	2,452.50	395,097,750		
アルテック	600	212.00	127,200		
ベ ル ク	5,300	6,700.00	35,510,000		
大 庄	6,400	1,041.00	6,662,400	貸付株式数	2,300株 (200株)
タキヒヨー	300	1,221.00	366,300	貸付株式数	200株
ファーストリテイリング	60,000	50,430.00	3,025,800,000		
ソフトバンクグループ	498,600	8,906.00	4,440,531,600		
蔵王産業	200	2,410.00	482,000		
スズケン	35,200	4,699.00	165,404,800	貸付株式数	6,800株
サンドラッグ	36,000	3,687.00	132,732,000		
サックスパーホールディング	10,100	918.00	9,271,800	貸付株式数	3,000株
ゲ					
ジェコス	6,400	982.00	6,284,800		
ヤマザワ	200	1,173.00	234,600		
や ま や	300	2,829.00	848,700	貸付株式数	100株
ベルーナ	25,700	752.00	19,326,400	貸付株式数	9,600株
合計			391,517,177,670		

(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。

リクルートホールディングス	35,000株
日 立	80,000株

トヨタ自動車	60,000株
三菱商事	60,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,974,825	6,433,302
親投資信託受益証券	3,426,914,693	3,370,584,415
未収入金	1,960,000	1,760,000
流動資産合計	3,437,849,518	3,378,777,717
資産合計	3,437,849,518	3,378,777,717
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,761,795	2,187,492
未払受託者報酬	365,208	354,595
未払委託者報酬	5,204,762	5,053,672
その他未払費用	91,234	88,573
流動負債合計	10,422,999	7,684,332
負債合計	10,422,999	7,684,332
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,202,806,904	1,622,883,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,402,619,615	1,748,210,044
（分配準備積立金）	543,431,730	836,205,739
元本等合計	3,427,426,519	3,371,093,385
純資産合計	3,427,426,519	3,371,093,385
負債純資産合計	3,437,849,518	3,378,777,717

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		5,995
有価証券売買等損益		310,693,856		710,142,722
営業収益合計		310,693,857		710,148,717
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,004		121
受託者報酬		816,219		729,157
委託者報酬		11,632,115		10,391,793
その他費用		203,908		182,142
営業費用合計		12,654,246		11,303,213
営業利益又は営業損失（ ）		298,039,611		698,845,504
経常利益又は経常損失（ ）		298,039,611		698,845,504
当期純利益又は当期純損失（ ）		298,039,611		698,845,504
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（ ）		63,542,580		137,221,562
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,633,209,242		1,402,619,615
剰余金増加額又は欠損金減少額		233,246,290		315,079,359
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		233,246,290		315,079,359
剰余金減少額又は欠損金増加額		698,332,948		531,112,872
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		698,332,948		531,112,872
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,402,619,615		1,748,210,044

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	2,885,499,363円	2,024,806,904円
期中追加設定元本額	370,879,531円	355,014,131円
期中一部解約元本額	1,231,571,990円	756,937,694円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,024,806,904口	1,622,883,341口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(987,164,993円)及び分配準備積立金(543,431,730円)より分配対象額は1,530,596,723円(1万口当たり7,559.22円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,699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(481,681,806円)、投資信託約款に規定される収益調整金(912,004,305円)及び分配準備積立金(354,518,234円)より分配対象額は1,748,210,044円(1万口当たり10,772.25円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	254,309,573	593,387,044
合計	254,309,573	593,387,044

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.6927円	2.0772円
(1万口当たり純資産額)	(16,927円)	(20,772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	997,302,842	3,370,584,415	
親投資信託受益証券 合計			3,370,584,415	
合計			3,370,584,415	

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

	2023年11月30日現在 金額 (円)	2024年12月2日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		468,910,819	283,219,293
コール・ローン		1,625,480,455	5,266,379,638
株式		99,321,781,063	133,916,598,811
投資証券		2,110,111,975	2,716,890,931
派生商品評価勘定		2,029,272,458	186,813,022
未収入金		591,894	1,766,096,238
未収配当金		134,381,858	151,896,769
差入委託証拠金		1,674,537,110	1,596,884,845
流動資産合計		107,365,067,632	145,884,779,547
資産合計		107,365,067,632	145,884,779,547
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		358,133,485	27,071,038
未払金		-	3,057,508
未払解約金		2,500,010	36,615,750
流動負債合計		360,633,495	66,744,296
負債合計		360,633,495	66,744,296
純資産の部			
元本等			
元本	1	38,987,514,233	43,145,417,523
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		68,016,919,904	102,672,617,728
元本等合計		107,004,434,137	145,818,035,251
純資産合計		107,004,434,137	145,818,035,251
負債純資産合計		107,365,067,632	145,884,779,547

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額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



<p>3. 収益及び費用の計上基準</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>受取配当金</p> <p>原則として、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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	31,500,797,366円	38,987,514,233円
期中追加設定元本額	13,170,049,353円	15,152,252,360円
期中一部解約元本額	5,683,332,486円	10,994,349,070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	26,442,641,108円	28,505,073,774円
インデックス（為替ヘッジあり）		

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	1,248,602,599円	997,302,842円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	3,297,141,682円	3,728,648,479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)	609,860円	891,376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)	7,998,518,984円	9,682,800,969円
外国株式インデックス為替ヘッジ型ファンドVA(適格機関投資家専用)	-円	230,700,083円
計	38,987,514,233円	43,145,417,523円
2. 期末日における受益権の総数	38,987,514,233口	43,145,417,523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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	10,785,563,463	22,925,686,176
新株予約権証券	161,733	0
投資証券	62,836,540	236,875,873
合計	10,722,565,190	23,162,562,049

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	3,868,013,470	-	4,061,016,758	193,003,288	8,531,847,840	-	8,694,283,816	162,435,976
合計	3,868,013,470	-	4,061,016,758	193,003,288	8,531,847,840	-	8,694,283,816	162,435,976

## (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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	98,390,372,124	-	96,912,236,439	1,478,135,685	136,213,295,039	-	136,215,989,031	2,693,992
アメリカ・ドル	73,515,836,997	-	71,708,235,758	1,807,601,239	106,797,819,672	-	106,800,239,968	2,420,296
イギリス・ ポンド	4,413,877,813	-	4,504,213,208	90,335,395	5,002,948,726	-	5,002,712,730	235,996
イスラエル・ シェケル	113,137,036	-	120,230,095	7,093,059	158,231,223	-	158,502,058	270,835

オーストラリア・ドル	2,083,637,481	-	2,126,821,270	43,183,789	2,649,843,812	-	2,649,975,710	131,898
カナダ・ドル	3,251,582,250	-	3,239,636,805	11,945,445	4,250,809,973	-	4,250,903,013	93,040
シンガポール・ドル	390,167,133	-	390,889,775	722,642	485,381,735	-	485,303,345	78,390
スイス・フラン	2,786,873,425	-	2,827,357,566	40,484,141	3,244,567,510	-	3,244,264,017	303,493
スウェーデン・クローナ	888,921,206	-	935,464,136	46,542,930	1,102,547,746	-	1,103,030,624	482,878
デンマーク・クローネ	1,002,202,106	-	1,014,834,137	12,632,031	1,120,675,359	-	1,121,215,977	540,618
ニュージーランド・ドル	59,813,937	-	62,016,384	2,202,447	73,933,465	-	73,956,437	22,972
ノルウェー・クローネ	203,438,924	-	208,263,765	4,824,841	220,856,457	-	220,781,140	75,317
ユーロ	9,005,139,703	-	9,114,045,267	108,905,564	10,447,147,209	-	10,446,445,006	702,203
香港・ドル	675,744,113	-	660,228,273	15,515,840	658,532,152	-	658,659,006	126,854
合計	98,390,372,124	-	96,912,236,439	1,478,135,685	136,213,295,039	-	136,215,989,031	2,693,992

## (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	2.7446円	3.3797円
(1万口当たり純資産額)	(27,446円)	(33,797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	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,566	236.020	369,607.320	
	PALO ALTO NETWORKS INC	4,324	387.820	1,676,933.680	
	FIRST SOLAR INC	1,358	199.270	270,608.660	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,316	170.840	395,665.440	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,694	148.180	251,016.920	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,506	67.520	371,765.120	
	ABBOTT LABORATORIES	23,262	118.770	2,762,827.740	
	HOWMET AEROSPACE INC	5,151	118.380	609,775.380	
	VERISK ANALYTICS INC	1,935	294.210	569,296.350	
	LAS VEGAS SANDS CORP	5,159	53.060	273,736.540	
	AMPHENOL CORP-CL A	16,130	72.650	1,171,844.500	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	619	567.640	351,369.160	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,423	85.300	633,181.900	
	QORVO INC	1,347	69.050	93,010.350	
	AFLAC INC	7,241	114.000	825,474.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,570	176.270	276,743.900	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,095	138.250	289,633.750	
	ADOBE INC	5,894	515.930	3,040,891.420	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,424	89.660	217,335.840	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,473	320.660	472,332.180	
	GARMIN LTD	2,084	212.600	443,058.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,040	334.330	1,016,363.200	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,661	232.930	2,017,406.730	
	WR BERKLEY CORP	4,068	64.550	262,589.400	
	AUTOZONE INC	239	3,169.540	757,520.060	
	DOLLAR TREE INC	2,680	71.270	191,003.600	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	16,065	16.780	269,570.700	
	CELANESE CORP	1,516	73.210	110,986.360	
	DR HORTON INC	3,956	168.780	667,693.680	
	AUTODESK INC	2,859	291.900	834,542.100	
MOODY'S CORP	2,230	499.980	1,114,955.400		
DEVON ENERGY CORP	8,716	37.950	330,772.200		

ALBEMARLE CORP	1,589	107.700	171,135.300	
ATMOS ENERGY CORP	1,983	151.320	300,067.560	
ALLIANT ENERGY CORP	3,469	63.200	219,240.800	
CITIGROUP INC	25,536	70.870	1,809,736.320	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,469	306.930	1,678,600.170	
AMERICAN ELECTRIC POWER	7,135	99.860	712,501.100	
DOMINO'S PIZZA INC	507	476.190	241,428.330	
HESS CORP	3,730	147.180	548,981.400	
DAVITA INC	709	166.170	117,814.530	
DANAHER CORP	8,949	239.690	2,144,985.810	
FORTIVE CORP	4,657	79.330	369,439.810	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,735	160.960	1,245,025.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,606	54.600	360,687.600	
APPLE INC	204,063	237.330	48,430,271.790	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,419	182.430	623,728.170	
BOEING CO/THE	9,842	155.440	1,529,840.480	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,113	159.830	337,720.790	
BECTON DICKINSON AND CO	3,877	221.900	860,306.300	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,682	165.400	278,202.800	
NISOURCE INC	6,111	38.090	232,767.990	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,604	105.580	169,350.320	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,884	81.870	809,203.080	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,367	44.340	2,499,312.780	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	17,659	483.020	8,529,650.180	
ANSYS INC	1,167	351.100	409,733.700	
TRUIST FINANCIAL CORP	17,886	47.680	852,804.480	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	9,632	191.090	1,840,578.880	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,175	59.220	1,609,303.500	
JPMORGAN CHASE & CO	37,969	249.720	9,481,618.680	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,055	123.840	378,331.200	
LKQ CORP	3,687	39.290	144,862.230	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,398	42.080	100,907.840	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,628	306.810	1,113,106.680	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,252	573.970	718,610.440	
DOLLAR GENERAL CORP	2,977	77.270	230,032.790	
SERVICENOW INC	2,730	1,049.440	2,864,971.200	
CATERPILLAR INC	6,518	406.110	2,647,024.980	
BROWN & BROWN INC	3,273	113.100	370,176.300	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,306	40.030	132,339.180	

CHARLES RIVER LABORATORIES	674	199.060	134,166.440	
CMS ENERGY CORP	4,133	69.710	288,111.430	
MOSAIC CO/THE	4,541	26.460	120,154.860	
DELTA AIR LINES INC	2,019	63.820	128,852.580	
CORNING INC	10,870	48.670	529,042.900	
CISCO SYSTEMS INC	53,980	59.210	3,196,155.800	
MORGAN STANLEY	16,288	131.610	2,143,663.680	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,000	195.960	391,920.000	
MSCI INC	1,080	609.630	658,400.400	
FAIR ISAAC CORP	299	2,375.030	710,133.970	
LENNOX INTERNATIONAL INC	370	667.130	246,838.100	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	800	285.440	228,352.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	77.340	231,865.320	
BROADCOM INC	59,180	162.080	9,591,894.400	
UNITED THERAPEUTICS CORP	600	370.490	222,294.000	
CNH INDUSTRIAL NV	11,900	12.560	149,464.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	800	207.240	165,792.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,705	253.070	431,484.350	
DTE ENERGY COMPANY	2,790	125.780	350,926.200	
CENTENE CORP	7,164	60.000	429,840.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,382	215.850	298,304.700	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,265	48.140	301,597.100	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,920	312.240	911,740.800	
GARTNER INC	1,023	517.930	529,842.390	
DOMINION ENERGY INC	11,228	58.750	659,645.000	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,856	55.130	543,361.280	
SMITH (A.O.) CORP	1,600	74.490	119,184.000	
DEERE & CO	3,509	465.900	1,634,843.100	
QUANTA SERVICES INC	2,026	344.520	697,997.520	
POOL CORP	480	377.090	181,003.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,494	118.960	415,646.240	
BURLINGTON STORES INC	866	281.880	244,108.080	
NASDAQ INC	5,841	82.990	484,744.590	
TARGA RESOURCES CORP	2,831	204.300	578,373.300	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	974	146.860	143,041.640	
WESTLAKE CORP	524	128.400	67,281.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,576	100.590	460,299.840	
TELEFLEX INC	645	192.850	124,388.250	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,128	189.110	213,316.080	



WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	994	325.680	323,725.920	
BIO-RAD LABORATORIES-A	341	340.530	116,120.730	
CATALENT INC	2,263	61.110	138,291.930	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,106	227.850	479,852.100	
MOLINA HEALTHCARE INC	783	297.900	233,255.700	
CARLISLE COS INC	600	456.700	274,020.000	
IDEX CORP	960	230.630	221,404.800	
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,381	96.630	1,003,116.030	
ROLLINS INC	3,960	50.330	199,306.800	
AECOM	1,900	116.970	222,243.000	
WATSCO INC	500	551.600	275,800.000	
GRACO INC	2,200	91.080	200,376.000	
AMETEK INC	3,065	194.380	595,774.700	
TORO CO	1,300	87.080	113,204.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,347	110.130	368,605.110	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,047	59.360	121,509.920	
HEICO CORP	635	273.370	173,589.950	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	521	490.670	255,639.070	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,506	83.340	292,190.040	
TYLER TECHNOLOGIES INC	614	629.170	386,310.380	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,920	971.880	5,753,529.600	
EPAM SYSTEMS INC	763	243.920	186,110.960	
RPM INTERNATIONAL INC	1,836	138.780	254,800.080	
RELIANCE INC	800	321.240	256,992.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18,400	61.520	1,131,968.000	
CUMMINS INC	1,795	375.040	673,196.800	
CDW CORP/DE	1,787	175.930	314,386.910	
COSTAR GROUP INC	5,463	81.340	444,360.420	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,556	225.140	575,457.840	
MERCADOLIBRE INC	609	1,985.170	1,208,968.530	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	990	176.180	174,418.200	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,387	253.440	858,401.280	
DEXCOM INC	5,335	77.990	416,076.650	
NORDSON CORP	672	260.990	175,385.280	
COPART INC	11,636	63.390	737,606.040	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,450	177.590	435,095.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	962	232.770	223,924.740	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,038	325.150	337,505.700	
TRANSDIGM GROUP INC	760	1,252.970	952,257.200	

BIO-TECHNE CORP	2,164	75.360	163,079.040	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,326	126.750	168,070.500	
KINDER MORGAN INC	26,843	28.270	758,851.610	
HCA HEALTHCARE INC	2,645	327.220	865,496.900	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	258.690	134,518.800	
COTERRA ENERGY INC	10,277	26.720	274,601.440	
T-MOBILE US INC	7,116	246.940	1,757,225.040	
ZILLOW GROUP INC - C	2,086	84.710	176,705.060	
EMCOR GROUP INC	600	510.120	306,072.000	
COCA-COLA CO/THE	54,833	64.080	3,513,698.640	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,975	77.580	230,800.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	121.640	234,157.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,073	22.760	92,701.480	
CSX CORP	26,231	36.550	958,743.050	
EXPEDIA GROUP INC	1,696	184.620	313,115.520	
AMAZON.COM INC	126,585	207.890	26,315,755.650	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,144	71.350	581,074.400	
EXXON MOBIL CORP	60,129	117.960	7,092,816.840	
AES CORP	9,221	13.040	120,241.840	
EVEREST GROUP LTD	596	387.560	230,985.760	
EOG RESOURCES INC	7,652	133.260	1,019,705.520	
EQT CORP	7,803	45.440	354,568.320	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,010	94.020	188,980.200	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	2,295.000	307,530.000	
CENCORA INC	2,362	251.550	594,161.100	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,915	137.970	540,152.550	
FORD MOTOR CO	52,478	11.130	584,080.140	
EXACT SCIENCES CORP	2,547	62.080	158,117.760	
ENTEGRIS INC	2,093	105.630	221,083.590	
MICROSTRATEGY INC-CL A	2,500	387.470	968,675.000	
AERCAP HOLDINGS NV	2,801	99.360	278,307.360	
FORTINET INC	8,669	95.050	823,988.450	
MARKEL CORP	170	1,782.920	303,096.400	
NEXTERA ENERGY INC	27,493	78.670	2,162,874.310	
FREEMPORT-MCMORAN INC	19,150	44.200	846,430.000	
INSULET CORP	909	266.780	242,503.020	
US BANCORP	20,920	53.290	1,114,826.800	
UNITED RENTALS INC	896	866.000	775,936.000	
F5 NETWORKS INC	759	250.350	190,015.650	

SUPER MICRO COMPUTER INC	7,300	32.640	238,272.000	
FASTENAL CO	7,742	83.560	646,921.520	
FISERV INC	7,803	220.960	1,724,150.880	
GENERAL ELECTRIC CO	14,712	182.160	2,679,937.920	
AXON ENTERPRISE INC	1,000	646.960	646,960.000	
GENERAL MOTORS CO	15,342	55.590	852,861.780	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,062	284.010	869,638.620	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,289	608.570	2,610,156.730	
ALPHABET INC-CL A	78,668	168.950	13,290,958.600	
ALPHABET INC-CL C	67,240	170.490	11,463,747.600	
OWENS CORNING	1,183	205.620	243,248.460	
GENERAL MILLS INC	7,535	66.260	499,269.100	
FIRSTENERGY CORP	7,603	42.550	323,507.650	
GENUINE PARTS CO	1,854	126.730	234,957.420	
FIFTH THIRD BANCORP	9,220	48.060	443,113.200	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,513	246.250	618,826.250	
HALLIBURTON CO	11,933	31.860	380,185.380	
HOME DEPOT INC	13,254	429.130	5,687,689.020	
ASSURANT INC	702	227.100	159,424.200	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,148	18.010	362,865.480	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	497	197.920	98,366.240	
HERSHEY CO/THE	2,015	176.130	354,901.950	
HUMANA INC	1,608	296.380	476,579.040	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,409	229.370	781,922.330	
HENRY SCHEIN INC	1,691	77.050	130,291.550	
HP INC	13,105	35.430	464,310.150	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,038	21.220	382,766.360	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,963	100.720	499,873.360	
KRAFT HEINZ CO/THE	12,198	31.970	389,970.060	
ENPHASE ENERGY INC	1,938	71.350	138,276.300	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,333	227.410	2,804,647.530	
HUBBELL INC	739	460.090	340,006.510	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,624	58.830	272,029.920	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	1,700	78.300	133,110.000	
ZOETIS INC	6,098	175.250	1,068,674.500	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,032	416.220	1,261,979.040	
CHENIERE ENERGY INC	3,078	224.010	689,502.780	
HYATT HOTELS CORP - CL A	600	157.940	94,764.000	

ALLEGION PLC	1,242	140.840	174,923.280	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,600	186.470	298,352.000	
WASTE CONNECTIONS INC	3,542	192.470	681,728.740	
JUNIPER NETWORKS INC	3,998	35.920	143,608.160	
JM SMUCKER CO/THE	1,425	117.790	167,850.750	
JOHNSON & JOHNSON	32,194	155.010	4,990,391.940	
ABBVIE INC	23,659	182.930	4,327,940.870	
HOLOGIC INC	3,173	79.500	252,253.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,477	139.350	623,869.950	
KROGER CO	9,192	61.080	561,447.360	
KLA CORP	1,798	647.030	1,163,359.940	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,941	529.410	1,556,994.810	
CORPAY INC	940	381.180	358,309.200	
LOWE'S COS INC	7,553	272.430	2,057,663.790	
ELI LILLY & CO	10,765	795.350	8,561,942.750	
LAM RESEARCH CORP	17,490	73.880	1,292,161.200	
LOEWS CORP	2,628	86.730	227,926.440	
MCDONALD'S CORP	9,709	296.010	2,873,961.090	
3M CO	7,408	133.530	989,190.240	
META PLATFORMS INC CLASS A	29,367	574.320	16,866,055.440	
S&P GLOBAL INC	4,306	522.510	2,249,928.060	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	600.000	453,000.000	
PHILLIPS 66	5,733	133.980	768,107.340	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	2,089	263.580	550,618.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,067	38.340	117,588.780	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,388	78.410	265,653.080	
METLIFE INC	8,121	88.230	716,515.830	
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,568	92.690	1,072,237.920	
ARISTA NETWORKS INC	3,560	405.820	1,444,719.200	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,161	499.700	1,079,851.700	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	282	1,251.200	352,838.400	
BAKER HUGHES CO	13,417	43.950	589,677.150	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,500	295.140	442,710.000	
MERCK & CO. INC.	33,871	101.640	3,442,648.440	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,619	83.590	469,692.210	
MASCO CORP	2,987	80.560	240,632.720	
M & T BANK CORP	2,243	219.990	493,437.570	
MARSH & MCLENNAN COS	6,554	233.230	1,528,589.420	
HEICO CORP-CLASS A	1,047	211.130	221,053.110	

MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,209	289.090	927,689.810	
WORKDAY INC-CLASS A	2,800	249.990	699,972.000	
BLOCK INC CLASS A	7,470	88.550	661,468.500	
TRANSUNION	2,657	101.500	269,685.500	
VISTRA CORP	4,657	159.840	744,374.880	
NETAPP INC	2,697	122.640	330,760.080	
NIKE INC -CL B	16,153	78.770	1,272,371.810	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,019	275.850	832,791.150	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,172	68.170	488,915.240	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,596	169.280	439,450.880	
ALLY FINANCIAL INC	3,709	39.980	148,285.820	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,853	489.650	907,321.450	
APTIV PLC	3,576	55.530	198,575.280	
NEWMONT CORP	15,404	41.940	646,043.760	
MCKESSON CORP	1,656	628.500	1,040,796.000	
XYLEM INC	3,266	126.750	413,965.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	20,845	133.060	2,773,635.700	
NUCOR CORP	3,179	154.690	491,759.510	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	2,100	476.960	1,001,616.000	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	197.570	381,310.100	
EVERGY INC	3,023	64.630	195,376.490	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,924	50.580	451,375.920	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	440.560	118,510.640	
OKTA INC	2,095	77.560	162,488.200	
WIX.COM LTD	785	223.740	175,635.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,393	48.230	211,874.390	
KKR & CO INC	8,254	162.870	1,344,328.980	
PAYCHEX INC	4,323	146.270	632,325.210	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	769	1,243.220	956,036.180	
ALTRIA GROUP INC	23,002	57.740	1,328,135.480	
P G & E CORP	27,248	21.630	589,374.240	
PFIZER INC	75,911	26.210	1,989,627.310	
CIGNA CORP	3,753	337.800	1,267,763.400	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,776	127.590	481,779.840	
XCEL ENERGY INC	7,520	72.560	545,651.200	
STERIS PLC	1,293	219.060	283,244.580	
SEA LTD-ADR	5,247	113.800	597,108.600	
FOX CORP - CLASS B	1,930	44.730	86,328.900	
FOX CORP - CLASS A	2,995	47.120	141,124.400	

STRYKER CORP	4,646	392.150	1,821,928.900	
DOW INC	9,360	44.210	413,805.600	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,567	135.500	212,328.500	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	3,413	82.690	282,220.970	
PARKER HANNIFIN CORP	1,726	702.900	1,213,205.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	25,224	71.960	1,815,119.040	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	31,648	179.260	5,673,220.480	
EXELON CORP	13,353	39.560	528,244.680	
INGERSOLL-RAND INC	5,426	104.170	565,226.420	
NVR INC	39	9,235.580	360,187.620	
CONOCOPHILLIPS	17,502	108.340	1,896,166.680	
TWILIO INC - A	2,253	104.540	235,528.620	
DOCUSIGN INC	2,833	79.690	225,761.770	
PAYCOM SOFTWARE INC	700	231.920	162,344.000	
DAYFORCE INC	2,244	79.990	179,497.560	
PURE STORAGE INC - CLASS A	4,200	52.990	222,558.000	
PEPSICO INC	18,350	163.450	2,999,307.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	600	323.510	194,106.000	
MONGODB INC	996	322.490	321,200.040	
SNAP INC - A	13,510	11.810	159,553.100	
CORTEVA INC	9,349	62.240	581,881.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,796	129.410	620,650.360	
AMCOR PLC	19,545	10.640	207,958.800	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,101	345.970	1,072,852.970	
ROKU INC	1,827	69.030	126,117.810	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,590	136.940	354,674.600	
ACCENTURE PLC-CL A	8,398	362.370	3,043,183.260	
PENTAIR PLC	2,222	108.990	242,175.780	
QUALCOMM INC	14,951	158.530	2,370,182.030	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,095	87.090	269,543.550	
DATADOG INC - CLASS A	3,690	152.750	563,647.500	
PINTEREST INC- CLASS A	8,296	30.320	251,534.720	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,482	750.220	1,111,826.040	
REPUBLIC SERVICES INC	3,018	218.300	658,829.400	
BOOKING HOLDINGS INC	456	5,201.980	2,372,102.880	
ROSS STORES INC	4,501	154.870	697,069.870	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,198	248.850	298,122.300	
RESMED INC	1,997	249.020	497,292.940	

QUEST DIAGNOSTICS INC	1,527	162.660	248,381.820	
MODERNA INC	4,382	43.060	188,688.920	
HUBSPOT INC	576	721.050	415,324.800	
REVVITY INC	1,576	116.140	183,036.640	
CARRIER GLOBAL CORP	10,928	77.370	845,499.360	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,359	102.980	551,869.820	
AVANTOR INC	9,380	21.060	197,542.800	
CARLYLE GROUP INC/THE	3,173	53.230	168,898.790	
DYNATRACE INC	3,805	56.190	213,802.950	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,972	128.550	767,700.600	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,697	27.260	346,120.220	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,930	26.660	131,433.800	
MATCH GROUP INC	3,549	32.740	116,194.260	
CHEVRON CORP	23,458	161.930	3,798,553.940	
ZSCALER INC	1,218	206.590	251,626.620	
EDISON INTERNATIONAL	5,211	87.750	457,265.250	
TESLA INC	38,446	345.160	13,270,021.360	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,956	174.800	691,508.800	
GEN DIGITAL INC	7,405	30.850	228,444.250	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,045	89.450	182,925.250	
SYNOPSIS INC	2,063	558.490	1,152,164.870	
CARVANA CO	1,600	260.420	416,672.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,952	99.830	394,528.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,296	396.965	514,466.640	
VIATRIS INC	16,481	13.090	215,736.290	
DOORDASH INC - A	4,138	180.480	746,826.240	
ROBLOX CORP -CLASS A	6,570	50.130	329,354.100	
AIRBNB INC-CLASS A	5,897	136.110	802,640.670	
CBRE GROUP INC - A	4,073	139.990	570,179.270	
SOUTHERN CO/THE	14,574	89.130	1,298,980.620	
SYSCO CORP	6,674	77.110	514,632.140	
TRAVELERS COS INC/THE	3,061	266.040	814,348.440	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	900	87.230	78,507.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,600	82.630	132,208.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,027	145.270	294,462.290	
SCHLUMBERGER LTD	19,164	43.940	842,066.160	
AT&T INC	96,023	23.160	2,223,892.680	
APA CORP	4,832	22.650	109,444.800	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,008	32.360	64,978.880	

ON SEMICONDUCTOR CORP	5,783	71.120	411,286.960	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,229	397.400	1,283,204.600	
SEMPRA ENERGY	8,478	93.670	794,134.260	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,096	49.500	103,752.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,148	67.080	1,821,087.840	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,838	101.330	287,574.540	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,464	296.200	729,836.800	
TEXAS INSTRUMENTS INC	12,228	201.030	2,458,194.840	
SALESFORCE.COM INC	12,974	329.990	4,281,290.260	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,286	175.030	925,208.580	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,992	83.860	754,069.120	
TERADYNE INC	2,246	110.000	247,060.000	
UNION PACIFIC CORP	8,209	244.660	2,008,413.940	
MARATHON PETROLEUM CORP	4,650	156.150	726,097.500	
RTX CORP	17,771	121.830	2,165,040.930	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,824	135.720	1,333,313.280	
IQVIA HOLDINGS INC	2,353	200.840	472,576.520	
AMEREN CORPORATION	3,619	94.390	341,597.410	
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,269	610.200	7,486,543.800	
APPLOVIN CORP CLASS A	2,700	336.750	909,225.000	
TOAST INC CLASS A	4,872	43.540	212,126.880	
VERISIGN INC	1,216	187.180	227,610.880	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	9,997	12.230	122,263.310	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	7,100	37.540	266,534.000	
VALERO ENERGY CORP	4,488	139.080	624,191.040	
ULTA BEAUTY INC	613	386.640	237,010.320	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,608	63.390	228,711.120	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	205.000	157,235.000	
ELEVANCE HEALTH INC	3,136	406.960	1,276,226.560	
WALT DISNEY CO/THE	24,375	117.470	2,863,331.250	
WELLS FARGO & CO	46,705	76.170	3,557,519.850	
WASTE MANAGEMENT INC	5,444	228.220	1,242,429.680	
WILLIAMS COS INC	16,302	58.520	953,993.040	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,418	283.670	402,244.060	
WALMART INC	59,267	92.500	5,482,197.500	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,839	112.100	318,251.900	



WYNN RESORTS LTD	1,345	94.380	126,941.100	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	30,300	5.000	151,500.000	
WABTEC CORP	2,369	200.620	475,268.780	
TJX COMPANIES INC	15,065	125.690	1,893,519.850	
WATERS CORP	759	384.720	292,002.480	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	697	407.000	283,679.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	10,298	9.020	92,887.960	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,354	322.000	435,988.000	
WILLIAMS-SONOMA INC	1,700	172.020	292,434.000	
WESTERN DIGITAL CORP	4,544	72.990	331,666.560	
WEC ENERGY GROUP INC	4,220	101.050	426,431.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,686	94.300	630,489.800	
VISA INC-CLASS A SHARES	22,360	315.080	7,045,188.800	
PPL CORP	10,176	34.930	355,447.680	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	4,220	256.560	1,082,683.200	
PULTEGROUP INC	2,862	135.270	387,142.740	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	32,348	10.480	339,007.040	
PPG INDUSTRIES INC	3,058	124.370	380,323.460	
NORTHERN TRUST CORP	2,767	111.160	307,579.720	
NVIDIA CORP	329,010	138.250	45,485,632.500	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,263	214.720	1,130,071.360	
DRAFTKINGS INC CLASS A	6,100	43.650	266,265.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	400	250.000	100,000.000	
TYSON FOODS INC-CL A	3,833	64.500	247,228.500	
NETFLIX INC	5,753	886.810	5,101,817.930	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,097	529.630	2,699,524.110	
NRG ENERGY INC	2,811	101.610	285,625.710	
TEXTRON INC	2,488	85.630	213,047.440	
NEWS CORP - CLASS A	4,849	29.350	142,318.150	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	297	1,600.090	475,226.730	
OMNICOM GROUP	2,711	104.820	284,167.020	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,745	141.230	246,446.350	
ORACLE CORP	22,220	184.840	4,107,144.800	
MASTERCARD INC - A	11,098	532.940	5,914,568.120	
ONEOK INC	7,825	113.600	888,920.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,366	566.440	773,757.040	
U HAUL NON VOTING SERIES N	1,437	62.440	89,726.280	

ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	2,528	176.730	446,773.440	
EXPAND ENERGY CORP	2,713	98.960	268,478.480	
HF SINCLAIR CORP	2,200	40.930	90,046.000	
OVINTIV INC	3,500	45.420	158,970.000	
YUM! BRANDS INC	3,818	138.940	530,472.920	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,174	188.380	409,538.120	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,476	62.060	153,660.560	
BANK OF AMERICA CORP	94,349	47.510	4,482,520.990	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	604	485.260	293,097.040	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,586	66.030	170,753.580	
AMERICAN EXPRESS CO	7,708	304.680	2,348,473.440	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	5,847	83.220	486,587.340	
LINDE PLC	6,417	460.990	2,958,172.830	
ANALOG DEVICES INC	6,680	218.050	1,456,574.000	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	5,300	19.850	105,205.000	
MONDAYCOM LTD	511	285.360	145,818.960	
ADVANCED MICRO DEVICES	21,627	137.175	2,966,683.720	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	3,700	32.370	119,769.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	2,769	88.360	244,668.840	
KENVUE INC	25,696	24.080	618,759.680	
GLOBAL E ONLINE LTD	1,200	52.280	62,736.000	
VERALTO CORP	3,432	108.190	371,308.080	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,928	76.880	686,384.640	
BUNGE GLOBAL LTD	1,884	89.740	169,070.160	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	4,900	127.600	625,240.000	
NUTANIX INC CLASS A	3,500	65.280	228,480.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,129	87.590	186,479.110	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,283	244.060	801,248.980	
AVERY DENNISON CORP	1,070	205.950	220,366.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,682	80.490	537,834.180	
EMERSON ELECTRIC CO	7,670	132.600	1,017,042.000	
AON PLC-CLASS A	2,641	391.540	1,034,057.140	
AMGEN INC	7,204	282.870	2,037,795.480	
SAMSARA INC CLASS A	2,800	53.490	149,772.000	
EATON CORP PLC	5,436	375.420	2,040,783.120	
COOPER INC	2,692	104.460	281,206.320	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,151	240.950	518,283.450	

APPLIED MATERIALS INC	11,098	174.710	1,938,931.580	
CME GROUP INC	4,837	238.000	1,151,206.000	
ECOLAB INC	3,424	248.770	851,788.480	
EQUIFAX INC	1,676	261.560	438,374.560	
GILEAD SCIENCES INC	16,693	92.580	1,545,437.940	
KEURIG DR PEPPER INC	14,546	32.650	474,926.900	
HORMEL FOODS CORP	4,080	32.430	132,314.400	
STATE STREET CORP	3,952	98.510	389,311.520	
SOLVENTUM CORP	1,977	71.510	141,375.270	
GE VERNOVA	3,703	334.120	1,237,246.360	
SCHWAB (CHARLES) CORP	21,396	82.760	1,770,732.960	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	9,200	102.270	940,884.000	
LABCORP HOLDINGS	1,071	241.160	258,282.360	
BAXTER INTERNATIONAL INC	7,128	33.710	240,284.880	
SMURFIT WESTROCK PLC	7,240	55.020	398,344.800	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	2,671	215.930	576,749.030	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,400	276.320	663,168.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	2,616	46.200	120,859.200	
CROWN HOLDINGS INC	1,592	92.090	146,607.280	
TE CONNECTIVITY LTD	4,111	151.120	621,254.320	
BLACKROCK INC	1,952	1,022.800	1,996,505.600	
CARDINAL HEALTH INC	3,273	122.240	400,091.520	
FEDEX CORP	3,102	302.670	938,882.340	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,114	192.010	981,939.140	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,494	91.360	319,211.840	
INTEL CORP	57,041	24.050	1,371,836.050	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,922	30.810	151,646.820	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,028	123.310	496,692.680	
ILLINOIS TOOL WORKS	4,043	277.520	1,122,013.360	
ILLUMINA INC	2,093	144.150	301,705.950	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,776	542.000	2,588,592.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,339	182.000	243,698.000	
SNAP-ON INC	723	369.690	267,285.870	
CARMAX INC	2,249	83.970	188,848.530	
DUKE ENERGY CORP	10,307	117.050	1,206,434.350	
TARGET CORP	6,169	132.310	816,220.390	
DOVER CORP	1,784	205.900	367,325.600	
WW GRAINGER INC	566	1,205.340	682,222.440	
JABIL INC	1,500	135.830	203,745.000	

CINTAS CORP	4,896	225.790	1,105,467.840	
CONAGRA BRANDS INC	6,499	27.550	179,047.450	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,000	77.240	154,480.000	
CLOROX COMPANY	1,727	167.170	288,702.590	
ENTERGY CORP	2,923	156.170	456,484.910	
MICROSOFT CORP	94,566	423.460	40,044,918.360	
INCYTE CORP	2,169	74.590	161,785.710	
CVS HEALTH CORP	16,764	59.850	1,003,325.400	
MEDTRONIC PLC	17,189	86.540	1,487,536.060	
MICRON TECHNOLOGY INC	14,926	97.950	1,462,001.700	
CENTERPOINT ENERGY INC	8,872	32.620	289,404.640	
KELLOGG CO	3,742	81.290	304,187.180	
KEYCORP	12,665	19.480	246,714.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	18,005	64.950	1,169,424.750	
CHUBB LTD	5,158	288.730	1,489,269.340	
ALLSTATE CORP	3,464	207.390	718,398.960	
EBAY INC	6,702	63.290	424,169.580	
PAYPAL HOLDINGS INC	13,310	86.770	1,154,908.700	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,592	104.720	166,714.240	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,231	72.120	233,019.720	
TRIMBLE INC	3,299	72.970	240,728.030	
LENNAR CORP-A	3,158	174.390	550,723.620	
PROGRESSIVE CORP	7,796	268.880	2,096,188.480	
PACCAR INC	7,017	117.000	820,989.000	
BIOGEN INC	1,919	160.630	308,248.970	
IDEXX LABORATORIES INC	1,058	421.750	446,211.500	
STARBUCKS CORP	15,162	102.460	1,553,498.520	
PTC INC	1,584	200.060	316,895.040	
EVERSOURCE ENERGY	4,918	64.490	317,161.820	
INTUIT INC	3,720	641.730	2,387,235.600	
BEST BUY CO INC	2,816	90.000	253,440.000	
BALL CORP	4,350	62.160	270,396.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	19,674	90.660	1,783,644.840	
ELECTRONIC ARTS INC	3,380	163.670	553,204.600	
VULCAN MATERIALS CO	1,756	288.130	505,956.280	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,484	468.130	1,630,964.920	
CARNIVAL CORP	13,974	25.430	355,358.820	
COMCAST CORP-CLASS A	52,435	43.190	2,264,667.650	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,300	43.660	100,418.000	

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	16,900	4.550	76,895.000	
アメリカ・ドル 小計				699,901,494.790 (105,139,202,547)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	84,364	25.315	2,135,674.660	
	HALEON PLC	103,882	3.743	388,830.320	
	WISE PLC CLASS A	9,413	8.820	83,022.660	
	BP PLC	221,301	3.846	851,234.290	
	UNILEVER PLC	33,402	47.010	1,570,228.020	
	BARCLAYS PLC	197,886	2.638	522,023.260	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	113,989	5.586	636,742.550	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	28,299	3.827	108,300.270	
	PRUDENTIAL PLC	36,715	6.418	235,636.870	
	NATWEST GROUP PLC	91,219	4.027	367,338.910	
	BAE SYSTEMS PLC	40,615	12.270	498,346.050	
	AVIVA PLC	36,817	4.837	178,083.820	
	GSK	55,495	13.350	740,858.250	
	INFORMA PLC	17,893	8.566	153,271.430	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	18,157	5.744	104,293.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	12,347	8.390	103,591.330	
	DCC PLC	1,276	57.250	73,051.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	948	71.700	67,971.600	
	HALMA PLC	5,319	27.080	144,038.520	
	ENTAIN PLC	8,273	8.056	66,647.280	
	JD SPORTS FASHION PLC	33,388	1.018	33,988.980	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	9,871	5.140	50,736.940	
	M&G PLC	31,263	1.982	61,963.260	
	ENDEAVOUR MINING PLC	2,357	15.440	36,392.080	
	RELX PLC	24,998	37.050	926,175.900	
	DIAGEO PLC	29,764	23.525	700,198.100	
	RIO TINTO PLC	15,093	49.365	745,065.940	
	STANDARD CHARTERED PLC	29,088	9.724	282,851.710	
	TESCO PLC	92,707	3.664	339,678.440	
	SMITH & NEPHEW PLC	12,249	9.970	122,122.530	
GLENCORE PLC	139,001	3.799	528,134.290		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,676	10.935	51,132.060		
SMITHS GROUP PLC	4,766	17.710	84,405.860		
PEARSON PLC	8,299	12.330	102,326.670		
SAINSBURY (J) PLC	22,135	2.612	57,816.620		

NEXT PLC	1,589	100.800	160,171.200	
TAYLOR WIMPEY PLC	45,676	1.310	59,835.560	
WHITBREAD PLC	2,465	28.500	70,252.500	
BUNZL PLC	4,444	35.580	158,117.520	
VODAFONE GROUP PLC	302,245	0.708	214,231.250	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,704	34.500	58,788.000	
KINGFISHER PLC	24,703	2.475	61,139.920	
WPP PLC	14,867	8.592	127,737.260	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,399	11.195	105,221.800	
SEVERN TRENT PLC	3,476	26.970	93,747.720	
RENTOKIL INITIAL PLC	33,227	3.938	130,847.920	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,356	48.600	454,701.600	
SCHRODERS PLC	10,596	3.152	33,398.590	
SSE PLC	14,994	17.715	265,618.710	
BARRATT REDROW PLC	19,293	4.277	82,516.160	
ASTRAZENECA PLC	20,755	106.120	2,202,520.600	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,272	2.213	184,280.930	
3I GROUP PLC	13,347	37.090	495,040.230	
ASHTED GROUP PLC	5,996	62.900	377,148.400	
SAGE GROUP PLC/THE	13,201	13.120	173,197.120	
NATIONAL GRID PLC	64,421	9.926	639,442.840	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	854,810	0.530	453,562.180	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,869	25.690	279,224.610	
CENTRICA PLC	72,294	1.274	92,102.550	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,340	41.480	55,583.200	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,739	29.880	798,961.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,460	21.980	98,030.800	
HSBC HOLDINGS PLC	247,923	7.327	1,816,531.820	
ANGLO AMERICAN PLC	17,424	25.205	439,171.920	
MONDI PLC	5,778	11.905	68,787.090	
COMPASS GROUP PLC	22,795	26.910	613,413.450	
PERSIMMON PLC	3,969	12.580	49,930.020	
BT GROUP PLC	85,328	1.593	135,927.500	
COCA-COLA HBC AG-DI	3,014	28.040	84,512.560	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,149	98.000	210,602.000	
INTERTEK GROUP PLC	2,128	47.160	100,356.480	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,407	112.700	722,068.900	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	19.240	39,230.360	

	ADMIRAL GROUP PLC	3,372	25.630	86,424.360	
	ANTOFAGASTA PLC	5,200	17.025	88,530.000	
	EXPERIAN PLC	12,317	37.510	462,010.670	
イギリス・ポンド 小計				25,995,091.890 (4,957,264,025)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	17,851	24.400	435,564.400	
	AZRIELI GROUP LTD	530	293.100	155,343.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	16.530	137,099.820	
	ELBIT SYSTEMS LTD	385	903.900	348,001.500	
	BANK HAPOALIM BM	18,333	42.920	786,852.360	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	21,975	42.400	931,740.000	
	NICE LTD	907	667.000	604,969.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,264	159.800	361,787.200	
イスラエル・シュケル 小計				3,761,357.280 (155,656,624)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	29,120	5.180	150,841.600	
	TELSTRA GROUP LTD	52,164	3.940	205,526.160	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	40,428	31.170	1,260,140.760	
	SGH LTD	2,833	49.510	140,261.830	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	36,006	3.820	137,542.920	
	BHP GROUP LTD	68,075	40.570	2,761,802.750	
	SOUTH32 LTD	62,620	3.720	232,946.400	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	26,132	24.510	640,495.320	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,683	18.990	449,740.170	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	41,518	39.100	1,623,353.800	
	WESTPAC BANKING CORP	46,478	33.360	1,550,506.080	
	SANTOS LTD	43,240	6.610	285,816.400	
	RIO TINTO LTD	4,982	118.240	589,071.680	
	ORIGIN ENERGY LTD	22,247	10.870	241,824.890	
	XERO LTD	2,035	173.850	353,784.750	
	PRO MEDICUS LTD	709	251.890	178,590.010	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	34.800	95,630.400	
	COLES GROUP LTD	17,834	18.590	331,534.060	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,225	128.100	285,022.500	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	15,888	17.510	278,198.880	
REECE LTD	3,155	25.740	81,209.700		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	18,789	4.370	82,107.930		
SEEK LTD	4,813	26.120	125,715.560		

	TREASURY WINE ESTATES LTD	10,617	11.330	120,290.610	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22,464	158.580	3,562,341.120	
	ORICA LTD	5,978	18.110	108,261.580	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	20,020	20.000	400,400.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,393	30.180	494,740.740	
	QANTAS AIRWAYS LTD	11,139	8.770	97,689.030	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	5,798	56.210	325,905.580	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,876	231.110	1,126,892.360	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,598	67.750	514,764.500	
	CSL LTD	6,487	282.220	1,830,761.140	
	WESFARMERS LTD	15,246	71.830	1,095,120.180	
	COCHLEAR LTD	905	304.240	275,337.200	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,110	22.130	135,214.300	
	SUNCORP GROUP LTD	17,584	19.700	346,404.800	
	ASX LTD	2,592	66.060	171,227.520	
	COMPUTERSHARE LTD	7,033	31.890	224,282.370	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	31,872	8.530	271,868.160	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,915	28.570	168,991.550	
	BRAMBLES LTD	19,213	19.030	365,623.390	
	CARSALES.COM LTD	4,761	41.500	197,581.500	
	MINERAL RESOURCES LTD	2,298	33.630	77,281.740	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,610	39.590	103,329.900	
	REA GROUP LTD	733	251.530	184,371.490	
	オーストラリア・ドル 小計			24,280,345.310 (2,369,033,291)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,513	81.910	779,209.830	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	4,376	80.310	351,436.560	
	IMPERIAL OIL LTD	2,395	103.690	248,337.550	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	261	4,734.160	1,235,615.760	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,704	97.510	361,177.040	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,569	87.120	485,171.280	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,231	266.670	594,940.770	
	BCE INC	668	37.900	25,317.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,356	171.440	403,912.640	
	SUNCOR ENERGY INC	15,887	55.710	885,064.770	
	METRO INC/CN	2,750	91.230	250,882.500	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,189	138.710	581,056.190	



BANK OF NOVA SCOTIA	15,403	79.850	1,229,929.550	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,780	90.880	1,070,566.400	
TORONTO-DOMINION BANK	21,837	79.230	1,730,145.510	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,735	50.410	188,281.350	
MEG ENERGY CORP	3,100	25.200	78,120.000	
ROYAL BANK OF CANADA	17,590	176.160	3,098,654.400	
TOURMALINE OIL CORP	4,356	66.080	287,844.480	
TC ENERGY CORP	12,954	68.260	884,240.040	
PEMBINA PIPELINE CORP	7,294	57.680	420,717.920	
BARRICK GOLD CORP	21,852	24.520	535,811.040	
CAE INC	3,752	32.910	123,478.320	
THOMSON REUTERS CORP	1,997	228.440	456,194.680	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	41.980	75,564.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	137.520	86,775.120	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,860	77.610	144,354.600	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	5,400	29.700	160,380.000	
HYDRO ONE LTD	4,066	45.790	186,182.140	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	181.700	338,143.700	
STANTEC INC	1,400	121.270	169,778.000	
WSP GLOBAL INC	1,557	248.970	387,646.290	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	115.000	112,010.000	
PARKLAND CORP	1,621	36.150	58,599.150	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	33.060	64,433.940	
EMERA INC	3,524	53.420	188,252.080	
TFI INTERNATIONAL INC	1,024	213.170	218,286.080	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,593	35.940	57,252.420	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,543	50.000	227,150.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	8,902	18.850	167,802.700	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,183	118.060	729,964.980	
AIR CANADA	1,700	24.960	42,432.000	
KINROSS GOLD CORP	16,257	13.710	222,883.470	
BANK OF MONTREAL	9,135	133.500	1,219,522.500	
POWER CORP OF CANADA	7,072	47.160	333,515.520	
SHOPIFY INC - CLASS A	15,061	161.840	2,437,472.240	
NUTRIEN LTD	6,174	65.400	403,779.600	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	44.620	68,357.840	
CAMECO CORP	5,502	83.850	461,342.700	
FIRSTSERVICE CORP	522	273.120	142,568.640	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,882	66.410	191,393.620	

	TELUS CORP	600	21.800	13,080.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,674	65.370	370,909.380	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	154.370	96,172.510	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,618	47.520	1,264,887.360	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	294	1,986.300	583,972.200	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	3,647	63.630	232,058.610	
	WESTON (GEORGE) LTD	700	225.050	157,535.000	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	4,423	31.060	137,378.380	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	165.100	165,100.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	7,220	86.170	622,147.400	
	ENBRIDGE INC	27,208	60.570	1,647,988.560	
	BROOKFIELD CORP	17,042	86.040	1,466,293.680	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	22,267	45.070	1,003,573.690	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	11,626	107.110	1,245,260.860	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,209	133.830	161,800.470	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,864	69.600	129,734.400	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,699	156.340	1,047,321.660	
	CGI INC - CLASS A	2,606	158.480	412,998.880	
	ONEX CORPORATION	804	113.890	91,567.560	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	47.310	62,354.580	
	TMX GROUP LTD	3,490	44.270	154,502.300	
	OPEN TEXT CORP	3,610	42.640	153,930.400	
	SAPUTO INC	2,900	26.100	75,690.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,981	19.130	171,806.530	
	FORTIS INC	6,138	62.590	384,177.420	
	RB GLOBAL INC	2,396	138.340	331,462.640	
	LUNDIN MINING CORP	8,400	13.740	115,416.000	
	CENOVUS ENERGY INC	17,331	22.180	384,401.580	
	DOLLARAMA INC	3,534	145.840	515,398.560	
	ALTAGAS LTD	3,901	34.240	133,570.240	
	KEYERA CORP	2,970	46.170	137,124.900	
	ARC RESOURCES LTD	7,934	25.810	204,776.540	
	カナダ・ドル 小計			38,876,341.400 (4,161,712,347)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	35,400	2.730	96,642.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	19,400	36.360	705,384.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	26,610	42.430	1,129,062.300	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	22,850	6.310	144,183.500	

	KEPPEL CORP LTD	21,000	6.730	141,330.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	35,600	2.410	85,796.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,000	16.280	732,600.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,200	0.765	62,118.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	110,600	3.100	342,860.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	21,000	4.500	94,500.000	
	SEBICORP INDUSTRIES LTD	11,400	5.220	59,508.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	12.720	150,096.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	3.080	85,624.000	
	シンガポール・ドル 小計			3,829,703.800 (428,505,558)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	5,759	40.140	231,166.260	
	GALDERMA GROUP N AG	849	90.250	76,622.250	
	AVOLTA AG	1,251	32.560	40,732.560	
	UBS GROUP AG-REG	44,536	28.480	1,268,385.280	
	ROCHE HOLDING AG-BR	442	270.800	119,693.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	626.500	55,758.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	2,049	23.500	48,151.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,513	255.500	2,430,571.500	
	SIKA AG-REG	2,100	228.100	479,010.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	100,000.000	100,000.000	
	ABB LTD-REG	21,415	50.280	1,076,746.200	
	SWISS RE AG	4,155	130.150	540,773.250	
	NESTLE SA-REG	35,477	76.480	2,713,280.960	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	313	1,280.000	400,640.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	537	254.400	136,612.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,719	58.300	158,517.700	
	SGS SA-REG	2,123	87.480	185,720.040	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	288	249.500	71,856.000	
	TEMENOS AG - REG	793	57.850	45,875.050	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	471	154.400	72,722.400	
	VAT GROUP AG	357	351.400	125,449.800	
	BKW AG	250	151.400	37,850.000	
	ALCON INC	6,884	78.380	539,567.920	
	SIG GROUP N AG	4,054	17.420	70,620.680	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	159.950	60,301.150	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,982	558.600	1,107,145.200	
	BALOISE HOLDING AG - REG	550	167.400	92,070.000	
	CLARIANT AG-REG	2,552	10.610	27,076.720	

	NOVARTIS AG-REG	26,688	93.270	2,489,189.760	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	1,344.000	67,200.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	68.100	26,559.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7,279	122.700	893,133.300	
	SWISSCOM AG-REG	364	508.500	185,094.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	87.450	31,219.650	
	GEBERIT AG-REG	470	530.400	249,288.000	
	GIVAUDAN-REG	127	3,881.000	492,887.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,569	114.650	179,885.850	
	SONOVA HOLDING AG-REG	713	300.800	214,470.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,060	71.500	147,290.000	
	LONZA GROUP AG-REG	978	526.400	514,819.200	
	HOLCIM LTD	7,180	89.740	644,333.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	389	721.800	280,780.200	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	639	210.600	134,573.400	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,070	97.350	104,164.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	10,180.000	142,520.000	
	スイス・フラン 小計			19,110,324.780 (3,250,475,141)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	3,211	241.600	775,777.600	
	ERICSSON LM-B SHS	39,575	88.680	3,509,511.000	
	VOLVO AB-B SHS	21,101	271.600	5,731,031.600	
	SKF AB-B SHARES	4,980	209.500	1,043,310.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	114.450	804,125.700	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	170.450	489,021.050	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	22,354	151.500	3,386,631.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	21,311	113.500	2,418,798.500	
	SWEDBANK AB - A SHARES	12,210	213.800	2,610,498.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,285	151.250	1,253,106.250	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	8,820	141.700	1,249,794.000	
	SKANSKA AB-B SHS	5,222	227.500	1,188,005.000	
	SANDVIK AB	14,864	201.700	2,998,068.800	
	INVESTOR AB-B SHS	22,358	299.250	6,690,631.500	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,145	174.150	6,120,501.750	
	VOLVO AB-A SHS	2,688	273.000	733,824.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	410.800	457,631.200	
	SECURITAS AB-B SHS	6,601	137.950	910,607.950	
	TELIA CO AB	34,471	31.950	1,101,348.450	

	ALFA LAVAL AB	4,440	464.300	2,061,492.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,955	154.100	3,383,265.500	
	ASSA ABLOY AB-B	13,882	334.900	4,649,081.800	
	TRELLEBORG AB-B SHS	3,113	360.600	1,122,547.800	
	SAAB AB-B	4,300	238.850	1,027,055.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,710	358.200	612,522.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,750	83.920	734,300.000	
	INDUTRADE AB	4,193	278.400	1,167,331.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	2,616	302.400	791,078.400	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	529.000	501,492.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	277.000	567,296.000	
	LIFCO AB-B SHS	3,406	331.000	1,127,386.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	22,143	46.220	1,023,449.460	
	BEIJER REF AB	5,166	172.000	888,552.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,762	300.200	2,630,352.400	
	BOLIDEN AB	3,947	325.400	1,284,353.800	
	EPIROC AB-A	9,510	198.750	1,890,112.500	
	EPIROC AB-B	5,234	179.900	941,596.600	
	EQT AB	5,390	330.500	1,781,395.000	
	EVOLUTION AB	2,631	952.000	2,504,712.000	
	HEXAGON AB-B SHS	30,801	92.940	2,862,644.940	
	ADDTECH AB-B SHARES	3,560	300.000	1,068,000.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,020	357.500	722,150.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			78,814,389.750 (1,082,909,715)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	44,069	757.300	33,373,453.700	
	DANSKE BANK A/S	9,586	202.700	1,943,082.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	11,570.000	451,230.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,099	109.700	1,546,660.300	
	CARLSBERG AS-B	1,379	726.800	1,002,257.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,908	413.700	2,030,439.600	
	COLOPLAST-B	1,843	889.400	1,639,164.200	
	DSV PANALPINA A/S	2,651	1,507.000	3,995,057.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	134	2,574.000	344,916.000	
	DEMANT A/S	1,352	269.200	363,958.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	70	11,975.000	838,250.000	
	TRYG A/S	5,039	162.600	819,341.400	
	PANDORA A/S	1,183	1,136.500	1,344,479.500	

	GENMAB A/S	904	1,526.000	1,379,504.000	
	ZEALAND PHARMA A/S	875	730.000	638,750.000	
	ORSTED A/S	2,730	391.800	1,069,614.000	
デンマーク・クローネ 小計				52,780,157.500 (1,119,467,140)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	18,677	6.210	115,984.170	
	MERCURY NZ LTD	8,896	6.620	58,891.520	
	INFRATIL LTD	12,669	12.850	162,796.650	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,831	7.760	177,168.560	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	8,427	38.050	320,647.350	
ニュージーランド・ドル 小計				835,488.250 (74,032,613)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	12,879	230.700	2,971,185.300	
	NORSK HYDRO ASA	20,547	68.300	1,403,360.100	
	ORKLA ASA	9,408	101.900	958,675.200	
	TELENOR ASA	9,088	130.000	1,181,440.000	
	EQUINOR ASA	12,049	267.200	3,219,492.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,541	310.600	789,234.600	
	MOWI ASA	7,143	200.400	1,431,457.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,886	196.400	566,810.400	
	AKER BP ASA	4,241	226.400	960,162.400	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,350	1,299.000	1,753,650.000	
	SALMAR ASA	1,013	574.000	581,462.000	
ノルウェー・クローネ 小計				15,816,930.000 (214,477,572)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	10,651	22.810	242,949.310	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,373	35.800	228,153.400	
	EXOR NV	1,333	93.650	124,835.450	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,527	59.080	90,215.160	
	DSM FIRMENICH AG	2,406	103.950	250,103.700	
	FERROVIAL	6,751	39.020	263,424.020	
	LOTUS BAKERIES NV	5	11,380.000	56,900.000	
	SYENSQO SA	902	70.260	63,374.520	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,933	23.170	67,957.610	
	BAYER AG-REG	13,056	19.388	253,129.720	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,091	17.365	53,675.210	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	25,177	16.074	404,695.090	

COMMERZBANK AG	13,553	14.525	196,857.320	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,796	80.720	225,693.120	
SIEMENS AG-REG	9,839	183.160	1,802,111.240	
E.ON SE	29,834	12.185	363,527.290	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,238	70.020	296,744.760	
GEA GROUP AG	1,908	47.320	90,286.560	
CONTINENTAL AG	1,511	62.040	93,742.440	
BASF SE	11,574	42.420	490,969.080	
ALLIANZ SE-REG	5,071	292.200	1,481,746.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,171	80.760	175,329.960	
RHEINMETALL AG	564	622.400	351,033.600	
RWE AG	8,574	31.870	273,253.380	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	6.336	41,899.960	
BRENNTAG SE	1,739	61.000	106,079.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,637	33.270	187,542.990	
SAP SE	13,519	224.900	3,040,423.100	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,732	494.300	856,127.600	
ZALANDO SE	3,091	29.420	90,937.220	
HEIDELBERG MATERIALS AG	1,826	119.400	218,024.400	
COVESTRO AG	2,578	57.720	148,802.160	
RATIONAL AG	58	885.000	51,330.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	770	83.550	64,333.500	
SARTORIUS AG-VORZUG	359	217.800	78,190.200	
TALANX AG	804	80.200	64,480.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,057	34.620	71,213.340	
DELIVERY HERO SE	2,550	38.740	98,787.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	56.550	31,668.000	
BECHTLE AG	819	31.100	25,470.900	
NEMETSCHEK SE	794	98.200	77,970.800	
SCOUT24 AG	877	85.050	74,588.850	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,625	51.320	186,035.000	
KNORR-BREMSE AG	926	72.150	66,810.900	
SIEMENS ENERGY AG	8,548	51.020	436,118.960	
BEIERSDORF AG	1,293	122.650	158,586.450	
MERCK KGAA	1,672	141.600	236,755.200	
ADIDAS AG	2,153	223.100	480,334.300	
PUMA SE	1,295	44.300	57,368.500	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	71.850	94,195.350	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	45,190	30.280	1,368,353.200	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,759	41.600	114,774.400	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,680	52.960	512,652.800	
QIAGEN N.V.	3,031	41.385	125,437.930	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,935	30.815	521,852.020	
HANNOVER RUECK SE	775	247.100	191,502.500	
DHL GROUP	13,223	34.770	459,763.710	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,464	221.500	545,776.000	
MTU AERO ENGINES AG	692	322.200	222,962.400	
SYMRISE AG	1,707	104.500	178,381.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	64.500	47,278.500	
VONOVIA SE	9,848	31.400	309,227.200	
LEG IMMOBILIEN SE	1,022	87.740	89,670.280	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,339	25.790	266,642.810	
NN GROUP NV	3,687	43.970	162,117.390	
ARCELORMITTAL	6,026	23.840	143,659.840	
HEINEKEN NV	3,727	70.060	261,113.620	
AEGON LTD	18,115	6.102	110,537.730	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	12,123	32.650	395,815.950	
AKZO NOBEL N.V.	2,289	55.300	126,581.700	
WOLTERS KLUWER	3,223	157.950	509,072.850	
ING GROEP NV	42,838	14.658	627,919.400	
KONINKLIJKE KPN NV	50,600	3.671	185,752.600	
ASML HOLDING NV	5,173	658.400	3,405,903.200	
ABN AMRO BANK NV-CVA	5,593	14.715	82,300.990	
IMCD NV	715	142.100	101,601.500	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	1,034	113.000	116,842.000	
ASR NEDERLAND NV	2,047	45.300	92,729.100	
ADYEN NV	289	1,378.400	398,357.600	
PROSUS NV	18,384	38.550	708,703.200	
JDE PEET'S NV	1,476	18.870	27,852.120	
INPOST SA	2,468	16.580	40,919.440	
ASM INTERNATIONAL NV	624	511.400	319,113.600	
RANDSTAD NV	1,226	41.610	51,013.860	
HEINEKEN HOLDING NV	1,735	60.000	104,100.000	
TOTALENERGIES SE	27,938	54.970	1,535,751.860	
MICHELIN (CGDE)	8,788	30.750	270,231.000	
AIR LIQUIDE SA	7,485	157.280	1,177,240.800	
KERING	1,010	220.750	222,957.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,079	243.500	1,723,736.500	



BOUYGUES SA	2,238	28.160	63,022.080	
BNP PARIBAS	13,176	56.640	746,288.640	
THALES SA	1,216	141.500	172,064.000	
DANONE	8,372	64.660	541,333.520	
CARREFOUR SA	6,992	14.400	100,684.800	
VIVENDI	9,354	8.690	81,286.260	
L'OREAL	3,115	328.650	1,023,744.750	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,026	86.340	520,284.840	
LEGRAND SA	3,394	94.880	322,022.720	
PERNOD RICARD SA	2,623	105.900	277,775.700	
EURAZEO SE	603	69.550	41,938.650	
REXEL SA	3,113	24.440	76,081.720	
SOCIETE GENERALE SA	9,796	25.095	245,830.620	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,561	592.500	2,109,892.500	
ACCOR SA	2,614	43.680	114,179.520	
CAPGEMINI SE	2,065	151.900	313,673.500	
PUBLICIS GROUPE	2,962	102.700	304,197.400	
BUREAU VERITAS SA	4,257	28.800	122,601.600	
EIFFAGE	945	85.400	80,703.000	
SODEXO SA	1,085	78.600	85,281.000	
IPSEN	460	109.400	50,324.000	
AMUNDI SA	751	61.650	46,299.150	
TELEPERFORMANCE	749	89.020	66,675.980	
EURONEXT NV	1,079	105.700	114,050.300	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,852	46.790	86,655.080	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	369	180.350	66,549.150	
SEB SA	352	89.800	31,609.600	
ESSILORLUXOTTICA	3,854	229.800	885,649.200	
DASSAULT AVIATION SA	220	188.400	41,448.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,287	37.400	48,133.800	
AXA SA	23,527	32.980	775,920.460	
EDENRED	3,410	31.300	106,733.000	
RENAULT SA	2,373	40.530	96,177.690	
HERMES INTERNATIONAL	410	2,065.000	846,650.000	
STMICROELECTRONICS NV	9,177	24.270	222,725.790	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,659	32.650	282,716.350	
ORANGE	25,241	10.085	254,555.480	
ALSTOM	4,483	21.290	95,443.070	
SANOFI	14,756	92.090	1,358,880.040	

VINCI SA	6,487	99.860	647,791.820	
AIRBUS SE	7,693	147.560	1,135,179.080	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,926	27.570	246,089.820	
CREDIT AGRICOLE SA	13,601	12.670	172,324.670	
BIOMERIEUX	457	98.850	45,174.450	
ENGIE	24,274	15.085	366,173.290	
SAFRAN SA	4,425	220.500	975,712.500	
ARKEMA	650	75.000	48,750.000	
ADP	470	109.500	51,465.000	
GETLINK SE	4,114	15.465	63,623.010	
BOLLORE	8,529	5.835	49,766.710	
UCB SA	1,636	185.350	303,232.600	
KBC GROUP NV	2,961	68.240	202,058.640	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,067	65.450	69,835.150	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	11,653	50.940	593,603.820	
AGEAS	2,189	47.760	104,546.640	
D' IETEREN GROUP	296	201.800	59,732.800	
ELIA GROUP SA/NV	358	88.650	31,736.700	
SOFINA	210	219.600	46,116.000	
ARGENX SE	790	586.400	463,256.000	
PRYSMIAN SPA	3,601	62.420	224,774.420	
GENERALI	13,198	27.080	357,401.840	
MEDIOBANCA SPA	6,709	13.805	92,617.740	
TENARIS SA	5,705	18.160	103,602.800	
UNICREDIT SPA	19,070	36.385	693,861.950	
UNIPOL GRUPPO SPA	5,445	11.420	62,181.900	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.227	24,662.730	
INTESA SANPAOLO	189,673	3.627	687,943.970	
POSTE ITALIANE SPA	5,356	13.285	71,154.460	
MONCLER SPA	2,835	46.350	131,402.250	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	51.550	66,241.750	
ENI SPA	29,793	13.406	399,404.950	
BPER BANCA	13,730	5.778	79,331.940	
DAVIDE CAMPARI -MILANO NV	7,862	5.678	44,640.430	
BANCO BPM SPA	16,647	7.204	119,924.980	
DIASORIN SPA	277	105.800	29,306.600	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	4,568	9.750	44,538.000	
NEXI SPA	6,511	5.604	36,487.640	
AMPLIFON SPA	1,440	24.030	34,603.200	

LEONARDO SPA	5,420	25.470	138,047.400	
ENEL SPA	105,473	6.810	718,271.130	
SNAM SPA	27,553	4.412	121,563.830	
TERNA SPA	19,186	8.008	153,641.480	
FINECOBANK SPA	8,199	15.190	124,542.810	
STELLANTIS NV	28,315	12.536	354,956.840	
FERRARI NV	1,635	411.700	673,129.500	
TELEFONICA SA	50,801	4.286	217,733.080	
ENDESA SA	3,760	20.740	77,982.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	74,749	8.936	667,957.060	
IBERDROLA SA	79,074	13.490	1,066,708.260	
BANCO DE SABADELL SA	74,115	1.785	132,332.330	
REPSOL SA	15,621	11.825	184,718.320	
GRIFOLS SA	4,069	8.616	35,058.500	
BANCO SANTANDER SA	200,592	4.375	877,690.290	
AMADEUS IT GROUP SA	5,987	66.420	397,656.540	
CAIXABANK SA	48,218	5.146	248,129.820	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,619	43.960	115,131.240	
AENA SME SA	962	204.800	197,017.600	
CELLNEX TELECOM SA	7,086	33.980	240,782.280	
ACCIONA SA	291	120.300	35,007.300	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,146	52.180	738,138.280	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,966	16.900	83,925.400	
UPM-KYMMENE OYJ	6,845	24.900	170,440.500	
NOKIA OYJ	69,007	3.979	274,613.350	
WARTSILA OYJ ABP	6,460	17.205	111,144.300	
STORA ENSO OYJ-R SHS	7,978	9.192	73,333.770	
ELISA OYJ	1,749	42.880	74,997.120	
SAMPO OYJ-A SHS	6,489	40.540	263,064.060	
FORTUM OYJ	5,703	14.265	81,353.290	
KESKO OYJ-B SHS	3,470	18.815	65,288.050	
KONE OYJ-B	4,607	49.060	226,019.420	
NESTE OYJ	5,676	14.405	81,762.780	
ORION OYJ-CLASS B	1,315	44.720	58,806.800	
METSO CORPORATION	8,549	8.326	71,178.970	
NORDEA BANK ABP	41,930	10.705	448,860.650	
VERBUND AG	876	75.500	66,138.000	
OMV AG	1,727	37.920	65,487.840	
ERSTE GROUP BANK AG	4,565	51.900	236,923.500	

	AIB GROUP PLC	24,439	5.150	125,860.850	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	12,691	8.288	105,183.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,003	71.200	142,613.600	
	JERONIMO MARTINS	3,591	18.440	66,218.040	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,031	3.422	143,830.080	
	GALP ENERGIA SGPS SA	5,978	15.535	92,868.230	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,084	11.080	45,250.720	
	KERRY GROUP PLC-A	2,100	91.450	192,045.000	
ユーロ 小計				65,524,722.040 (10,369,942,510)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	20,000	51.000	1,020,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	34.550	1,105,600.000	
	MTR CORP	24,000	27.250	654,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	21,000	77.250	1,622,250.000	
	SINO LAND CO	54,000	7.620	411,480.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	38,552	40.500	1,561,356.000	
	WHARF HOLDINGS LTD	14,000	21.350	298,900.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	64.050	320,250.000	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	65.300	1,567,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	24.400	452,986.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	162,027	5.900	955,959.300	
	HANG SENG BANK LTD	11,000	92.450	1,016,950.000	
	WH GROUP LTD	112,000	6.170	691,040.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	15,800	289.800	4,578,840.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	28,052	31.800	892,053.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,500	53.600	455,600.000	
	AIA GROUP LTD	146,200	58.150	8,501,530.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	17,000	20.250	344,250.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	26,000	20.850	542,100.000	
	SANDS CHINA LTD	32,200	19.840	638,848.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	17,000	109.600	1,863,200.000		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	53,500	23.900	1,278,650.000		
香港・ドル 小計				30,773,042.900 (593,919,728)	
合計				133,916,598,811 [133,916,598,811]	

## (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	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE IN-28	261.000	0.000	
	カナダ・ドル	小計		0.000 (0)	
新株予約権証券 合計				0 [0]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,860	437,751.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,392	806,371.200	
		BXP INC	2,058	168,735.420	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,365	308,831.250	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,626	354,629.160	
		EQUINIX INC	1,286	1,262,183.280	
		AMERICAN TOWER CORP	6,257	1,307,713.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	9,487	174,750.540	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,367	167,212.430	
		KIMCO REALTY CORP	9,371	239,616.470	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,800	196,118.000	
		INVITATION HOMES INC	8,488	290,714.000	
		VICI PROPERTIES INC	13,988	456,148.680	
		VENTAS INC	5,394	345,593.580	
		WEYERHAEUSER CO	10,111	326,180.860	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,783	614,443.750	
		IRON MOUNTAIN INC	3,872	478,850.240	
		SUN COMMUNITIES INC	1,687	213,118.710	
		PROLOGIS INC	12,436	1,452,276.080	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,237	246,584.510	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,545	194,361.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	908	281,897.680	
		WELLTOWER INC	7,955	1,099,221.900	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,752	214,446.480	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,626	266,924.160	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,366	168,766.780	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7,013	139,769.090	
		REALTY INCOME CORP	11,686	676,502.540	
		PUBLIC STORAGE	2,101	731,253.050	
		REGENCY CENTERS CORP	2,261	170,908.990	
UDR INC	4,280	196,280.800			
WP CAREY INC	2,962	169,011.720			
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,323	845,967.870			
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,789	476,807.440			

アメリカ・ドル 小計			15,479,941.660 (2,325,396,836)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,796	59,069.880	
	SEGRO PLC	17,980	140,244.000	
イギリス・ポンド 小計			199,313.880 (38,009,157)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	41,496	531,148.800	
	APA GROUP	16,458	118,826.760	
	SCENTRE GROUP	71,825	264,316.000	
	GPT GROUP	26,601	126,620.760	
	MIRVAC GROUP	54,880	118,540.800	
	STOCKLAND	30,751	160,520.220	
	GOODMAN GROUP	22,964	870,565.240	
	VICINITY CENTRES	50,371	108,801.360	
オーストラリア・ドル 小計			2,299,339.940 (224,346,598)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	38,101.350	
カナダ・ドル 小計			38,101.350 (4,078,749)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	54,600	143,052.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	87,326	171,158.960	
シンガポール・ドル 小計			314,210.960 (35,157,065)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,592	123,475.520	
	GECINA SA	578	55,112.300	
	KLEPIERRE	2,896	82,883.520	
	COVIVIO	652	33,904.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,425	50,731.000	
ユーロ 小計			346,106.340 (54,774,789)	
香港・ドル	LINK REIT	39,200	1,326,920.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	51,000	493,170.000	
香港・ドル 小計			1,820,090.000 (35,127,737)	
投資証券 合計			2,716,890.931 [2,716,890,931]	

合計		2,716,890,931	
		[2,716,890,931]	

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 570銘柄 投資証券 34銘柄	97.8%	-%	2.2%	78.6%
イギリス・ポンド	株式 76銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	-%	0.8%	3.7%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 46銘柄 投資証券 8銘柄	91.3%	-%	8.7%	1.9%
カナダ・ドル	株式 83銘柄 新株予約権証券 1銘柄 投資証券 1銘柄	99.9%	0%	0.1%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄 株式 13銘柄	92.4%	-%	7.6%	0.3%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	-%	2.4%
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	100%	-%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式 16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 11銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 215銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	-%	0.5%	7.6%
香港・ドル	投資証券 2銘柄 株式 22銘柄	94.4%	-%	5.6%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。



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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	42,456,101	50,107,129
親投資信託受益証券	3,715,173,549	4,930,365,965
未収入金	2,570,000	2,160,000
流動資産合計	3,760,199,650	4,982,633,094
資産合計	3,760,199,650	4,982,633,094
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,462,414	3,640,091
未払受託者報酬	404,393	527,150
未払委託者報酬	5,965,509	7,776,040
その他未払費用	101,028	131,703
流動負債合計	14,933,344	12,074,984
負債合計	14,933,344	12,074,984
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,660,542,416	1,710,359,364
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,084,723,890	3,260,198,746
（分配準備積立金）	1,184,693,724	1,859,739,701
元本等合計	3,745,266,306	4,970,558,110
純資産合計	3,745,266,306	4,970,558,110
負債純資産合計	3,760,199,650	4,982,633,094

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		11		51,677
有価証券売買等損益		675,727,100		1,107,244,411
営業収益合計		675,727,111		1,107,296,088
<b>営業費用</b>				
支払利息		13,318		1,078
受託者報酬		779,863		977,152
委託者報酬		11,504,361		14,414,169
その他費用		194,816		244,118
営業費用合計		12,492,358		15,636,517
営業利益又は営業損失（ ）		663,234,753		1,091,659,571
経常利益又は経常損失（ ）		663,234,753		1,091,659,571
当期純利益又は当期純損失（ ）		663,234,753		1,091,659,571
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（ ）		69,608,190		140,494,192
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,620,834,491		2,084,723,890
剰余金増加額又は欠損金減少額		353,943,897		778,384,149
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		353,943,897		778,384,149
剰余金減少額又は欠損金増加額		483,681,061		554,074,672
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		483,681,061		554,074,672
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,084,723,890		3,260,198,746

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,850,387,371円	1,660,542,416円
期中追加設定元本額	360,555,164円	481,642,488円
期中一部解約元本額	550,400,119円	431,825,540円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,660,542,416口	1,710,359,364口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2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(593,632,296円)、投資信託約款に規定される収益調整金(900,041,771円)及び分配準備積立金(591,061,428円)より分配対象額は2,084,735,495円(1万口当たり12,554.55円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(47,734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(951,108,732円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,400,459,045円)及び分配準備積立金(908,583,235円)より分配対象額は3,260,198,746円(1万口当たり19,061.48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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	623,863,650	1,010,396,601
合計	623,863,650	1,010,396,601

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	2.2554円	2.9061円
(1万口当たり純資産額)	(22,554円)	(29,061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	342,507,970	924,257,757	
	外国株式インデックスマザーファンド	574,681,998	4,006,108,208	
親投資信託受益証券 合計			4,930,365,965	
合計			4,930,365,965	

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、「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。

「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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	724,231,642	1,383,110,789
コール・ローン	280,733,043	306,591,415
株式	25,130,037,259	34,039,613,574
投資証券	1,067,931,156	2,848,428,875
派生商品評価勘定	459	567,831
未収配当金	140,194,396	75,298,382
差入委託証拠金	354,753,097	748,063,455
流動資産合計	27,697,881,052	39,401,674,321
資産合計	27,697,881,052	39,401,674,321
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,341,769	47,908,954
未払解約金	12,605,300	18,970,400
流動負債合計	15,947,069	66,879,354
負債合計	15,947,069	66,879,354
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,217,829,426	14,576,528,010
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,464,104,557	24,758,266,957
元本等合計	27,681,933,983	39,334,794,967
純資産合計	27,681,933,983	39,334,794,967
負債純資産合計	27,697,881,052	39,401,674,321

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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)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、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

### 受取配当金

原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	11,961,794,690円	12,217,829,426円
期中追加設定元本額	2,503,217,486円	2,997,475,849円
期中一部解約元本額	2,247,182,750円	638,777,265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）	98,861,741円	124,843,350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	428,808,627円	471,171,394円
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	322,850,520円	342,507,970円
マージングプラス（為替ヘッジ		
なし）		
D - I ' s 新興国株式インデッ		
クス	126,835,314円	118,302,228円
i F r e e 新興国株式インデッ		
クス	5,780,689,748円	7,633,540,976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	3,412,330,797円	3,761,326,448円
（為替ヘッジなし）（投資一任		
専用）	7,843,093円	8,999,043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）	657,456円	653,912円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,561,945,956円	1,718,524,127円
ダイワ・インデックスセレクト新興国株式	359,773,424円	295,355,804円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	117,232,750円	101,302,758円
計	12,217,829,426円	14,576,528,010円
2. 期末日における受益権の総数	12,217,829,426口	14,576,528,010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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	428,486,248	197,533,581
投資証券	29,083,093	10,712,261
合計	457,569,341	208,245,842

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	1,342,168,173	-	1,339,991,536	2,176,637	2,177,007,768	-	2,129,789,115	47,218,653
合計	1,342,168,173	-	1,339,991,536	2,176,637	2,177,007,768	-	2,129,789,115	47,218,653

- (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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	1,182,816	-	1,182,357	459	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	1,182,816	-	1,182,357	459	-	-	-	-
買建	190,381,664	-	189,216,532	1,165,132	15,136,360	-	15,013,890	122,470
アメリカ・ドル	190,381,664	-	189,216,532	1,165,132	15,136,360	-	15,013,890	122,470
合計	191,564,480	-	190,398,889	1,164,673	15,136,360	-	15,013,890	122,470

- (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	2,2657円	2,6985円
(1万口当たり純資産額)	(22,657円)	(26,985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	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PEF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	24,500	13.810	338,345.000	
	CANADIAN SOLAR INC	8,900	12.410	110,449.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	15,000	11.410	171,150.000	
	PINDUODUO INC-ADR	2,900	96.560	280,024.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	19,400	18.850	365,690.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	73,275	2.450	179,523.750	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	10,500	20.030	210,315.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	8,800	22.190	195,272.000	
	BANK VTB	76,486	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	

	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	182,900	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	360 DIGITECH ADR INC	12,100	38.110	461,131.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	0.000	0.000	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000	
	SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000	
	INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000	
	ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	80,700	2.190	176,733.000	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000	
	アメリカ・ドル 小計			2,488,632.750 (373,842,411)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	5,260	1,215.800	6,395,108.000	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	68,451	328.350	22,475,885.850	
	UPL - RIGHTS	4,958	188.400	934,087.200	
	TATA STEEL LTD	614,642	144.540	88,840,354.680	
	AXIS BANK LTD	59,459	1,136.300	67,563,261.700	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,411	11,074.200	26,699,896.200	
	TATA POWER CO LTD	36,125	414.150	14,961,168.750	
	BANK OF BARODA	54,322	246.400	13,384,940.800	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	13,173	2,496.150	32,881,783.950	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	108,774	383.100	41,671,319.400	
	STATE BANK OF INDIA	73,687	838.950	61,819,708.650	
	NTPC LTD	206,799	363.650	75,202,456.350	
	POWER FINANCE CORPORATION	78,073	495.300	38,669,556.900	
	JSW STEEL LTD	32,179	966.000	31,084,914.000	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	155,411	329.400	51,192,383.400	
	INDIAN OIL CORP LTD	376,371	138.630	52,176,311.730	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	196,488	292.100	57,394,144.800	
	PUNJAB NATIONAL BANK	108,672	104.900	11,399,692.800	
	STEEL AUTHORITY OF INDIA	135,361	117.110	15,852,126.710	

JINDAL STEEL & POWER LTD	15,980	906.450	14,485,071.000	
CANARA BANK	108,890	102.010	11,107,868.900	
UNION BANK OF INDIA	85,577	121.620	10,407,874.740	
ULTRATECH CEMENT LTD	2,001	11,202.150	22,415,502.150	
PETRONET LNG LTD	47,678	333.100	15,881,541.800	
SHRIRAM FINANCE LTD	8,546	3,019.650	25,805,928.900	
TECH MAHINDRA LTD	21,154	1,712.300	36,221,994.200	
YES BANK LTD	601,287	19.960	12,001,688.520	
REC LTD	50,216	532.600	26,745,041.600	
COAL INDIA LTD	102,201	416.400	42,556,496.400	
BAJAJ FINANCE LTD	2,352	6,575.900	15,466,516.800	
SAMMAAN CAPITAL LTD	78,558	167.870	13,187,531.460	
GAIL INDIA LTD	140,939	199.460	28,111,692.940	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	104,696	656.200	68,701,515.200	
GRASIM INDUSTRIES LTD	14,648	2,606.250	38,176,350.000	
WIPRO LTD	28,824	577.850	16,655,948.400	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	20,598	4,270.850	87,970,968.300	
INFOSYS LTD	72,237	1,857.850	134,205,510.450	
LARSEN & TOUBRO LTD	14,598	3,724.800	54,374,630.400	
TATA MOTORS LTD	66,938	786.450	52,643,390.100	
DR. REDDY'S LABORATORIES	10,120	1,202.300	12,167,276.000	
HDFC BANK LIMITED	98,836	1,796.050	177,514,397.800	
ICICI BANK LTD	29,926	1,300.100	38,906,792.600	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	147,264	1,292.200	190,294,540.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	353,505	256.700	90,744,733.500	
ITC LTD	76,364	476.750	36,406,537.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	24,603	2,966.100	72,974,958.300	
HERO MOTOCORP LTD	3,643	4,761.700	17,346,873.100	
BHARTI AIRTEL LTD	37,737	1,627.150	61,403,759.550	
UPL LTD	39,665	545.000	21,617,425.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	11,876	1,780.900	21,149,968.400	
HCL TECHNOLOGIES LTD	25,512	1,848.050	47,147,451.600	
VEDANTA LTD	201,903	453.500	91,563,010.500	
インド・ルピー 小計			2,316,959,888.280 (4,124,188,602)	
インドネシア・ルピア				
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	31,666,600	71.000	2,248,328,600.000	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	886,300	5,100.000	4,520,130,000.000	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,539,600	2,710.000	4,172,316,000.000	



	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	731,000	4,980.000	3,640,380,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	995,800	10,000.000	9,958,000,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,374,100	6,150.000	8,450,715,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,062,800	4,250.000	8,766,900,000.000	
インドネシア・ルビア 小計				41,756,769,600.000 (396,689,311)	
オフショア・人 民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	281,200	2.340	658,008.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	218,800	18.050	3,949,340.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	216,300	5.720	1,237,236.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	110,353	53.250	5,876,297.250	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	714,700	6.150	4,395,405.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	23,800	21.750	517,650.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,400	1,525.740	2,136,036.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	53,300	25.660	1,367,678.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	117,100	10.240	1,199,104.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	455,300	9.460	4,307,138.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	35,000	30.750	1,076,250.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	141,300	36.340	5,134,842.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	184,100	11.380	2,095,058.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	814,100	5.980	4,868,318.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	29,900	28.330	847,067.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	94,200	17.580	1,656,036.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	35,600	23.350	831,260.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	5.620	246,718.000	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	200,400	5.560	1,114,224.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-A	44,000	12.460	548,240.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	161,160	13.590	2,190,164.400	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	201,300	3.340	672,342.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	97,200	7.520	730,944.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	34,300	21.050	722,015.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	26,650	14.600	389,090.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	46,600	7.980	371,868.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	848,000	4.810	4,078,880.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	313,400	5.010	1,570,134.000	
	PETROCHINA CO LTD-A	230,600	8.040	1,854,024.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	491,200	6.360	3,124,032.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	46,800	27.320	1,278,576.000		
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	465,300	7.330	3,410,649.000		

	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	40,600	39.960	1,622,376.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	215,200	8.600	1,850,720.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	59,600	33.900	2,020,440.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	142,000	6.790	964,180.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	697,000	3.960	2,760,120.000	
	PICC HOLDING CO-A	135,700	7.240	982,468.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	589,200	3.600	2,121,120.000	
	CRRC CORP LTD-A	160,100	7.930	1,269,593.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	260,900	5.150	1,343,635.000	
	CGN POWER CO LTD-A	65,500	3.910	256,105.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	30,500	17.970	548,085.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	62,800	11.410	716,548.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	367,100	6.410	2,353,111.000	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	155,300	8.200	1,273,460.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	168,200	6.620	1,113,484.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	29,700	47.360	1,406,592.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	215,000	7.570	1,627,550.000	
	BYD CO LTD -A	3,200	274.830	879,456.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	47,000	13.420	630,740.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	66,700	15.700	1,047,190.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	38,900	6.970	271,133.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	219,800	5.300	1,164,940.000	
	オフショア・人民元 小計			92,677,669.650 (1,917,760,482)	
サウジアラビ ア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	21,837	51.800	1,131,156.600	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	8,621	111.400	960,379.400	
	SAUDI AWWAL BANK	17,818	31.150	555,030.700	
	ARAB NATIONAL BANK	34,454	19.400	668,407.600	
	BANQUE SAUDI FRANSI	14,001	31.050	434,731.050	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	23,258	24.860	578,193.880	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	21,217	68.700	1,457,607.900	
	SAUDI TELECOM CO	63,186	39.800	2,514,802.800	
	AL RAJHI BANK	37,644	92.800	3,493,363.200	
	RIYAD BANK	36,377	26.250	954,896.250	
	ETIHAD ETISALAT CO	12,521	53.500	669,873.500	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	16,308	37.600	613,180.800	
	ALINMA BANK	24,331	27.750	675,185.250	

	THE SAUDI NATIONAL BANK	95,571	32.500	3,106,057.500	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	106,567	27.550	2,935,920.850	
サウジアラビア・リアル 小計				20,748,787.280 (830,988,931)	
タイ・パーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	184,800	114.500	21,159,600.000	
	TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	833,100	11.100	9,247,410.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,200	183.500	10,679,700.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	150.500	5,794,250.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	216,200	150.500	32,538,100.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,096,100	1.760	5,449,136.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	299,700	25.000	7,492,500.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	53,100	285.000	15,133,500.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	742,900	20.000	14,858,000.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,759,000	5.700	10,026,300.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	263,000	25.250	6,640,750.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	98,000	127.500	12,495,000.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	147,600	30.750	4,538,700.000	
	PTT PCL-NVDR	1,577,900	32.250	50,887,275.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	142,100	37.750	5,364,275.000	
	CP ALL PCL-NVDR	315,700	61.250	19,336,625.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	76,200	149.500	11,391,900.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	471,100	23.900	11,259,290.000		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	313,300	25.250	7,910,825.000		
タイ・パーツ 小計				262,203,136.000 (1,140,583,642)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,770,621	46.400	174,956,814.400	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	8,771	37,200.000	326,281,200.000	
	BANCO DE CHILE	1,564,088	111.150	173,848,381.200	
チリ・ペソ 小計				675,086,395.600 (104,152,329)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	319,164	60.850	19,421,129.400	
	TURKIYE IS BANKASI-C	760,930	13.630	10,371,475.900	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98,788	90.550	8,945,253.400	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	60,858	147.200	8,958,297.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	580,230	25.780	14,958,329.400	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	181,202	90.500	16,398,781.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI	364,490	29.640	10,803,483.600	
	KOC HOLDING AS	84,655	200.500	16,973,327.500	

	TURK HAVA YOLLARI AO	46,397	285.000	13,223,145.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	94,121	40.560	3,817,547.760	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,114	473.500	9,997,479.000	
トルコ・リラ 小計				133,868,249.560 (579,903,871)	
ブラジル・リアル	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	64,800	8.730	565,704.000	
	ENERGISA SA-UNITS	14,800	40.210	595,108.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	27,400	30.280	829,672.000	
	VIBRA ENERGIA SA	150,900	20.630	3,113,067.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	63,200	13.880	877,216.000	
	TIM SA	47,426	15.840	751,227.840	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	91,900	6.600	606,540.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	281,600	2.700	760,320.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	761,000	38.900	29,602,900.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	51,600	6.140	316,824.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	575,259	12.630	7,265,521.170	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	304,836	32.600	9,937,653.600	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	69,500	11.160	775,620.000	
	VALE SA	445,290	58.780	26,174,146.200	
	GERDAU SA-PREF	177,692	20.300	3,607,147.600	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	507,300	42.620	21,621,126.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	137,474	11.900	1,635,940.600	
	ITAUSA SA	138,409	9.750	1,349,487.750	
	BRASKEM SA-PREF A	48,400	15.000	726,000.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	16,500	39.010	643,665.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	168,200	24.770	4,166,314.000	
	COSAN SA	60,000	10.190	611,400.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	74,400	34.370	2,557,128.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	104,600	9.710	1,015,666.000	
	EMBRAER SA	33,900	58.130	1,970,607.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	147,400	11.460	1,689,204.000	
	CCR SA	75,500	11.030	832,765.000	
	BRF SA	81,500	24.810	2,022,015.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	13,000	92.980	1,208,740.000	
	LOJAS RENNEN S.A.	59,175	15.060	891,175.500	
JBS SA	143,600	37.320	5,359,152.000		
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	17,800	6.110	108,758.000		
SUZANO SA	37,545	62.400	2,342,808.000		

	LOCALIZA RENT A CAR	20,000	37.580	751,600.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	123,500	18.770	2,318,095.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	180,800	9.260	1,674,208.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	41,100	30.610	1,258,071.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	15,609	15.000	234,135.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	43,400	24.930	1,081,962.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	32,500	49.520	1,609,400.000	
	KLABIN SA - UNIT	50,290	22.210	1,116,940.900	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	73,400	17.940	1,316,796.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,900	28.520	1,166,468.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	190,321	11.130	2,118,272.730	
	AMBEV SA	215,700	12.730	2,745,861.000	
ブラジル・リアル 小計				153,922,428.890 (3,871,395,362)	
マレーシア・リンギット	MALAYAN BANKING BHD	142,800	10.200	1,456,560.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	254,800	4.470	1,138,956.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	796,900	1.170	932,373.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	309,400	8.250	2,552,550.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	65,700	13.660	897,462.000	
マレーシア・リンギット 小計				6,977,901.000 (235,609,525)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL L	1,443,700	15.210	21,958,677.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	18,915	161.060	3,046,449.900	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	281,600	7.950	2,238,720.000	
	CEMEX SAB-CPO	944,419	11.140	10,520,827.660	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	66,200	178.850	11,839,870.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	15,800	172.040	2,718,232.000	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	39,800	59.770	2,378,846.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	105,700	98.280	10,388,196.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	160,400	53.900	8,645,560.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	104,300	135.330	14,114,919.000	
メキシコ・ペソ 小計				87,850,297.560 (646,648,469)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	13,000	508.500	6,610,500.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	13,550	355.000	4,810,250.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	914,000	3.740	3,418,360.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	487,000	13.860	6,749,820.000	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	431,000	3.510	1,512,810.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	45,000	26.200	1,179,000.000	

JIANGXI COPPER CO LTD-H	224,000	12.480	2,795,520.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,403,800	4.160	18,319,808.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	146,500	398.000	58,307,000.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	184,000	17.780	3,271,520.000	
PETROCHINA CO LTD-H	2,112,000	5.510	11,637,120.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	426,000	4.050	1,725,300.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	191,500	20.300	3,887,450.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,600,000	5.850	44,460,000.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,430,000	4.960	7,092,800.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	104,200	13.400	1,396,280.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,200,000	4.410	5,292,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	223,000	32.200	7,180,600.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	379,120	5.070	1,922,138.400	
SINOPHARM GROUP CO-H	96,000	20.300	1,948,800.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	169,000	23.000	3,887,000.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	243,500	8.950	2,179,325.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	555,500	3.250	1,805,375.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	71,000	27.800	1,973,800.000	
BYD CO LTD-H	19,500	253.600	4,945,200.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,814,000	3.880	14,798,320.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	93,900	23.800	2,234,820.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	900,000	3.710	3,339,000.000	
CITIC LTD	211,000	8.630	1,820,930.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	360,500	11.340	4,088,070.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,397,000	4.560	47,410,320.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	104,500	15.000	1,567,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	245,000	5.650	1,384,250.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	2,110,000	1.020	2,152,200.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	696,600	27.750	19,330,650.000	
MEITUAN-CLASS B	103,790	168.700	17,509,373.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	918,900	83.650	76,865,985.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	708,000	0.980	693,840.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	246,000	4.880	1,200,480.000	
JD.COM INC - CL A	207,895	143.800	29,895,301.000	
NETEASE INC	35,900	134.400	4,824,960.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	22,700	46.400	1,053,280.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	706,000	1.640	1,157,840.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	114,600	26.450	3,031,170.000	

KUAI SHOU TECHNOLOGY	43,300	48.200	2,087,060.000	
BAIDU INC-CLASS A	120,550	81.300	9,800,715.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	290,000	13.340	3,868,600.000	
CRRC CORP LTD - H	337,000	4.550	1,533,350.000	
CGN POWER CO LTD-H	586,000	2.580	1,511,880.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	936,000	44.800	41,932,800.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	164,000	9.230	1,513,720.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	523,050	10.880	5,690,784.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,607,080	3.030	4,869,452.400	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,784,000	0.485	1,350,240.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	27,800	76.900	2,137,820.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	674,400	6.420	4,329,648.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	26,300	59.500	1,564,850.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	183,000	16.980	3,107,340.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	480,000	11.780	5,654,400.000	
LI NING CO LTD	90,000	15.960	1,436,400.000	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	140,000	10.720	1,500,800.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	556,000	2.960	1,645,760.000	
SUNNY OPTICAL TECH	31,500	62.950	1,982,925.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	372,000	4.620	1,718,640.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	275,200	24.450	6,728,640.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	96,500	13.000	1,254,500.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	415,000	14.720	6,108,800.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	54,500	52.250	2,847,625.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	154,000	7.340	1,130,360.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	190,000	14.940	2,838,600.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,155,100	5.620	6,491,662.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	430,000	4.270	1,836,100.000	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,598,000	1.450	2,317,100.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	344,000	35.250	12,126,000.000	
BANK OF CHINA LTD-H	9,111,000	3.610	32,890,710.000	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	117,500	22.050	2,590,875.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	694,000	2.700	1,873,800.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	308,000	6.920	2,131,360.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	296,000	10.920	3,232,320.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	340,000	3.440	1,169,600.000	
香港・ドル 小計			629,471,301.800 (12,148,796,124)	

台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	196,000	16.950	3,322,200.000	
	WT MICROELECTRONICS LTD	34,000	110.000	3,740,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	37,000	171.000	6,327,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	14,000	410.000	5,740,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	31,000	153.500	4,758,500.000	
	TAIWAN CEMENT	284,247	33.500	9,522,274.500	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	248,000	151.500	37,572,000.000	
	WIWYNN CORP	2,000	1,935.000	3,870,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,112	84.500	10,064,964.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	97,600	41.350	4,035,760.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	82,140	38.700	3,178,818.000	
	WALSIN LIHWA CORP	179,000	26.100	4,671,900.000	
	CHINA STEEL CORP	432,686	21.200	9,172,943.200	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	100,000	50.600	5,060,000.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	103,616	104.000	10,776,064.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	72,000	381.000	27,432,000.000	
	YAGEO CORPORATION	26,578	514.000	13,661,092.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	213,287	16.050	3,423,256.350	
	QISDA CORP	118,000	36.950	4,360,100.000	
	ACER INC	194,000	37.850	7,342,900.000	
	INVENTEC CORP	205,000	49.000	10,045,000.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20,000	476.000	9,520,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	121,000	291.000	35,211,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	33,000	157.000	5,181,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	75,000	33.450	2,508,750.000	
	AUO CORP	760,600	15.600	11,865,360.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	127,400	123.000	15,670,200.000	
	MEDIATEK INC	62,003	1,255.000	77,813,765.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	30,000	196.500	5,895,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	227,800	217.000	49,432,600.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	459,000	73.200	33,598,800.000	
	CHINA AIRLINES LTD	202,000	24.900	5,029,800.000	
	WAN HAI LINES LTD	146,000	83.000	12,118,000.000	
EVA AIRWAYS CORP	163,000	41.550	6,772,650.000		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	202,735	88.000	17,840,680.000		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	255,838	65.700	16,808,556.600		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	540,000	17.200	9,288,000.000		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	243,429	27.000	6,572,583.000		



	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	267,399	33.250	8,891,016.750	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	254,718	39.750	10,125,040.500	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	246,884	23.250	5,740,053.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	685,028	37.400	25,620,047.200	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	181,781	27.200	4,944,443.200	
	LARGAN PRECISION CO LTD	5,000	2,435.000	12,175,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	26,000	484.000	12,584,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	42,000	149.000	6,258,000.000	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	24,000	189.000	4,536,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	49,000	113.000	5,537,000.000	
	WISTRON CORP	213,110	113.500	24,187,985.000	
	INNOLUX CORP	930,029	15.150	14,089,939.350	
	WPG HOLDINGS LTD	124,000	70.400	8,729,600.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	62,000	89.900	5,573,800.000	
	PEGATRON CORP	123,000	94.300	11,598,900.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	65,000	114.500	7,442,500.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	65,560	118.500	7,768,860.000	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	15,000	377.000	5,655,000.000	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	34,000	190.500	6,477,000.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	48,000	122.500	5,880,000.000	
	COMPAL ELECTRONICS	764,000	36.850	28,153,400.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	469,000	996.000	467,124,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	489,902	195.500	95,775,841.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	54,760	588.000	32,198,880.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	705,000	43.550	30,702,750.000	
	台湾・ドル 小計			1,356,972,572.650 (6,269,620,376)	
南アフリカ・ラ ンド	AngloGold Ashanti Plc	21,738	452.200	9,829,923.600	
	NEPI ROCKCASTLE NV	25,551	139.760	3,571,007.760	
	NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	27,487	112.480	3,091,737.760	
	GOLD FIELDS LTD	28,647	256.140	7,337,642.580	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,155	3,261.180	7,027,842.900	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	19,976	295.790	5,908,701.040	
	NEDBANK GROUP LTD	20,116	288.780	5,809,098.480	
	BIDVEST GROUP LTD	16,104	276.090	4,446,153.360	
	BID CORP LTD	13,607	441.210	6,003,544.470	
	STANDARD BANK GROUP LTD	47,351	236.880	11,216,504.880	
	SASOL LTD	61,188	87.870	5,376,589.560	

REMGRO LTD	18,193	150.680	2,741,321.240	
DISCOVERY LTD	21,708	192.690	4,182,914.520	
SANLAM LTD	69,481	88.100	6,121,276.100	
FIRSTRAND LTD	242,573	76.940	18,663,566.620	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	55,425	62.840	3,482,907.000	
THE FOSCHINI GROUP LTD	26,721	170.460	4,554,861.660	
ABSA GROUP LTD	42,792	172.500	7,381,620.000	
NASPERS LTD-N SHS	5,283	4,068.000	21,491,244.000	
MTN GROUP LTD	87,902	80.740	7,097,207.480	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	92,911	101.990	9,475,992.890	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,457	593.770	3,240,202.890	
SIBANYE STILLWATER LTD	613,083	17.880	10,961,924.040	
南アフリカ・ランド 小計			169,013,784.830 (1,399,434,139)	
合計			34,039,613,574 [34,039,613,574]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	895,500	18,608,490.000	
		アメリカ・ドル 小計		18,608,490.000 (2,795,367,368)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	113,100	2,401,113.000	
		メキシコ・ペソ 小計		2,401,113.000 (17,674,113)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329,010	4,273,839.900	
		南アフリカ・ランド 小計		4,273,839.900 (35,387,394)	
投資証券 合計				2,848,428,875 [2,848,428,875]	
合計				2,848,428,875 [2,848,428,875]	

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 31銘柄 投資証券 1銘柄	11.8%	88.2%	8.6%
インド・ルピー	株式 52銘柄	100%	-%	11.2%
インドネシア・ルピア	株式 7銘柄	100%	-%	1.1%
オフショア・人民元	株式 54銘柄	100%	-%	5.2%
サウジアラビア・リアル	株式 15銘柄	100%	-%	2.3%
タイ・バーツ	株式 19銘柄	100%	-%	3.1%
チリ・ペソ	株式 3銘柄	100%	-%	0.3%
トルコ・リラ	株式 11銘柄	100%	-%	1.6%
ブラジル・レアル	株式 45銘柄	100%	-%	10.5%
マレーシア・リングギット	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
メキシコ・ペソ	投資証券 1銘柄 株式 10銘柄	97.3%	2.7%	1.8%
香港・ドル	株式 80銘柄	100%	-%	32.8%
台湾・ドル	株式 63銘柄	100%	-%	17.0%
南アフリカ・ランド	投資証券 1銘柄 株式 23銘柄	97.5%	2.5%	3.9%

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。

「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

	2023年11月30日現在 金額（円）	2024年12月2日現在 金額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	4,412,640,617	935,612,287
コール・ローン	21,476,693,013	12,314,896,732
株式	373,664,357,535	640,051,843,230
投資証券	7,914,490,575	12,968,542,961
派生商品評価勘定	767,966,339	531,977,165
未収入金	2,191,526	272,143,851
未収配当金	501,157,490	705,868,948
差入委託証拠金	7,673,160,653	8,426,163,601
流動資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775
資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	430,202,473	102,188,208
未払金	-	351,019,600
未払解約金	112,438,900	96,853,900
流動負債合計	542,641,373	550,061,708
負債合計	542,641,373	550,061,708
純資産の部		
元本等		
元本	1 78,806,686,628	96,924,210,803
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	337,063,329,747	578,732,776,264
元本等合計	415,870,016,375	675,656,987,067
純資産合計	415,870,016,375	675,656,987,067
負債純資産合計	416,412,657,748	676,207,048,775

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額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、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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	69,133,888,947円	78,806,686,628円
期中追加設定元本額	14,051,097,197円	25,952,061,446円
期中一部解約元本額	4,378,299,516円	7,834,537,271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	253,960,411円	220,998,023円
A		
ダイワ国内重視バランスファン	2,398,033円	1,350,771円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国内重視バランスファン	27,113,381円	15,969,460円
ド50VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	4,173,336円	3,401,571円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	132,412,472円	86,602,062円
ド50VA(一般投資家私募)		
外国株式インデックスファンド	99,283,243円	115,530,989円
(FOFs用)(適格機関投資家専		
用)		
ダイワバランスファンド2023-01	90,561,111円	78,362,997円
(適格機関投資家専用)		
外国株式インデックスファンド	-円	8,513,726,153円
VA(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)	751,588,780円	778,108,890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)	4,575,264,354円	6,030,483,088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)	565,403,560円	574,681,998円
D - I ' s 外国株式インデック ス	20,741,287円	16,105,975円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2050	52,732,027円	46,031,100円
i F r e e 外国株式インデック ス(為替ヘッジなし)	7,602,914,266円	9,695,253,125円
i F r e e 8資産バランス	1,483,695,864円	1,527,157,717円
i F r e e 年金バランス	320,411,034円	349,136,994円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	3,052,677円	17,731,066円
D Cダイワ外国株式インデック ス	47,516,377,923円	51,273,187,597円
ダイワ・ライフ・バランス30	507,111,516円	436,772,696円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,075,299,438円	1,021,616,330円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,029,409,746円	999,681,626円
大和D C 海外株式インデックス ファンド	2,012,098,874円	1,115,631,309円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	12,430,841円	9,608,677円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	12,894,554円	11,191,152円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	2,126,545,615円	2,834,175,288円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	2,059,357円	1,783,392円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,504,278円	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	5,293,680円	11,526,686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)	11,365,941円	15,080,207円

ダイワ世界バランスファンド4 0VA	54,089,276円	40,375,354円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	34,472,185円	28,290,570円
ダイワ・バランスファンド35 VA	912,121,494円	637,648,190円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	48,039,078円	33,662,281円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	140,584,660円	123,320,896円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	310,032円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	-円	2,230,984円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	3,205,873円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	-円	132,574円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	-円	4,088,861円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	-円	4,740,611円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	-円	182,587円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	-円	2,951,492円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	-円	9,224,499円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,397,074,322円	1,222,019,164円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	429,662,271円	427,152,707円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	2,299,488,278円	5,037,602,817円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	3,021,971,653円	3,249,722,978円
ダイワライフスタイル25	8,689,227円	6,740,978円
ダイワライフスタイル50	39,113,782円	31,688,743円
ダイワライフスタイル75	32,628,804円	27,235,788円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	89,653,999円	78,106,048円



ダイワバランスファンド2024-01 (適格機関投資家専用)	-円	75,686,081円
ダイワバランスファンド2024-05 (適格機関投資家専用)	-円	74,388,492円
計	78,806,686,628円	96,924,210,803円
2. 期末日における受益権の総数	78,806,686,628口	96,924,210,803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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2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あります。</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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	39,406,570,740	123,657,362,007
投資証券	350,897,450	1,822,195,992
合計	39,055,673,290	125,479,557,999

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126	22,935,030,498	-	23,364,331,715	429,301,217
合計	33,591,785,481	-	34,198,119,607	606,334,126	22,935,030,498	-	23,364,331,715	429,301,217

## （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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	21,334,077,040	-	21,065,506,780	268,570,260	12,847,461,390	-	12,847,949,130	487,740
アメリカ・ドル	14,981,847,160	-	14,646,268,980	335,578,180	7,322,207,200	-	7,322,560,000	352,800
イギリス・ポンド	1,079,899,470	-	1,101,174,230	21,274,760	1,062,272,960	-	1,062,247,760	25,200
オーストラリア・ドル	630,276,320	-	642,564,780	12,288,460	601,938,160	-	602,055,340	117,180
カナダ・ドル	1,248,114,090	-	1,243,166,100	4,947,990	1,642,414,620	-	1,642,630,220	215,600
スイス・フラン	1,013,961,080	-	1,027,848,170	13,887,090	1,240,881,010	-	1,240,759,830	121,180
ユーロ	2,379,978,920	-	2,404,484,520	24,505,600	977,747,440	-	977,695,980	51,460
合計	21,334,077,040	-	21,065,506,780	268,570,260	12,847,461,390	-	12,847,949,130	487,740

## （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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	5,2771円	6,9710円
(1万口当たり純資産額)	(52,771円)	(69,710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	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,600	236.020	1,793,752.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	21,000	387.820	8,144,220.000	
	FIRST SOLAR INC	6,600	199.270	1,315,182.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,200	170.840	1,913,408.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,400	148.180	1,244,712.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	25,500	67.520	1,721,760.000	
	ABBOTT LABORATORIES	111,966	118.770	13,298,201.820	
	HOWMET AEROSPACE INC	24,983	118.380	2,957,487.540	
	VERISK ANALYTICS INC	9,200	294.210	2,706,732.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	23,700	53.060	1,257,522.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	77,600	72.650	5,637,640.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,200	567.640	1,816,448.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,100	85.300	2,994,030.000	
	QORVO INC	6,020	69.050	415,681.000	
	AFLAC INC	34,300	114.000	3,910,200.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	7,600	176.270	1,339,652.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	10,400	138.250	1,437,800.000		

ADOBE INC	28,320	515.930	14,611,137.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,500	89.660	1,031,090.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,200	320.660	2,308,752.000	
GARMIN LTD	9,900	212.600	2,104,740.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14,400	334.330	4,814,352.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,800	232.930	9,736,474.000	
WR BERKLEY CORP	19,613	64.550	1,266,019.150	
AUTOZONE INC	1,120	3,169.540	3,549,884.800	
DOLLAR TREE INC	13,171	71.270	938,697.170	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	76,900	16.780	1,290,382.000	
CELANESE CORP	7,050	73.210	516,130.500	
DR HORTON INC	18,916	168.780	3,192,642.480	
AUTODESK INC	13,900	291.900	4,057,410.000	
MOODY'S CORP	10,600	499.980	5,299,788.000	
DEVON ENERGY CORP	40,300	37.950	1,529,385.000	
ALBEMARLE CORP	7,600	107.700	818,520.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,100	151.320	1,528,332.000	
ALLIANT ENERGY CORP	16,600	63.200	1,049,120.000	
CITIGROUP INC	122,773	70.870	8,700,922.510	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,300	306.930	8,072,259.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,300	99.860	3,425,198.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	476.190	1,061,903.700	
HESS CORP	17,900	147.180	2,634,522.000	
DAVITA INC	2,950	166.170	490,201.500	
DANAHER CORP	41,850	239.690	10,031,026.500	
FORTIVE CORP	22,600	79.330	1,792,858.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	37,000	160.960	5,955,520.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	31,000	54.600	1,692,600.000	
APPLE INC	980,500	237.330	232,702,065.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,200	182.430	2,955,366.000	
BOEING CO/THE	46,900	155.440	7,290,136.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,115	159.830	1,616,680.450	
BECTON DICKINSON AND CO	18,599	221.900	4,127,118.100	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	165.400	1,372,820.000	
NISOURCE INC	28,900	38.090	1,100,801.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,600	105.580	802,408.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	47,571	81.870	3,894,637.770	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	270,904	44.340	12,011,883.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	85,350	483.020	41,225,757.000	

ANSYS INC	5,700	351.100	2,001,270.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	86,217	47.680	4,110,826.560	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	46,400	191.090	8,866,576.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	130,500	59.220	7,728,210.000	
JPMORGAN CHASE & CO	183,070	249.720	45,716,240.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,400	123.840	1,783,296.000	
LKQ CORP	16,700	39.290	656,143.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,812	42.080	497,048.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	17,700	306.810	5,430,537.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,400	573.970	3,673,408.000	
DOLLAR GENERAL CORP	14,200	77.270	1,097,234.000	
SERVICENOW INC	13,300	1,049.440	13,957,552.000	
CATERPILLAR INC	31,200	406.110	12,670,632.000	
BROWN & BROWN INC	15,700	113.100	1,775,670.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,800	40.030	672,504.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,400	199.060	676,804.000	
CMS ENERGY CORP	19,300	69.710	1,345,403.000	
MOSAIC CO/THE	20,100	26.460	531,846.000	
DELTA AIR LINES INC	10,400	63.820	663,728.000	
CORNING INC	52,400	48.670	2,550,308.000	
CISCO SYSTEMS INC	256,750	59.210	15,202,167.500	
MORGAN STANLEY	78,152	131.610	10,285,584.720	
DECKERS OUTDOOR CORP	9,900	195.960	1,940,004.000	
MSCI INC	5,100	609.630	3,109,113.000	
FAIR ISAAC CORP	1,600	2,375.030	3,800,048.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,100	667.130	1,400,973.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,000	285.440	1,141,760.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,300	77.340	1,105,962.000	
BROADCOM INC	285,620	162.080	46,293,289.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,800	370.490	1,037,372.000	
CNH INDUSTRIAL NV	56,500	12.560	709,640.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,800	207.240	787,512.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,300	253.070	2,100,481.000	
DTE ENERGY COMPANY	13,400	125.780	1,685,452.000	
CENTENE CORP	33,907	60.000	2,034,420.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,800	215.850	1,467,780.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	28,900	48.140	1,391,246.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,100	312.240	4,402,584.000	
GARTNER INC	5,050	517.930	2,615,546.500	

DOMINION ENERGY INC	54,041	58.750	3,174,908.750	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,300	55.130	2,607,649.000	
SMITH (A.O.) CORP	7,800	74.490	581,022.000	
DEERE & CO	16,800	465.900	7,827,120.000	
QUANTA SERVICES INC	9,500	344.520	3,272,940.000	
POOL CORP	2,500	377.090	942,725.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,384	118.960	1,949,040.640	
BURLINGTON STORES INC	4,100	281.880	1,155,708.000	
NASDAQ INC	27,800	82.990	2,307,122.000	
TARGA RESOURCES CORP	13,400	204.300	2,737,620.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	146.860	675,556.000	
WESTLAKE CORP	2,500	128.400	321,000.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,300	100.590	2,243,157.000	
TELEFLEX INC	3,100	192.850	597,835.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,300	189.110	1,002,283.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,700	325.680	1,530,696.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,300	340.530	442,689.000	
CATALENT INC	11,700	61.110	714,987.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,900	227.850	2,255,715.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	297.900	1,132,020.000	
CARLISLE COS INC	3,000	456.700	1,370,100.000	
IDEX CORP	4,900	230.630	1,130,087.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,000	96.630	4,831,500.000	
ROLLINS INC	18,707	50.330	941,523.310	
AECOM	8,600	116.970	1,005,942.000	
WATSCO INC	2,300	551.600	1,268,680.000	
GRACO INC	10,900	91.080	992,772.000	
AMETEK INC	14,900	194.380	2,896,262.000	
TORO CO	6,500	87.080	566,020.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,800	110.130	1,740,054.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,450	59.360	620,312.000	
HEICO CORP	2,900	273.370	792,773.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,500	490.670	1,226,675.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,800	83.340	1,400,112.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,800	629.170	1,761,676.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	28,560	971.880	27,756,892.800	
EPAM SYSTEMS INC	3,700	243.920	902,504.000	
RPM INTERNATIONAL INC	8,300	138.780	1,151,874.000	
RELIANCE INC	3,600	321.240	1,156,464.000	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	88,200	61.520	5,426,064.000	
CUMMINS INC	8,900	375.040	3,337,856.000	
CDW CORP/DE	8,600	175.930	1,512,998.000	
COSTAR GROUP INC	26,400	81.340	2,147,376.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12,400	225.140	2,791,736.000	
MERCADOLIBRE INC	2,990	1,985.170	5,935,658.300	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,700	176.180	828,046.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,916	253.440	4,033,751.040	
DEXCOM INC	25,800	77.990	2,012,142.000	
NORDSON CORP	3,590	260.990	936,954.100	
COPART INC	55,800	63.390	3,537,162.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	12,300	177.590	2,184,357.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,600	232.770	1,070,742.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,900	325.150	1,593,235.000	
TRANSDIGM GROUP INC	3,690	1,252.970	4,623,459.300	
BIO-TECHNE CORP	10,220	75.360	770,179.200	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,500	126.750	823,875.000	
KINDER MORGAN INC	128,781	28.270	3,640,638.870	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	327.220	4,090,250.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,500	258.690	646,725.000	
COTERRA ENERGY INC	47,600	26.720	1,271,872.000	
T-MOBILE US INC	33,827	246.940	8,353,239.380	
ZILLOW GROUP INC - C	9,950	84.710	842,864.500	
EMCOR GROUP INC	3,000	510.120	1,530,360.000	
COCA-COLA CO/THE	263,550	64.080	16,888,284.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,200	77.580	1,024,056.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,150	121.640	1,113,006.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,200	22.760	414,232.000	
CSX CORP	124,700	36.550	4,557,785.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,025	184.620	1,481,575.500	
AMAZON.COM INC	608,200	207.890	126,438,698.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	38,800	71.350	2,768,380.000	
EXXON MOBIL CORP	285,809	117.960	33,714,029.640	
AES CORP	45,800	13.040	597,232.000	
EVEREST GROUP LTD	2,800	387.560	1,085,168.000	
EOG RESOURCES INC	36,600	133.260	4,877,316.000	
EQT CORP	36,400	45.440	1,654,016.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	9,800	94.020	921,396.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	2,295.000	1,606,500.000	



CENCORA INC	11,500	251.550	2,892,825.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,500	137.970	2,552,445.000	
FORD MOTOR CO	251,223	11.130	2,796,111.990	
EXACT SCIENCES CORP	11,900	62.080	738,752.000	
ENTEGRIS INC	9,800	105.630	1,035,174.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	11,900	387.470	4,610,893.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	99.360	1,212,192.000	
FORTINET INC	41,900	95.050	3,982,595.000	
MARKEL CORP	820	1,782.920	1,461,994.400	
NEXTERA ENERGY INC	132,280	78.670	10,406,467.600	
FREEPORT-MCMORAN INC	92,508	44.200	4,088,853.600	
INSULET CORP	4,600	266.780	1,227,188.000	
US BANCORP	100,500	53.290	5,355,645.000	
UNITED RENTALS INC	4,300	866.000	3,723,800.000	
F5 NETWORKS INC	3,800	250.350	951,330.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,000	32.640	1,109,760.000	
FASTENAL CO	36,900	83.560	3,083,364.000	
FISERV INC	37,033	220.960	8,182,811.680	
GENERAL ELECTRIC CO	69,806	182.160	12,715,860.960	
AXON ENTERPRISE INC	4,700	646.960	3,040,712.000	
GENERAL MOTORS CO	72,300	55.590	4,019,157.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,100	284.010	4,288,551.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,350	608.570	12,384,399.500	
ALPHABET INC-CL A	377,000	168.950	63,694,150.000	
ALPHABET INC-CL C	323,440	170.490	55,143,285.600	
OWENS CORNING	5,600	205.620	1,151,472.000	
GENERAL MILLS INC	35,800	66.260	2,372,108.000	
FIRSTENERGY CORP	35,218	42.550	1,498,525.900	
GENUINE PARTS CO	9,050	126.730	1,146,906.500	
FIFTH THIRD BANCORP	43,600	48.060	2,095,416.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,250	246.250	3,016,562.500	
HALLIBURTON CO	56,800	31.860	1,809,648.000	
HOME DEPOT INC	63,950	429.130	27,442,863.500	
ASSURANT INC	3,350	227.100	760,785.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,500	18.010	1,683,935.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,610	197.920	516,571.200	
HERSHEY CO/THE	9,500	176.130	1,673,235.000	
HUMANA INC	7,800	296.380	2,311,764.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,400	229.370	3,761,668.000	

HENRY SCHEIN INC	8,100	77.050	624,105.000	
HP INC	62,000	35.430	2,196,660.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	83,600	21.220	1,773,992.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	24,300	100.720	2,447,496.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,403	31.970	1,867,143.910	
ENPHASE ENERGY INC	8,600	71.350	613,610.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	59,300	227.410	13,485,413.000	
HUBBELL INC	3,500	460.090	1,610,315.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	21,300	58.830	1,253,079.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,900	78.300	618,570.000	
ZOETIS INC	29,200	175.250	5,117,300.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,599	416.220	6,076,395.780	
CHENIERE ENERGY INC	14,600	224.010	3,270,546.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	157.940	458,026.000	
ALLEGION PLC	5,650	140.840	795,746.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,500	186.470	1,398,525.000	
WASTE CONNECTIONS INC	16,637	192.470	3,202,123.390	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.920	607,048.000	
JM SMUCKER CO/THE	6,900	117.790	812,751.000	
JOHNSON & JOHNSON	155,000	155.010	24,026,550.000	
ABBVIE INC	113,672	182.930	20,794,018.960	
HOLOGIC INC	15,000	79.500	1,192,500.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,700	139.350	3,023,895.000	
KROGER CO	44,300	61.080	2,705,844.000	
KLA CORP	8,700	647.030	5,629,161.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	13,800	529.410	7,305,858.000	
CORPAY INC	4,300	381.180	1,639,074.000	
LOWE'S COS INC	36,500	272.430	9,943,695.000	
ELI LILLY & CO	51,985	795.350	41,346,269.750	
LAM RESEARCH CORP	83,400	73.880	6,161,592.000	
LOEWS CORP	12,000	86.730	1,040,760.000	
MCDONALD'S CORP	46,150	296.010	13,660,861.500	
3M CO	35,390	133.530	4,725,626.700	
META PLATFORMS INC CLASS A	140,700	574.320	80,806,824.000	
S&P GLOBAL INC	20,639	522.510	10,784,083.890	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,000	600.000	2,400,000.000	
PHILLIPS 66	27,000	133.980	3,617,460.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	10,300	263.580	2,714,874.000	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,750	38.340	565,515.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,300	78.410	1,278,083.000	
METLIFE INC	38,300	88.230	3,379,209.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	55,800	92.690	5,172,102.000	
ARISTA NETWORKS INC	17,200	405.820	6,980,104.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,798	499.700	5,395,760.600	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,400	1,251.200	1,751,680.000	
BAKER HUGHES CO	63,923	43.950	2,809,415.850	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,300	295.140	2,154,522.000	
MERCK & CO. INC.	163,121	101.640	16,579,618.440	
DUPONT DE NEMOURS INC	26,951	83.590	2,252,834.090	
MASCO CORP	14,100	80.560	1,135,896.000	
M & T BANK CORP	10,799	219.990	2,375,672.010	
MARSH & MCLENNAN COS	31,670	233.230	7,386,394.100	
HEICO CORP-CLASS A	4,920	211.130	1,038,759.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,402	289.090	4,452,564.180	
WORKDAY INC-CLASS A	13,800	249.990	3,449,862.000	
BLOCK INC CLASS A	35,812	88.550	3,171,152.600	
TRANSUNION	12,600	101.500	1,278,900.000	
VISTRA CORP	22,100	159.840	3,532,464.000	
NETAPP INC	13,200	122.640	1,618,848.000	
NIKE INC -CL B	76,600	78.770	6,033,782.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,600	275.850	4,027,410.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34,600	68.170	2,358,682.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,605	169.280	2,133,774.400	
ALLY FINANCIAL INC	17,700	39.980	707,646.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,000	489.650	4,406,850.000	
APTIV PLC	17,100	55.530	949,563.000	
NEWMONT CORP	73,611	41.940	3,087,245.340	
MCKESSON CORP	8,400	628.500	5,279,400.000	
XYLEM INC	15,700	126.750	1,989,975.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	100,100	133.060	13,319,306.000	
NUCOR CORP	15,300	154.690	2,366,757.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,400	476.960	4,960,384.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,100	197.570	1,797,887.000	
EVERGY INC	14,850	64.630	959,755.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,724	50.580	2,059,819.920	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,650	440.560	726,924.000	
OKTA INC	10,500	77.560	814,380.000	

WIX.COM LTD	3,610	223.740	807,701.400	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,400	48.230	983,892.000	
KKR & CO INC	40,000	162.870	6,514,800.000	
PAYCHEX INC	20,900	146.270	3,057,043.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,800	1,243.220	4,724,236.000	
ALTRIA GROUP INC	109,800	57.740	6,339,852.000	
P G & E CORP	130,700	21.630	2,827,041.000	
PFIZER INC	364,713	26.210	9,559,127.730	
CIGNA CORP	18,000	337.800	6,080,400.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	20,601	127.590	2,628,481.590	
XCEL ENERGY INC	35,900	72.560	2,604,904.000	
STERIS PLC	6,400	219.060	1,401,984.000	
SEA LTD-ADR	25,100	113.800	2,856,380.000	
FOX CORP - CLASS B	9,133	44.730	408,519.090	
FOX CORP - CLASS A	14,499	47.120	683,192.880	
STRYKER CORP	22,080	392.150	8,658,672.000	
DOW INC	45,118	44.210	1,994,666.780	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,500	135.500	1,016,250.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	16,100	82.690	1,331,309.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,300	702.900	5,834,070.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	121,800	71.960	8,764,728.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	151,167	179.260	27,098,196.420	
EXELON CORP	64,422	39.560	2,548,534.320	
INGERSOLL-RAND INC	26,008	104.170	2,709,253.360	
NVR INC	200	9,235.580	1,847,116.000	
CONOCOPHILLIPS	83,803	108.340	9,079,217.020	
TWILIO INC - A	9,800	104.540	1,024,492.000	
DOCUSIGN INC	13,100	79.690	1,043,939.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,400	231.920	788,528.000	
DAYFORCE INC	10,200	79.990	815,898.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	20,100	52.990	1,065,099.000	
PEPSICO INC	88,300	163.450	14,432,635.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,020	323.510	977,000.200	
MONGODB INC	4,800	322.490	1,547,952.000	
SNAP INC - A	67,900	11.810	801,899.000	
CORTEVA INC	44,568	62.240	2,773,912.320	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	23,000	129.410	2,976,430.000	
AMCOR PLC	93,100	10.640	990,584.000	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,000	345.970	5,189,550.000	
ROKU INC	8,200	69.030	566,046.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,600	136.940	1,725,444.000	
ACCENTURE PLC-CL A	40,300	362.370	14,603,511.000	
PENTAIR PLC	10,675	108.990	1,163,468.250	
QUALCOMM INC	71,700	158.530	11,366,601.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,900	87.090	1,297,641.000	
DATADOG INC - CLASS A	18,100	152.750	2,764,775.000	
PINTEREST INC- CLASS A	38,900	30.320	1,179,448.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,000	750.220	5,251,540.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,200	218.300	3,099,860.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,200	5,201.980	11,444,356.000	
ROSS STORES INC	21,400	154.870	3,314,218.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,830	248.850	1,450,795.500	
RESMED INC	9,500	249.020	2,365,690.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,230	162.660	1,176,031.800	
MODERNA INC	21,100	43.060	908,566.000	
HUBSPOT INC	3,180	721.050	2,292,939.000	
REVVITY INC	8,000	116.140	929,120.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,287	77.370	4,045,445.190	
OTIS WORLDWIDE CORP	25,838	102.980	2,660,797.240	
AVANTOR INC	43,800	21.060	922,428.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	14,700	53.230	782,481.000	
DYNATRACE INC	19,300	56.190	1,084,467.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	29,000	128.550	3,727,950.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,885	27.260	1,605,205.100	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	24,100	26.660	642,506.000	
MATCH GROUP INC	15,800	32.740	517,292.000	
CHEVRON CORP	111,818	161.930	18,106,688.740	
ZSCALER INC	5,900	206.590	1,218,881.000	
EDISON INTERNATIONAL	24,900	87.750	2,184,975.000	
TESLA INC	185,050	345.160	63,871,858.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,500	174.800	3,408,600.000	
GEN DIGITAL INC	35,300	30.850	1,089,005.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,002	89.450	894,678.900	
SYNOPSIS INC	9,900	558.490	5,529,051.000	
CARVANA CO	7,800	260.420	2,031,276.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,600	99.830	1,956,668.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,005	396.965	2,383,774.820	

VIATRIS INC	76,821	13.090	1,005,586.890	
DOORDASH INC - A	19,850	180.480	3,582,528.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	30,900	50.130	1,549,017.000	
AIRBNB INC-CLASS A	28,400	136.110	3,865,524.000	
CBRE GROUP INC - A	19,800	139.990	2,771,802.000	
SOUTHERN CO/THE	70,500	89.130	6,283,665.000	
SYSCO CORP	31,600	77.110	2,436,676.000	
TRAVELERS COS INC/THE	14,703	266.040	3,911,586.120	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,900	87.230	340,197.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,000	82.630	578,410.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,450	145.270	1,372,801.500	
SCHLUMBERGER LTD	91,352	43.940	4,014,006.880	
AT&T INC	461,491	23.160	10,688,131.560	
APA CORP	23,300	22.650	527,745.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	9,750	32.360	315,510.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	27,600	71.120	1,962,912.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,500	397.400	6,159,700.000	
SEMPRA ENERGY	40,800	93.670	3,821,736.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,300	49.500	509,850.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	131,100	67.080	8,794,188.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,650	101.330	1,383,154.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,500	296.200	3,702,500.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	58,800	201.030	11,820,564.000	
SALESFORCE.COM INC	61,566	329.990	20,316,164.340	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	25,709	175.030	4,499,846.270	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	43,034	83.860	3,608,831.240	
TERADYNE INC	10,600	110.000	1,166,000.000	
UNION PACIFIC CORP	39,280	244.660	9,610,244.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,488	156.150	3,355,351.200	
RTX CORP	85,679	121.830	10,438,272.570	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,200	135.720	6,405,984.000	
IQVIA HOLDINGS INC	11,804	200.840	2,370,715.360	
AMEREN CORPORATION	17,200	94.390	1,623,508.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,466	610.200	36,286,153.200	
APPLOVIN CORP CLASS A	13,400	336.750	4,512,450.000	
TOAST INC CLASS A	25,400	43.540	1,105,916.000	
VERISIGN INC	5,700	187.180	1,066,926.000	

RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	48,400	12.230	591,932.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	34,400	37.540	1,291,376.000	
VALERO ENERGY CORP	20,642	139.080	2,870,889.360	
ULTA BEAUTY INC	3,100	386.640	1,198,584.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	16,788	63.390	1,064,191.320	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,830	205.000	785,150.000	
ELEVANCE HEALTH INC	15,000	406.960	6,104,400.000	
WALT DISNEY CO/THE	116,762	117.470	13,716,032.140	
WELLS FARGO & CO	218,822	76.170	16,667,671.740	
WASTE MANAGEMENT INC	25,900	228.220	5,910,898.000	
WILLIAMS COS INC	78,500	58.520	4,593,820.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,000	283.670	1,985,690.000	
WALMART INC	284,500	92.500	26,316,250.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,100	112.100	1,468,510.000	
WYNN RESORTS LTD	6,400	94.380	604,032.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	143,300	5.000	716,500.000	
WABTEC CORP	11,311	200.620	2,269,212.820	
TJX COMPANIES INC	72,600	125.690	9,125,094.000	
WATERS CORP	3,900	384.720	1,500,408.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,400	407.000	1,383,800.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	47,300	9.020	426,646.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,563	322.000	2,113,286.000	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,200	172.020	1,410,564.000	
WESTERN DIGITAL CORP	22,400	72.990	1,634,976.000	
WEC ENERGY GROUP INC	20,400	101.050	2,061,420.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	32,100	94.300	3,027,030.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	107,850	315.080	33,981,378.000	
PPL CORP	47,500	34.930	1,659,175.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	20,124	256.560	5,163,013.440	
PULTEGROUP INC	13,350	135.270	1,805,854.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	149,953	10.480	1,571,507.440	
PPG INDUSTRIES INC	15,100	124.370	1,877,987.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,000	111.160	1,445,080.000	
NVIDIA CORP	1,580,200	138.250	218,462,650.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	25,613	214.720	5,499,623.360	

DRAFTKINGS INC CLASS A	28,200	43.650	1,230,930.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,900	250.000	475,000.000	
TYSON FOODS INC-CL A	18,400	64.500	1,186,800.000	
NETFLIX INC	27,690	886.810	24,555,768.900	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,600	529.630	13,028,898.000	
NRG ENERGY INC	13,350	101.610	1,356,493.500	
TEXTRON INC	12,000	85.630	1,027,560.000	
NEWS CORP - CLASS A	24,487	29.350	718,693.450	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,600.090	2,160,121.500	
OMNICOM GROUP	12,600	104.820	1,320,732.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,020	141.230	1,132,664.600	
ORACLE CORP	107,033	184.840	19,783,979.720	
MASTERCARD INC - A	53,100	532.940	28,299,114.000	
ONEOK INC	37,600	113.600	4,271,360.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,900	566.440	3,908,436.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,300	62.440	393,372.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	12,200	176.730	2,156,106.000	
EXPAND ENERGY CORP	13,500	98.960	1,335,960.000	
HF SINCLAIR CORP	10,500	40.930	429,765.000	
OVINTIV INC	17,000	45.420	772,140.000	
YUM! BRANDS INC	18,100	138.940	2,514,814.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11,400	188.380	2,147,532.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,700	62.060	726,102.000	
BANK OF AMERICA CORP	449,301	47.510	21,346,290.510	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,100	485.260	1,504,306.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,300	66.030	812,169.000	
AMERICAN EXPRESS CO	36,600	304.680	11,151,288.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	29,535	83.220	2,457,902.700	
LINDE PLC	30,746	460.990	14,173,598.540	
ANALOG DEVICES INC	31,991	218.050	6,975,637.550	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	24,300	19.850	482,355.000	
MONDAYCOM LTD	2,600	285.360	741,936.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	104,227	137.175	14,297,338.720	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	32.370	556,764.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	13,600	88.360	1,201,696.000	
KENVUE INC	123,300	24.080	2,969,064.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	6,800	52.280	355,504.000	



VERALTO CORP	15,916	108.190	1,721,952.040	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	41,372	76.880	3,180,679.360	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	89.740	825,608.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	23,000	127.600	2,934,800.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,100	65.280	1,116,288.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,300	87.590	902,177.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,800	244.060	3,856,148.000	
AVERY DENNISON CORP	5,230	205.950	1,077,118.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	31,900	80.490	2,567,631.000	
EMERSON ELECTRIC CO	36,900	132.600	4,892,940.000	
AON PLC-CLASS A	12,600	391.540	4,933,404.000	
AMGEN INC	34,600	282.870	9,787,302.000	
SAMSARA INC CLASS A	14,100	53.490	754,209.000	
EATON CORP PLC	25,636	375.420	9,624,267.120	
COOPER INC	12,900	104.460	1,347,534.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	240.950	2,554,070.000	
APPLIED MATERIALS INC	53,100	174.710	9,277,101.000	
CME GROUP INC	23,200	238.000	5,521,600.000	
ECOLAB INC	16,500	248.770	4,104,705.000	
EQUIFAX INC	8,000	261.560	2,092,480.000	
GILEAD SCIENCES INC	80,200	92.580	7,424,916.000	
KEURIG DR PEPPER INC	74,500	32.650	2,432,425.000	
HORMEL FOODS CORP	19,500	32.430	632,385.000	
STATE STREET CORP	19,013	98.510	1,872,970.630	
SOLVENTUM CORP	9,472	71.510	677,342.720	
GE VERNOVA	17,726	334.120	5,922,611.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	103,340	82.760	8,552,418.400	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	44,000	102.270	4,499,880.000	
LABCORP HOLDINGS	5,500	241.160	1,326,380.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	32,900	33.710	1,109,059.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	33,500	55.020	1,843,170.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,000	215.930	2,807,090.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,500	276.320	3,177,680.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,500	46.200	577,500.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,780	92.090	716,460.200	
TE CONNECTIVITY LTD	19,595	151.120	2,961,196.400	
BLACKROCK INC	9,600	1,022.800	9,818,880.000	
CARDINAL HEALTH INC	15,600	122.240	1,906,944.000	
FEDEX CORP	15,000	302.670	4,540,050.000	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,654	192.010	4,733,814.540	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16,513	91.360	1,508,627.680	
INTEL CORP	275,300	24.050	6,620,965.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	24,200	30.810	745,602.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,850	123.310	2,324,393.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	19,100	277.520	5,300,632.000	
ILLUMINA INC	10,300	144.150	1,484,745.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	22,900	542.000	12,411,800.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,050	182.000	1,101,100.000	
SNAP-ON INC	3,400	369.690	1,256,946.000	
CARMAX INC	10,000	83.970	839,700.000	
DUKE ENERGY CORP	49,728	117.050	5,820,662.400	
TARGET CORP	29,700	132.310	3,929,607.000	
DOVER CORP	8,900	205.900	1,832,510.000	
WW GRAINGER INC	2,900	1,205.340	3,495,486.000	
JABIL INC	7,300	135.830	991,559.000	
CINTAS CORP	23,400	225.790	5,283,486.000	
CONAGRA BRANDS INC	30,800	27.550	848,540.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	9,100	77.240	702,884.000	
CLOROX COMPANY	8,000	167.170	1,337,360.000	
ENTERGY CORP	13,800	156.170	2,155,146.000	
MICROSOFT CORP	454,400	423.460	192,420,224.000	
INCYTE CORP	10,600	74.590	790,654.000	
CVS HEALTH CORP	80,969	59.850	4,845,994.650	
MEDTRONIC PLC	82,598	86.540	7,148,030.920	
MICRON TECHNOLOGY INC	71,400	97.950	6,993,630.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,000	32.620	1,370,040.000	
KELLOGG CO	17,800	81.290	1,446,962.000	
KEYCORP	60,700	19.480	1,182,436.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	86,011	64.950	5,586,414.450	
CHUBB LTD	24,699	288.730	7,131,342.270	
ALLSTATE CORP	17,000	207.390	3,525,630.000	
EBAY INC	31,400	63.290	1,987,306.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	62,450	86.770	5,418,786.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,600	104.720	795,872.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,100	72.120	1,089,012.000	
TRIMBLE INC	15,800	72.970	1,152,926.000	
LENNAR CORP-A	15,400	174.390	2,685,606.000	
PROGRESSIVE CORP	37,700	268.880	10,136,776.000	

	PACCAR INC	33,755	117.000	3,949,335.000	
	BIOGEN INC	9,400	160.630	1,509,922.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	5,300	421.750	2,235,275.000	
	STARBUCKS CORP	73,000	102.460	7,479,580.000	
	PTC INC	7,800	200.060	1,560,468.000	
	EVERSOURCE ENERGY	23,100	64.490	1,489,719.000	
	INTUIT INC	18,080	641.730	11,602,478.400	
	BEST BUY CO INC	13,150	90.000	1,183,500.000	
	BALL CORP	19,504	62.160	1,212,368.640	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	94,797	90.660	8,594,296.020	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,200	163.670	2,651,454.000	
	VULCAN MATERIALS CO	8,500	288.130	2,449,105.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,700	468.130	7,817,771.000	
	CARNIVAL CORP	67,000	25.430	1,703,810.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	248,490	43.190	10,732,283.100	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,900	43.660	475,894.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	74,900	4.550	340,795.000	
	アメリカ・ドル 小計			3,362,585,021.410 (505,127,521,916)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	383,106	25.315	9,698,328.390	
	HALEON PLC	478,287	3.743	1,790,228.240	
	WISE PLC CLASS A	41,324	8.820	364,477.680	
	BP PLC	998,128	3.846	3,839,299.350	
	UNILEVER PLC	153,476	47.010	7,214,906.760	
	BARCLAYS PLC	894,022	2.638	2,358,430.030	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	525,954	5.586	2,937,979.040	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	139,100	3.827	532,335.700	
	PRUDENTIAL PLC	166,101	6.418	1,066,036.210	
	NATWEST GROUP PLC	439,038	4.027	1,768,006.020	
	BAE SYSTEMS PLC	186,884	12.270	2,293,066.680	
	AVIVA PLC	165,520	4.837	800,620.240	
	GSK	256,394	13.350	3,422,859.900	
	INFORMA PLC	82,266	8.566	704,690.550	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	79,673	5.744	457,641.710	
	AUTO TRADER GROUP PLC	54,168	8.390	454,469.520	
	DCC PLC	6,000	57.250	343,500.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,537	71.700	325,302.900		
HALMA PLC	23,492	27.080	636,163.360		

ENTAIN PLC	37,644	8.056	303,260.060	
JD SPORTS FASHION PLC	157,238	1.018	160,068.280	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	43,485	5.140	223,512.900	
M&G PLC	140,210	1.982	277,896.220	
ENDEAVOUR MINING PLC	11,149	15.440	172,140.560	
RELX PLC	115,161	37.050	4,266,715.050	
DIAGEO PLC	137,617	23.525	3,237,439.920	
RIO TINTO PLC	69,763	49.365	3,443,850.490	
STANDARD CHARTERED PLC	129,547	9.724	1,259,715.020	
TESCO PLC	423,328	3.664	1,551,073.790	
SMITH & NEPHEW PLC	54,049	9.970	538,868.530	
GLENCORE PLC	641,359	3.799	2,436,843.520	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,583	10.935	236,010.100	
SMITHS GROUP PLC	21,328	17.710	377,718.880	
PEARSON PLC	36,465	12.330	449,613.450	
SAINSBURY (J) PLC	110,288	2.612	288,072.250	
NEXT PLC	7,260	100.800	731,808.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	219,530	1.310	287,584.300	
WHITBREAD PLC	11,175	28.500	318,487.500	
BUNZL PLC	20,780	35.580	739,352.400	
VODAFONE GROUP PLC	1,369,469	0.708	970,679.620	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,048	34.500	277,656.000	
KINGFISHER PLC	111,437	2.475	275,806.570	
WPP PLC	66,707	8.592	573,146.540	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	41,285	11.195	462,185.570	
SEVERN TRENT PLC	16,741	26.970	451,504.770	
RENTOKIL INITIAL PLC	156,167	3.938	614,985.640	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,667	48.600	2,073,616.200	
SCHRODERS PLC	50,139	3.152	158,038.120	
SSE PLC	68,310	17.715	1,210,111.650	
BARRATT REDROW PLC	83,251	4.277	356,064.520	
ASTRAZENECA PLC	95,878	106.120	10,174,573.360	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	360,719	2.213	798,271.140	
3I GROUP PLC	60,243	37.090	2,234,412.870	
ASHTREAD GROUP PLC	27,078	62.900	1,703,206.200	
SAGE GROUP PLC/THE	62,153	13.120	815,447.360	
NATIONAL GRID PLC	302,654	9.926	3,004,143.600	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,778,874	0.530	2,005,070.540	
IMPERIAL BRANDS PLC	49,174	25.690	1,263,280.060	

	CENTRICA PLC	317,757	1.274	404,822.410	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	6,307	41.480	261,614.360	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	123,236	29.880	3,682,291.680	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,360	21.980	447,512.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,123,966	7.327	8,235,298.880	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,545	25.205	1,979,726.720	
	MONDI PLC	27,400	11.905	326,197.000	
	COMPASS GROUP PLC	104,878	26.910	2,822,266.980	
	PERSIMMON PLC	19,842	12.580	249,612.360	
	BT GROUP PLC	400,162	1.593	637,458.060	
	COCA-COLA HBC AG-DI	13,456	28.040	377,306.240	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,766	98.000	957,068.000	
	INTERTEK GROUP PLC	9,770	47.160	460,753.200	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,546	112.700	3,329,834.200	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,116	19.240	194,631.840	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,763	25.630	404,005.690	
	ANTOFAGASTA PLC	23,883	17.025	406,608.070	
	EXPERIAN PLC	56,849	37.510	2,132,405.990	
イギリス・ポンド 小計				119,039,988.310 (22,700,925,771)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	83,833	24.400	2,045,525.200	
	AZRIELI GROUP LTD	2,916	293.100	854,679.600	
	ICL GROUP LTD	52,523	16.530	868,205.190	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,818	903.900	1,643,290.200	
	BANK HAPOALIM BM	85,712	42.920	3,678,759.040	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	102,278	42.400	4,336,587.200	
	NICE LTD	4,254	667.000	2,837,418.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,481	159.800	1,674,863.800	
イスラエル・シュケル 小計				17,939,328.230 (742,385,014)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	130,838	5.180	677,740.840	
	TELSTRA GROUP LTD	243,639	3.940	959,937.660	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	179,129	31.170	5,583,450.930	
	SGH LTD	11,606	49.510	574,613.060	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	161,885	3.820	618,400.700	
	BHP GROUP LTD	305,712	40.570	12,402,735.840	
	SOUTH32 LTD	272,748	3.720	1,014,622.560	

WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	114,396	24.510	2,803,845.960	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	101,972	18.990	1,936,448.280	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	185,047	39.100	7,235,337.700	
WESTPAC BANKING CORP	206,888	33.360	6,901,783.680	
SANTOS LTD	195,603	6.610	1,292,935.830	
RIO TINTO LTD	22,336	118.240	2,641,008.640	
ORIGIN ENERGY LTD	103,789	10.870	1,128,186.430	
XERO LTD	8,695	173.850	1,511,625.750	
PRO MEDICUS LTD	3,466	251.890	873,050.740	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,391	34.800	500,806.800	
COLES GROUP LTD	80,744	18.590	1,501,030.960	
WISETECH GLOBAL LTD	11,166	128.100	1,430,364.600	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	69,302	17.510	1,213,478.020	
REECE LTD	13,293	25.740	342,161.820	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	92,025	4.370	402,149.250	
SEEK LTD	20,978	26.120	547,945.360	
TREASURY WINE ESTATES LTD	49,025	11.330	555,453.250	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	100,813	158.580	15,986,925.540	
ORICA LTD	29,452	18.110	533,375.720	
QBE INSURANCE GROUP LTD	90,688	20.000	1,813,760.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	73,541	30.180	2,219,467.380	
QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	8.770	388,791.640	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	25,870	56.210	1,454,152.700	
MACQUARIE GROUP LTD	21,855	231.110	5,050,909.050	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	34,067	67.750	2,308,039.250	
CSL LTD	29,205	282.220	8,242,235.100	
WESFARMERS LTD	68,356	71.830	4,910,011.480	
COCHLEAR LTD	3,939	304.240	1,198,401.360	
BLUESCOPE STEEL LTD	26,558	22.130	587,728.540	
SUNCORP GROUP LTD	76,617	19.700	1,509,354.900	
ASX LTD	11,659	66.060	770,193.540	
COMPUTERSHARE LTD	31,960	31.890	1,019,204.400	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	142,734	8.530	1,217,521.020	
SONIC HEALTHCARE LTD	27,610	28.570	788,817.700	
BRAMBLES LTD	83,864	19.030	1,595,931.920	
CARSALLES.COM LTD	22,876	41.500	949,354.000	
MINERAL RESOURCES LTD	10,688	33.630	359,437.440	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,801	39.590	427,611.590	
REA GROUP LTD	3,200	251.530	804,896.000	

オーストラリア・ドル 小計				108,785,234.930 (10,614,175,372)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	44,400	81.910	3,636,804.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	20,881	80.310	1,676,953.110	
	IMPERIAL OIL LTD	10,800	103.690	1,119,852.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,200	4,734.160	5,680,992.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	18,087	97.510	1,763,663.370	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,600	87.120	2,317,392.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,450	266.670	2,786,701.500	
	BCE INC	4,130	37.900	156,527.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,300	171.440	1,937,272.000	
	SUNCOR ENERGY INC	73,830	55.710	4,113,069.300	
	METRO INC/CN	12,300	91.230	1,122,129.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	20,000	138.710	2,774,200.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	72,600	79.850	5,797,110.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	55,300	90.880	5,025,664.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	102,500	79.230	8,121,075.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	16,500	50.410	831,765.000	
	MEG ENERGY CORP	15,100	25.200	380,520.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	82,950	176.160	14,612,472.000	
	TOURMALINE OIL CORP	20,900	66.080	1,381,072.000	
	TC ENERGY CORP	60,850	68.260	4,153,621.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	34,029	57.680	1,962,792.720	
	BARRICK GOLD CORP	102,700	24.520	2,518,204.000	
	CAE INC	18,800	32.910	618,708.000	
	THOMSON REUTERS CORP	9,241	228.440	2,111,014.040	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,600	41.980	319,048.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,200	137.520	440,064.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,850	77.610	686,848.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	23,900	29.700	709,830.000	
	HYDRO ONE LTD	19,400	45.790	888,326.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,960	181.700	1,628,032.000	
	STANTEC INC	6,600	121.270	800,382.000	
	WSP GLOBAL INC	7,700	248.970	1,917,069.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,900	115.000	563,500.000		
PARKLAND CORP	8,300	36.150	300,045.000		
QUEBECOR INC -CL B	9,200	33.060	304,152.000		

EMERA INC	17,000	53.420	908,140.000	
TFI INTERNATIONAL INC	4,800	213.170	1,023,216.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,500	35.940	269,550.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	21,100	50.000	1,055,000.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	44,400	18.850	836,940.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	29,517	118.060	3,484,777.020	
AIR CANADA	10,200	24.960	254,592.000	
KINROSS GOLD CORP	72,100	13.710	988,491.000	
BANK OF MONTREAL	42,800	133.500	5,713,800.000	
POWER CORP OF CANADA	33,000	47.160	1,556,280.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	71,100	161.840	11,506,824.000	
NUTRIEN LTD	29,019	65.400	1,897,842.600	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	8,000	44.620	356,960.000	
CAMECO CORP	25,600	83.850	2,146,560.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,400	273.120	655,488.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,500	66.410	896,535.000	
TELUS CORP	10,800	21.800	235,440.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	26,700	65.370	1,745,379.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,100	154.370	478,547.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,800	47.520	5,882,976.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	1,986.300	2,582,190.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,700	63.630	998,991.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,537	225.050	796,001.850	
PAN AMERICAN SILVER CORP	21,400	31.060	664,684.000	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,100	165.100	842,010.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,900	86.170	2,921,163.000	
ENBRIDGE INC	127,700	60.570	7,734,789.000	
BROOKFIELD CORP	80,225	86.040	6,902,559.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	102,900	45.070	4,637,703.000	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	54,720	107.110	5,861,059.200	
IA FINANCIAL CORP INC	5,400	133.830	722,682.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	69.600	577,680.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	31,350	156.340	4,901,259.000	
CGI INC - CLASS A	12,000	158.480	1,901,760.000	
ONEX CORPORATION	3,600	113.890	410,004.000	
IGM FINANCIAL INC	4,700	47.310	222,357.000	
TMX GROUP LTD	16,400	44.270	726,028.000	
OPEN TEXT CORP	15,400	42.640	656,656.000	
SAPUTO INC	15,000	26.100	391,500.000	



	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	40,700	19.130	778,591.000	
	FORTIS INC	29,100	62.590	1,821,369.000	
	RB GLOBAL INC	10,800	138.340	1,494,072.000	
	LUNDIN MINING CORP	38,900	13.740	534,486.000	
	GENOVUS ENERGY INC	79,700	22.180	1,767,746.000	
	DOLLARAMA INC	16,500	145.840	2,406,360.000	
	ALTAGAS LTD	17,600	34.240	602,624.000	
	KEYERA CORP	13,500	46.170	623,295.000	
	ARC RESOURCES LTD	34,200	25.810	882,702.000	
カナダ・ドル 小計				182,412,528.210 (19,527,261,145)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	158,800	2.730	433,524.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	85,800	36.360	3,119,688.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,140	42.430	5,733,990.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,975	6.310	637,152.250	
	KEPPEL CORP LTD	98,800	6.730	664,924.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	175,200	2.410	422,232.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	229,600	16.280	3,737,888.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	410,000	0.765	313,650.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	503,950	3.100	1,562,245.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	105,900	4.500	476,550.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	60,600	5.220	316,332.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	58,200	12.720	740,304.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,300	3.080	401,324.000	
シンガポール・ドル 小計				18,559,803.450 (2,076,656,408)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	24,336	40.140	976,847.040	
	GALDERMA GROUP N AG	3,485	90.250	314,521.250	
	AVOLTA AG	5,344	32.560	174,000.640	
	UBS GROUP AG-REG	195,634	28.480	5,571,656.320	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,953	270.800	528,872.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	398	626.500	249,347.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,081	23.500	236,903.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	41,826	255.500	10,686,543.000	
	SIKA AG-REG	9,038	228.100	2,061,567.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	100,000.000	700,000.000	
	ABB LTD-REG	94,086	50.280	4,730,644.080	
	SWISS RE AG	17,985	130.150	2,340,747.750	

	NESTLE SA-REG	155,813	76.480	11,916,578.240	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,313	1,280.000	1,680,640.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,459	254.400	625,569.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,239	58.300	713,533.700	
	SGS SA-REG	8,915	87.480	779,884.200	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,361	249.500	339,569.500	
	TEMENOS AG - REG	3,332	57.850	192,756.200	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,158	154.400	333,195.200	
	VAT GROUP AG	1,568	351.400	550,995.200	
	BKW AG	1,274	151.400	192,883.600	
	ALCON INC	29,765	78.380	2,332,980.700	
	SIG GROUP N AG	17,784	17.420	309,797.280	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,680	159.950	268,716.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,683	558.600	4,850,323.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	167.400	439,257.600	
	CLARIANT AG-REG	12,962	10.610	137,526.820	
	NOVARTIS AG-REG	117,237	93.270	10,934,694.990	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	1,344.000	284,928.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,976	68.100	134,565.600	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	31,964	122.700	3,921,982.800	
	SWISSCOM AG-REG	1,501	508.500	763,258.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,706	87.450	149,189.700	
	GEBERIT AG-REG	2,037	530.400	1,080,424.800	
	GIVAUDAN-REG	532	3,881.000	2,064,692.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,672	114.650	764,944.800	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,042	300.800	915,033.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,027	71.500	645,430.500	
	LONZA GROUP AG-REG	4,286	526.400	2,256,150.400	
	HOLCIM LTD	31,012	89.740	2,783,016.880	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,665	721.800	1,201,797.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,908	210.600	612,424.800	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,478	97.350	435,933.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	10,180.000	600,620.000	
	スイス・フラン 小計			83,784,946.090 (14,250,981,480)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	14,863	241.600	3,590,900.800	
	ERICSSON LM-B SHS	188,367	88.680	16,704,385.560	
	VOLVO AB-B SHS	107,747	271.600	29,264,085.200	

SKF AB-B SHARES	23,083	209.500	4,835,888.500	
TELE2 AB-B SHS	37,061	114.450	4,241,631.450	
GETINGE AB-B SHS	15,558	170.450	2,651,861.100	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	107,545	151.500	16,293,067.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	98,755	113.500	11,208,692.500	
SWEDBANK AB - A SHARES	57,604	213.800	12,315,735.200	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	38,431	151.250	5,812,688.750	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	41,123	141.700	5,827,129.100	
SKANSKA AB-B SHS	23,045	227.500	5,242,737.500	
SANDVIK AB	72,305	201.700	14,583,918.500	
INVESTOR AB-B SHS	117,358	299.250	35,119,381.500	
ATLAS COPCO AB-A SHS	182,109	174.150	31,714,282.350	
VOLVO AB-A SHS	13,595	273.000	3,711,435.000	
HOLMEN AB-B SHARES	5,187	410.800	2,130,819.600	
SECURITAS AB-B SHS	33,354	137.950	4,601,184.300	
TELIA CO AB	159,946	31.950	5,110,274.700	
ALFA LAVAL AB	19,616	464.300	9,107,708.800	
ATLAS COPCO AB-B SHS	105,851	154.100	16,311,639.100	
ASSA ABLOY AB-B	67,924	334.900	22,747,747.600	
TRELLEBORG AB-B SHS	14,434	360.600	5,204,900.400	
SAAB AB-B	21,739	238.850	5,192,360.150	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,245	358.200	2,953,359.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	44,935	83.920	3,770,945.200	
INDUTRADE AB	18,567	278.400	5,169,052.800	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,243	302.400	4,004,683.200	
LUNDBERGS AB-B SHS	5,174	529.000	2,737,046.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,085	277.000	2,793,545.000	
LIFCO AB-B SHS	15,838	331.000	5,242,378.000	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	102,777	46.220	4,750,352.940	
BEIJER REF AB	26,093	172.000	4,487,996.000	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	41,334	300.200	12,408,466.800	
BOLIDEN AB	18,584	325.400	6,047,233.600	
EPIROC AB-A	44,685	198.750	8,881,143.750	
EPIROC AB-B	26,397	179.900	4,748,820.300	
EQT AB	25,224	330.500	8,336,532.000	
EVOLUTION AB	11,473	952.000	10,922,296.000	
HEXAGON AB-B SHS	140,739	92.940	13,080,282.660	
ADDTECH AB-B SHARES	17,593	300.000	5,277,900.000	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	357.500	3,882,092.500	

スウェーデン・クローナ 小計				383,018,580.910 (5,262,675,302)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	213,987	757.300	162,052,355.100	
	DANSKE BANK A/S	46,742	202.700	9,474,603.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	187	11,570.000	2,163,590.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68,428	109.700	7,506,551.600	
	CARLSBERG AS-B	6,514	726.800	4,734,375.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	23,918	413.700	9,894,876.600	
	COLOPLAST-B	8,571	889.400	7,623,047.400	
	DSV PANALPINA A/S	13,856	1,507.000	20,880,992.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	599	2,574.000	1,541,826.000	
	DEMANT A/S	6,039	269.200	1,625,698.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	301	11,975.000	3,604,475.000	
	TRYG A/S	22,999	162.600	3,739,637.400	
	PANDORA A/S	5,558	1,136.500	6,316,667.000	
	GENMAB A/S	4,267	1,526.000	6,511,442.000	
	ZEALAND PHARMA A/S	4,339	730.000	3,167,470.000	
ORSTED A/S	11,406	391.800	4,468,870.800		
デンマーク・クローネ 小計				255,306,478.300 (5,415,050,405)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	88,421	6.210	549,094.410	
	MERCURY NZ LTD	47,473	6.620	314,271.260	
	INFRATIL LTD	62,300	12.850	800,555.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	102,597	7.760	796,152.720	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,694	38.050	1,510,356.700	
ニュージーランド・ドル 小計				3,970,430.090 (351,819,810)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	60,750	230.700	14,015,025.000	
	NORSK HYDRO ASA	95,339	68.300	6,511,653.700	
	ORKLA ASA	47,532	101.900	4,843,510.800	
	TELENOR ASA	41,757	130.000	5,428,410.000	
	EQUINOR ASA	56,779	267.200	15,171,348.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,226	310.600	3,486,795.600	
	MOWI ASA	31,524	200.400	6,317,409.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,578	196.400	2,666,719.200	
	AKER BP ASA	21,464	226.400	4,859,449.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,949	1,299.000	7,727,751.000	

	SALMAR ASA	4,513	574.000	2,590,462.000	
ノルウェー・クローネ 小計				73,618,535.300 (998,267,339)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	51,857	22.810	1,182,858.170	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,125	35.800	1,114,275.000	
	EXOR NV	6,288	93.650	588,871.200	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,168	59.080	423,485.440	
	DSM FIRMENICH AG	11,673	103.950	1,213,408.350	
	FERROVIAL	29,720	39.020	1,159,674.400	
	LOTUS BAKERIES NV	25	11,380.000	284,500.000	
	SYENSCO SA	4,547	70.260	319,472.220	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	14,400	23.170	333,648.000	
	BAYER AG-REG	61,899	19.388	1,200,097.810	
	EVONIK INDUSTRIES AG	15,701	17.365	272,647.860	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	119,323	16.074	1,917,997.900	
	COMMERZBANK AG	59,422	14.525	863,104.550	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,012	80.720	1,050,328.640	
	SIEMENS AG-REG	47,898	183.160	8,772,997.680	
	E.ON SE	141,342	12.185	1,722,252.270	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,111	70.020	1,268,132.220	
	GEA GROUP AG	9,811	47.320	464,256.520	
	CONTINENTAL AG	6,941	62.040	430,619.640	
	BASF SE	56,200	42.420	2,384,004.000	
	ALLIANZ SE-REG	24,668	292.200	7,207,989.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10,655	80.760	860,497.800	
	RHEINMETALL AG	2,761	622.400	1,718,446.400	
	RWE AG	39,781	31.870	1,267,820.470	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	37,885	6.336	240,039.360	
	BRENNTAG SE	7,967	61.000	485,987.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	26,647	33.270	886,545.690	
	SAP SE	65,778	224.900	14,793,472.200	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,384	494.300	4,144,211.200	
	ZALANDO SE	14,145	29.420	416,145.900	
HEIDELBERG MATERIALS AG	8,557	119.400	1,021,705.800		
COVESTRO AG	11,566	57.720	667,589.520		
RATIONAL AG	306	885.000	270,810.000		
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	83.550	317,490.000		
SARTORIUS AG-VORZUG	1,607	217.800	350,004.600		

TALANX AG	3,951	80.200	316,870.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,387	34.620	324,977.940	
DELIVERY HERO SE	11,722	38.740	454,110.280	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,594	56.550	146,690.700	
BECHTLE AG	5,223	31.100	162,435.300	
NEMETSCHEK SE	3,634	98.200	356,858.800	
SCOUT24 AG	4,599	85.050	391,144.950	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,757	51.320	911,289.240	
KNORR-BREMSE AG	4,442	72.150	320,490.300	
SIEMENS ENERGY AG	40,302	51.020	2,056,208.040	
BEIERSDORF AG	6,274	122.650	769,506.100	
MERCK KGAA	8,107	141.600	1,147,951.200	
ADIDAS AG	10,212	223.100	2,278,297.200	
PUMA SE	6,466	44.300	286,443.800	
HENKEL AG & CO KGAA	6,571	71.850	472,126.350	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	219,851	30.280	6,657,088.280	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	12,965	41.600	539,344.000	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,136	52.960	2,496,322.560	
QIAGEN N.V.	13,970	41.385	578,148.450	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	82,194	30.815	2,532,808.110	
HANNOVER RUECK SE	3,790	247.100	936,509.000	
DHL GROUP	64,185	34.770	2,231,712.450	
DEUTSCHE BOERSE AG	11,825	221.500	2,619,237.500	
MTU AERO ENGINES AG	3,393	322.200	1,093,224.600	
SYMRISE AG	8,328	104.500	870,276.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,505	64.500	226,072.500	
VONOVIA SE	46,599	31.400	1,463,208.600	
LEG IMMOBILIEN SE	4,566	87.740	400,620.840	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	50,277	25.790	1,296,643.830	
NN GROUP NV	17,062	43.970	750,216.140	
ARCELORMITTAL	29,514	23.840	703,613.760	
HEINEKEN NV	18,115	70.060	1,269,136.900	
AEGON LTD	85,054	6.102	518,999.500	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	58,511	32.650	1,910,384.150	
AKZO NOBEL N.V.	10,737	55.300	593,756.100	
WOLTERS KLUWER	14,999	157.950	2,369,092.050	
ING GROEP NV	207,983	14.658	3,048,614.810	
KONINKLIJKE KPN NV	241,485	3.671	886,491.430	
ASML HOLDING NV	25,150	658.400	16,558,760.000	

ABN AMRO BANK NV-CVA	28,945	14.715	425,925.670	
IMCD NV	3,592	142.100	510,423.200	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,713	113.000	532,569.000	
ASR NEDERLAND NV	10,012	45.300	453,543.600	
ADYEN NV	1,328	1,378.400	1,830,515.200	
PROSUS NV	85,918	38.550	3,312,138.900	
JDE PEET'S NV	7,685	18.870	145,015.950	
INPOST SA	14,300	16.580	237,094.000	
ASM INTERNATIONAL NV	2,974	511.400	1,520,903.600	
RANDSTAD NV	6,852	41.610	285,111.720	
HEINEKEN HOLDING NV	8,128	60.000	487,680.000	
TOTALENERGIES SE	135,905	54.970	7,470,697.850	
MICHELIN (CGDE)	42,054	30.750	1,293,160.500	
AIR LIQUIDE SA	36,365	157.280	5,719,487.200	
KERING	4,655	220.750	1,027,591.250	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,449	243.500	8,388,331.500	
BOUYGUES SA	11,619	28.160	327,191.040	
BNP PARIBAS	64,063	56.640	3,628,528.320	
THALES SA	5,789	141.500	819,143.500	
DANONE	40,692	64.660	2,631,144.720	
CARREFOUR SA	34,145	14.400	491,688.000	
VIVENDI	44,106	8.690	383,281.140	
L'OREAL	15,118	328.650	4,968,530.700	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	28,554	86.340	2,465,352.360	
LEGRAND SA	16,540	94.880	1,569,315.200	
PERNOD RICARD SA	12,803	105.900	1,355,837.700	
EURAZEO SE	2,599	69.550	180,760.450	
REXEL SA	14,143	24.440	345,654.920	
SOCIETE GENERALE SA	45,311	25.095	1,137,079.540	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,330	592.500	10,268,025.000	
ACCOR SA	12,225	43.680	533,988.000	
CAPGEMINI SE	9,805	151.900	1,489,379.500	
PUBLICIS GROUPE	14,406	102.700	1,479,496.200	
BUREAU VERITAS SA	20,039	28.800	577,123.200	
EIFFAGE	4,669	85.400	398,732.600	
SODEXO SA	5,616	78.600	441,417.600	
IPSEN	2,311	109.400	252,823.400	
AMUNDI SA	3,852	61.650	237,475.800	
TELEPERFORMANCE	3,431	89.020	305,427.620	

EURONEXT NV	4,921	105.700	520,149.700	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,265	46.790	386,719.350	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,790	180.350	322,826.500	
SEB SA	1,488	89.800	133,622.400	
ESSILORLUXOTTICA	18,689	229.800	4,294,732.200	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	188.400	242,847.600	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	6,098	37.400	228,065.200	
AXA SA	110,566	32.980	3,646,466.680	
EDENRED	15,273	31.300	478,044.900	
RENAULT SA	12,080	40.530	489,602.400	
HERMES INTERNATIONAL	2,041	2,065.000	4,214,665.000	
STMICROELECTRONICS NV	43,022	24.270	1,044,143.940	
DASSAULT SYSTEMES SE	42,143	32.650	1,375,968.950	
ORANGE	117,209	10.085	1,182,052.760	
ALSTOM	21,803	21.290	464,185.870	
SANOFI	71,927	92.090	6,623,757.430	
VINCI SA	31,507	99.860	3,146,289.020	
AIRBUS SE	37,456	147.560	5,527,007.360	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,401	27.570	1,224,135.570	
CREDIT AGRICOLE SA	67,084	12.670	849,954.280	
BIOMERIEUX	2,542	98.850	251,276.700	
ENGIE	115,034	15.085	1,735,287.890	
SAFRAN SA	23,010	220.500	5,073,705.000	
ARKEMA	3,434	75.000	257,550.000	
ADP	2,122	109.500	232,359.000	
GETLINK SE	19,144	15.465	296,061.960	
BOLLORE	43,698	5.835	254,977.830	
UCB SA	7,939	185.350	1,471,493.650	
KBC GROUP NV	14,445	68.240	985,726.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,201	65.450	340,405.450	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,575	50.940	2,881,930.500	
AGEAS	10,078	47.760	481,325.280	
D' IETEREN GROUP	1,322	201.800	266,779.600	
ELIA GROUP SA/NV	1,802	88.650	159,747.300	
SOFINA	931	219.600	204,447.600	
ARGENX SE	3,739	586.400	2,192,549.600	
PRYSMIAN SPA	17,730	62.420	1,106,706.600	
GENERALI	58,894	27.080	1,594,849.520	
MEDIOBANCA SPA	31,488	13.805	434,691.840	



TENARIS SA	25,343	18.160	460,228.880	
UNICREDIT SPA	92,732	36.385	3,374,053.820	
UNIPOL GRUPPO SPA	26,800	11.420	306,056.000	
TELECOM ITALIA SPA	612,014	0.227	139,110.780	
INTESA SANPAOLO	921,048	3.627	3,340,641.090	
POSTE ITALIANE SPA	28,013	13.285	372,152.700	
MONCLER SPA	14,751	46.350	683,708.850	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,409	51.550	330,383.950	
ENI SPA	144,794	13.406	1,941,108.360	
BPER BANCA	67,500	5.778	390,015.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	5.678	220,419.960	
BANCO BPM SPA	81,084	7.204	584,129.130	
DIASORIN SPA	1,344	105.800	142,195.200	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	20,601	9.750	200,859.750	
NEXI SPA	32,152	5.604	180,179.800	
AMPLIFON SPA	7,824	24.030	188,010.720	
LEONARDO SPA	25,455	25.470	648,338.850	
ENEL SPA	512,156	6.810	3,487,782.360	
SNAM SPA	126,955	4.412	560,125.460	
TERNA SPA	88,571	8.008	709,276.560	
FINECOBANK SPA	38,474	15.190	584,420.060	
STELLANTIS NV	122,988	12.536	1,541,777.560	
FERRARI NV	7,916	411.700	3,259,017.200	
TELEFONICA SA	249,904	4.286	1,071,088.540	
ENDESA SA	19,465	20.740	403,704.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	362,894	8.936	3,242,820.780	
IBERDROLA SA	380,468	13.490	5,132,513.320	
BANCO DE SABADELL SA	342,595	1.785	611,703.370	
REPSOL SA	74,479	11.825	880,714.170	
GRIFOLS SA	18,913	8.616	162,954.400	
BANCO SANTANDER SA	975,665	4.375	4,269,022.200	
AMADEUS IT GROUP SA	28,359	66.420	1,883,604.780	
CAIXABANK SA	253,450	5.146	1,304,253.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,247	43.960	494,418.120	
AENA SME SA	4,688	204.800	960,102.400	
CELLNEX TELECOM SA	33,399	33.980	1,134,898.020	
ACCIONA SA	1,472	120.300	177,081.600	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	68,731	52.180	3,586,383.580	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	24,877	16.900	420,421.300	

	UPM-KYMMENE OYJ	33,648	24.900	837,835.200	
	NOKIA OYJ	335,838	3.979	1,336,467.320	
	WARTSILA OYJ ABP	31,673	17.205	544,933.960	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	35,682	9.192	327,988.940	
	ELISA OYJ	8,714	42.880	373,656.320	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,415	40.540	1,273,564.100	
	FORTUM OYJ	27,499	14.265	392,273.230	
	KESKO OYJ-B SHS	17,250	18.815	324,558.750	
	KONE OYJ-B	21,393	49.060	1,049,540.580	
	NESTE OYJ	25,885	14.405	372,873.420	
	ORION OYJ-CLASS B	6,816	44.720	304,811.520	
	METSO CORPORATION	38,123	8.326	317,412.090	
	NORDEA BANK ABP	198,712	10.705	2,127,211.960	
	VERBUND AG	4,249	75.500	320,799.500	
	OMV AG	9,024	37.920	342,190.080	
	ERSTE GROUP BANK AG	21,198	51.900	1,100,176.200	
	AIB GROUP PLC	117,515	5.150	605,202.250	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	62,250	8.288	515,928.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,753	71.200	694,413.600	
	JERONIMO MARTINS	17,354	18.440	320,007.760	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	197,570	3.422	676,084.540	
	GALP ENERGIA SGPS SA	29,235	15.535	454,165.720	
	EDP RENOVAVEIS SA	18,553	11.080	205,567.240	
	KERRY GROUP PLC-A	9,656	91.450	883,041.200	
	ユーロ 小計			316,186,144.150 (50,039,619,173)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	94,000	51.000	4,794,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	34.550	5,147,950.000	
	MTR CORP	106,000	27.250	2,888,500.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	98,500	77.250	7,609,125.000	
	SINO LAND CO	264,000	7.620	2,011,680.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	182,169	40.500	7,377,844.500	
	WHARF HOLDINGS LTD	73,000	21.350	1,558,550.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	28,000	64.050	1,793,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	111,500	65.300	7,280,950.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	98,507	24.400	2,403,570.800	
	HONG KONG & CHINA GAS	759,475	5.900	4,480,902.500	
	HANG SENG BANK LTD	51,100	92.450	4,724,195.000	
	WH GROUP LTD	565,500	6.170	3,489,135.000	

HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	81,700	289.800	23,676,660.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	130,669	31.800	4,155,274.200	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	43,000	53.600	2,304,800.000	
AIA GROUP LTD	741,400	58.150	43,112,410.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	92,000	20.250	1,863,000.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	20.850	2,376,900.000	
SANDS CHINA LTD	164,800	19.840	3,269,632.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	93,500	109.600	10,247,600.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	251,000	23.900	5,998,900.000	
香港・ドル 小計			152,564,979.000 (2,944,504,095)	
合計			640,051,843,230 [640,051,843,230]	

## (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	9,237	2,173,927.950	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	21,007	3,856,885.200	
		BXP INC	9,700	795,303.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,000	1,583,750.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,000	1,686,520.000	
		EQUINIX INC	6,108	5,994,879.840	
		AMERICAN TOWER CORP	30,100	6,290,900.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	45,243	833,376.060	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	21,200	811,748.000	
		KIMCO REALTY CORP	43,400	1,109,738.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,700	913,497.000	
		INVITATION HOMES INC	37,400	1,280,950.000	
		VICI PROPERTIES INC	67,400	2,197,914.000	
		VENTAS INC	26,800	1,717,076.000	
		WEYERHAEUSER CO	46,814	1,510,219.640	
		CROWN CASTLE INTL CORP	28,000	2,975,000.000	
		IRON MOUNTAIN INC	18,900	2,337,363.000	
		SUN COMMUNITIES INC	8,100	1,023,273.000	
		PROLOGIS INC	59,654	6,966,394.120	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,200	1,124,346.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,900	868,020.000			
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,200	1,303,932.000			

	WELLTOWER INC	39,900	5,513,382.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,000	989,550.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,600	1,247,616.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,500	820,295.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	34,800	693,564.000	
	REALTY INCOME CORP	56,095	3,247,339.550	
	PUBLIC STORAGE	10,200	3,550,110.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,000	831,490.000	
	UDR INC	20,200	926,372.000	
	WP CAREY INC	14,100	804,546.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,100	4,129,059.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,700	2,342,152.000	
アメリカ・ドル 小計			74,450,488.360 (11,183,952,361)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	43,890	264,656.700	
	SEGRO PLC	79,485	619,983.000	
イギリス・ポンド 小計			884,639.700 (168,700,791)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	187,089	2,394,739.200	
	APA GROUP	78,315	565,434.300	
	SCENTRE GROUP	313,440	1,153,459.200	
	GPT GROUP	112,602	535,985.520	
	MIRVAC GROUP	238,518	515,198.880	
	STOCKLAND	144,307	753,282.540	
	GOODMAN GROUP	103,698	3,931,191.180	
	VICINITY CENTRES	227,463	491,320.080	
オーストラリア・ドル 小計			10,340,610.900 (1,008,933,406)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,800	220,080.000	
カナダ・ドル 小計			220,080.000 (23,559,564)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	253,500	664,170.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	395,270	774,729.200	

シンガポール・ドル 小計			1,438,899.200 (160,998,431)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,457	578,364.920	
	GECINA SA	2,908	277,277.800	
	KLEPIERRE	13,182	377,268.840	
	COVIVIO	3,349	174,148.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,363	237,713.960	
ユーロ 小計			1,644,773.520 (260,301,857)	
香港・ドル	LINK REIT	174,700	5,913,595.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	257,000	2,485,190.000	
香港・ドル 小計			8,398,785.000 (162,096,551)	
投資証券 合計			12,968,542,961 [12,968,542,961]	
合計			12,968,542,961 [12,968,542,961]	

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 570銘柄	97.8%	2.2%	79.0%
	投資証券 34銘柄			
イギリス・ポンド	株式 76銘柄	99.3%	0.7%	3.5%
	投資証券 2銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 46銘柄	91.3%	8.7%	1.8%
	投資証券 8銘柄			
カナダ・ドル	株式 83銘柄	99.9%	0.1%	3.0%
	投資証券 1銘柄			
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄	92.8%	7.2%	0.3%
	株式 13銘柄			
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.2%

スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	100%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式	16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	11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	215銘柄	99.5%	0.5%	7.7%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	投資証券	2銘柄	94.8%	5.2%	0.5%
	株式	22銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン 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8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,314,176	4,002,384
親投資信託受益証券	2,849,519,501	2,247,024,190
未収入金	-	247,486
流動資産合計	2,856,833,677	2,251,274,060
資産合計	2,856,833,677	2,251,274,060
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,810,712	228,433
未払受託者報酬	157,897	170,395
未払委託者報酬	1,421,451	1,555,840
その他未払費用	78,868	63,225
流動負債合計	4,468,928	2,017,893
負債合計	4,468,928	2,017,893
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,975,883,421	<sup>1</sup> 2,412,276,867
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sup>2</sup> 123,518,672	<sup>2</sup> 163,020,700
(分配準備積立金)	13,300,987	8,754,509
元本等合計	2,852,364,749	2,249,256,167
純資産合計	2,852,364,749	2,249,256,167
負債純資産合計	2,856,833,677	2,251,274,060



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		4,641
有価証券売買等損益		34,357,298		62,320,030
<b>営業収益合計</b>		<b>34,357,297</b>		<b>62,315,389</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,784		123
受託者報酬		314,422		318,511
委託者報酬		2,830,625		2,889,272
その他費用		157,058		137,231
<b>営業費用合計</b>		<b>3,303,889</b>		<b>3,345,137</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>37,661,186</b>		<b>65,660,526</b>
経常利益又は経常損失（ ）		37,661,186		65,660,526
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>37,661,186</b>		<b>65,660,526</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,572,191		6,515,823
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>85,144,361</b>		<b>123,518,672</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,013,923		47,515,661
<b>当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>18,013,923</b>		<b>47,515,661</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,299,239		27,872,986
<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>20,299,239</b>		<b>27,872,986</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>123,518,672</b>		<b>163,020,700</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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	2,959,305,050円	2,975,883,421円
期中追加設定元本額	641,695,463円	578,159,953円
期中一部解約元本額	625,117,092円	1,141,766,507円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,975,883,421口	2,412,276,867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123,518,672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163,020,700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7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(40,352,437円)及び分配準備積立金(13,300,987円)より分配対象額は53,653,424円(1万口当たり180.29円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(34,737,232円)及び分配準備積立金(8,754,509円)より分配対象額は43,491,741円(1万口当たり180.29円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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	33,531,492	57,693,253
合計	33,531,492	57,693,253

## (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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9585円 (9,585円)	0.9324円 (9,324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	1,716,727,168	2,247,024,190	
親投資信託受益証券 合計			2,247,024,190	
合計			2,247,024,190	

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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	309,769,003	230,120,675

国債証券	93,894,775,530	109,744,947,020
地方債証券	6,120,781,600	6,513,334,100
特殊債券	2,795,288,600	3,916,027,200
社債券	8,088,307,100	8,798,639,100
未収入金	-	3,093,325,460
未収利息	221,388,521	283,026,681
前払費用	9,434,239	17,230,518
流動資産合計	111,439,744,593	132,596,650,754
資産合計	111,439,744,593	132,596,650,754
負債の部		
流動負債		
未払金	96,080,000	3,254,049,550
未払解約金	13,606,818	57,671,306
流動負債合計	109,686,818	3,311,720,856
負債合計	109,686,818	3,311,720,856
純資産の部		
元本等		
元本	1 82,851,732,167	98,770,541,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,478,325,608	30,514,387,947
元本等合計	111,330,057,775	129,284,929,898
純資産合計	111,330,057,775	129,284,929,898
負債純資産合計	111,439,744,593	132,596,650,754

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	83,142,525,531円	82,851,732,167円
期中追加設定元本額	20,248,665,071円	31,448,033,676円
期中一部解約元本額	20,539,458,435円	15,529,223,892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)	45,308,502円	32,289,249円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	236,159,177円	201,615,694円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	37,299,453円	37,897,876円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	523,999,150円	468,187,324円
DCダイワ日本債券インデック ス	10,596,563,344円	10,539,428,229円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	9,631,665,187円	21,258,385,545円
ダイワ・バランスファンド35 VA	8,365,243,656円	7,858,051,431円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	1,477,234,743円	1,399,115,999円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	197,493,843円	177,725,433円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	212,842,015円	194,573,887円

ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	65,102,953円	45,562,825円
ダイワファンドラップ 日本債券 インデックス	27,224,231,107円	29,905,466,527円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	13,853,994,971円	16,966,813,386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	2,120,651,560円	1,716,727,168円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	5,455,841円
スタイル9(4資産分散・バラ ンス型)	-円	10,801,798円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	1,135,449円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	-円	2,608,902円
スタイル9(6資産分散・バラ ンス型)	-円	22,010,458円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	-円	1,749,661円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	-円	3,959,704円
スタイル9(8資産分散・バラ ンス型)	-円	17,084,008円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	-円	3,408,991円
ダイワ国内債券インデックス (投資一任専用)	-円	7,573,847円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	819,920,641円	691,503,280円
ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	6,233,967,736円	5,910,886,543円
ダイワライフスタイル2 5	445,077,928円	451,762,455円
ダイワライフスタイル5 0	599,475,391円	647,337,746円
ダイワライフスタイル7 5	165,500,810円	191,422,695円
計	82,851,732,167円	98,770,541,951円
2. 期末日における受益権の総数	82,851,732,167口	98,770,541,951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2023年12月1日 至2024年12月2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。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	1,845,271,090	3,457,056,460
地方債証券	52,707,100	138,447,100
特殊債券	37,764,000	95,478,000
社債券	85,938,200	86,820,300

合計	2,021,680,390	3,777,801,860
----	---------------	---------------

(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

2023年11月30日現在	2024年12月2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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.3437円	1.3089円
(1万口当たり純資産額)	(13,437円)	(13,089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
国債証券	456 2年国債	600,000,000	597,390,000	
	457 2年国債	160,000,000	159,220,800	
	458 2年国債	680,000,000	677,184,800	
	459 2年国債	550,000,000	547,464,500	
	460 2年国債	300,000,000	298,887,000	
	461 2年国債	700,000,000	698,180,000	
	462 2年国債	250,000,000	249,277,500	
	463 2年国債	150,000,000	149,518,500	
	464 2年国債	420,000,000	418,546,800	
	465 2年国債	250,000,000	249,072,500	
	466 2年国債	900,000,000	898,128,000	
	147 5年国債	1,430,000,000	1,420,161,600	
	148 5年国債	800,000,000	792,952,000	
	149 5年国債	1,480,000,000	1,464,341,600	
	150 5年国債	1,600,000,000	1,580,752,000	
	151 5年国債	850,000,000	838,457,000	
152 5年国債	600,000,000	593,142,000		

153 5年国債	600,000,000	590,826,000	
154 5年国債	1,050,000,000	1,034,838,000	
155 5年国債	730,000,000	722,685,400	
156 5年国債	770,000,000	759,982,300	
157 5年国債	200,000,000	197,098,000	
158 5年国債	950,000,000	933,147,000	
161 5年国債	880,000,000	868,868,000	
162 5年国債	200,000,000	197,186,000	
163 5年国債	1,000,000,000	989,630,000	
164 5年国債	270,000,000	264,737,700	
165 5年国債	450,000,000	443,002,500	
166 5年国債	980,000,000	968,612,400	
167 5年国債	150,000,000	148,062,000	
168 5年国債	400,000,000	398,164,000	
170 5年国債	600,000,000	596,568,000	
172 5年国債	550,000,000	544,434,000	
173 5年国債	360,000,000	357,580,800	
1 40年国債	100,000,000	106,865,000	
2 40年国債	110,000,000	112,950,200	
3 40年国債	195,000,000	198,549,000	
4 40年国債	180,000,000	181,663,200	
5 40年国債	185,000,000	177,779,450	
6 40年国債	285,000,000	265,916,400	
7 40年国債	290,000,000	256,403,500	
8 40年国債	230,000,000	186,707,100	
9 40年国債	220,000,000	127,881,600	
10 40年国債	230,000,000	157,087,700	
11 40年国債	320,000,000	207,929,600	
12 40年国債	380,000,000	215,771,600	
13 40年国債	360,000,000	199,389,600	
14 40年国債	430,000,000	252,453,000	
15 40年国債	410,000,000	264,737,000	
16 40年国債	900,000,000	635,265,000	
17 40年国債	1,000,000,000	916,020,000	
2 CT5年国債	900,000,000	890,694,000	
2 CT10年国債	800,000,000	797,624,000	
342 10年国債	710,000,000	705,981,400	
343 10年国債	780,000,000	774,259,200	
344 10年国債	780,000,000	773,058,000	

345 10年国債	950,000,000	940,395,500	
346 10年国債	780,000,000	771,084,600	
347 10年国債	1,100,000,000	1,085,799,000	
348 10年国債	1,050,000,000	1,034,838,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,230,012,500	
350 10年国債	800,000,000	785,808,000	
351 10年国債	600,000,000	588,258,000	
352 10年国債	20,000,000	19,570,600	
353 10年国債	750,000,000	732,435,000	
354 10年国債	1,100,000,000	1,071,818,000	
355 10年国債	620,000,000	602,683,400	
356 10年国債	700,000,000	679,084,000	
357 10年国債	860,000,000	832,815,400	
358 10年国債	600,000,000	579,996,000	
359 10年国債	840,000,000	810,499,200	
360 10年国債	1,200,000,000	1,155,696,000	
361 10年国債	800,000,000	769,248,000	
362 10年国債	1,000,000,000	959,780,000	
363 10年国債	1,080,000,000	1,033,938,000	
364 10年国債	1,100,000,000	1,050,357,000	
365 10年国債	1,400,000,000	1,333,290,000	
366 10年国債	850,000,000	812,889,000	
367 10年国債	980,000,000	934,165,400	
368 10年国債	1,200,000,000	1,140,456,000	
369 10年国債	1,140,000,000	1,106,609,400	
370 10年国債	1,500,000,000	1,452,015,000	
371 10年国債	960,000,000	918,624,000	
372 10年国債	900,000,000	888,678,000	
373 10年国債	1,200,000,000	1,161,132,000	
374 10年国債	1,150,000,000	1,129,001,000	
375 10年国債	800,000,000	804,512,000	
376 10年国債	270,000,000	265,809,600	
1 30年国債	16,000,000	17,547,200	
2 30年国債	184,000,000	199,590,320	
3 30年国債	30,000,000	32,490,000	
4 30年国債	36,000,000	40,499,640	
5 30年国債	28,000,000	30,529,800	
6 30年国債	24,000,000	26,612,160	
7 30年国債	55,000,000	60,829,450	

8 30年国債	27,000,000	28,925,100	
9 30年国債	43,000,000	44,730,320	
10 30年国債	45,000,000	45,711,900	
11 30年国債	40,000,000	42,538,800	
12 30年国債	60,000,000	65,815,200	
13 30年国債	75,000,000	81,627,750	
14 30年国債	82,000,000	92,113,060	
15 30年国債	50,000,000	56,633,500	
16 30年国債	250,000,000	283,207,500	
17 30年国債	130,000,000	146,081,000	
18 30年国債	80,000,000	89,164,800	
19 30年国債	500,000,000	557,220,000	
21 30年国債	60,000,000	66,894,000	
22 30年国債	170,000,000	193,035,000	
24 30年国債	92,000,000	104,466,920	
25 30年国債	150,000,000	166,926,000	
26 30年国債	300,000,000	337,119,000	
27 30年国債	150,000,000	170,215,500	
28 30年国債	350,000,000	396,704,000	
29 30年国債	200,000,000	223,902,000	
30 30年国債	220,000,000	242,858,000	
31 30年国債	300,000,000	326,616,000	
32 30年国債	385,000,000	423,049,550	
33 30年国債	280,000,000	295,237,600	
34 30年国債	270,000,000	291,311,100	
35 30年国債	250,000,000	261,680,000	
36 30年国債	350,000,000	365,008,000	
37 30年国債	450,000,000	461,034,000	
38 30年国債	260,000,000	261,437,800	
39 30年国債	270,000,000	275,092,200	
40 30年国債	240,000,000	240,000,000	
41 30年国債	250,000,000	245,582,500	
42 30年国債	320,000,000	313,395,200	
43 30年国債	300,000,000	293,118,000	
44 30年国債	300,000,000	291,996,000	
45 30年国債	300,000,000	281,352,000	
46 30年国債	300,000,000	280,575,000	
47 30年国債	350,000,000	332,272,500	
48 30年国債	400,000,000	365,016,000	

49	30年国債	220,000,000	200,151,600	
50	30年国債	350,000,000	280,777,000	
51	30年国債	370,000,000	263,010,800	
52	30年国債	400,000,000	296,756,000	
53	30年国債	350,000,000	264,505,500	
54	30年国債	400,000,000	315,060,000	
55	30年国債	300,000,000	235,107,000	
56	30年国債	340,000,000	265,312,200	
57	30年国債	350,000,000	271,943,000	
58	30年国債	510,000,000	394,265,700	
59	30年国債	300,000,000	225,309,000	
60	30年国債	300,000,000	235,587,000	
61	30年国債	300,000,000	223,260,000	
62	30年国債	400,000,000	281,212,000	
63	30年国債	300,000,000	204,012,000	
64	30年国債	330,000,000	223,063,500	
65	30年国債	310,000,000	208,127,800	
66	30年国債	270,000,000	180,049,500	
67	30年国債	350,000,000	245,563,500	
68	30年国債	340,000,000	237,197,600	
69	30年国債	410,000,000	292,658,000	
70	30年国債	420,000,000	297,931,200	
71	30年国債	390,000,000	275,133,300	
72	30年国債	350,000,000	245,749,000	
73	30年国債	360,000,000	251,578,800	
74	30年国債	380,000,000	287,523,200	
75	30年国債	340,000,000	277,290,400	
76	30年国債	430,000,000	358,598,500	
77	30年国債	325,000,000	283,793,250	
78	30年国債	310,000,000	256,893,900	
79	30年国債	350,000,000	274,662,500	
80	30年国債	330,000,000	299,857,800	
81	30年国債	375,000,000	324,206,250	
82	30年国債	330,000,000	298,768,800	
83	30年国債	350,000,000	346,279,500	
84	30年国債	130,000,000	125,736,000	
85	20年国債	58,000,000	59,165,220	
86	20年国債	80,000,000	81,812,800	
87	20年国債	55,000,000	56,175,900	

89 20年国債	53,000,000	54,318,640	
90 20年国債	20,000,000	20,572,600	
91 20年国債	100,000,000	103,041,000	
92 20年国債	310,000,000	319,464,300	
93 20年国債	100,000,000	103,178,000	
94 20年国債	130,000,000	134,425,200	
95 20年国債	50,000,000	52,130,500	
96 20年国債	55,000,000	57,068,000	
97 20年国債	40,000,000	41,749,200	
98 20年国債	320,000,000	333,110,400	
99 20年国債	100,000,000	104,425,000	
100 20年国債	155,000,000	162,850,750	
101 20年国債	350,000,000	369,985,000	
108 20年国債	300,000,000	314,475,000	
109 20年国債	55,000,000	57,762,650	
110 20年国債	260,000,000	275,285,400	
111 20年国債	400,000,000	426,240,000	
112 20年国債	250,000,000	265,300,000	
113 20年国債	310,000,000	329,759,400	
114 20年国債	70,000,000	74,704,000	
115 20年国債	180,000,000	193,019,400	
116 20年国債	200,000,000	215,092,000	
117 20年国債	200,000,000	214,072,000	
118 20年国債	95,000,000	101,456,200	
119 20年国債	93,000,000	98,302,860	
120 20年国債	317,000,000	331,696,120	
121 20年国債	200,000,000	212,954,000	
122 20年国債	200,000,000	211,842,000	
123 20年国債	200,000,000	215,928,000	
124 20年国債	300,000,000	322,155,000	
125 20年国債	130,000,000	141,540,100	
126 20年国債	110,000,000	118,405,100	
127 20年国債	350,000,000	374,636,500	
128 20年国債	250,000,000	268,020,000	
129 20年国債	200,000,000	213,168,000	
130 20年国債	140,000,000	149,409,400	
131 20年国債	150,000,000	159,112,500	
132 20年国債	100,000,000	106,180,000	
133 20年国債	100,000,000	106,848,000	

134 20年国債	30,000,000	32,078,100	
135 20年国債	92,000,000	97,738,960	
136 20年国債	550,000,000	580,316,000	
138 20年国債	300,000,000	314,382,000	
139 20年国債	370,000,000	390,505,400	
140 20年国債	570,000,000	606,092,400	
141 20年国債	400,000,000	425,444,000	
142 20年国債	240,000,000	257,169,600	
143 20年国債	210,000,000	221,684,400	
144 20年国債	140,000,000	146,708,800	
145 20年国債	340,000,000	361,579,800	
146 20年国債	20,000,000	21,260,800	
147 20年国債	600,000,000	632,484,000	
148 20年国債	400,000,000	417,536,000	
149 20年国債	432,000,000	450,230,400	
150 20年国債	400,000,000	412,252,000	
151 20年国債	400,000,000	403,984,000	
152 20年国債	600,000,000	604,704,000	
153 20年国債	280,000,000	284,348,400	
154 20年国債	580,000,000	581,943,000	
155 20年国債	530,000,000	519,659,700	
156 20年国債	480,000,000	438,969,600	
157 20年国債	710,000,000	630,962,800	
158 20年国債	580,000,000	531,720,800	
159 20年国債	400,000,000	369,488,000	
160 20年国債	450,000,000	419,157,000	
161 20年国債	570,000,000	522,171,300	
162 20年国債	620,000,000	565,551,600	
163 20年国債	500,000,000	453,870,000	
164 20年国債	570,000,000	508,229,100	
165 20年国債	470,000,000	416,852,400	
166 20年国債	680,000,000	617,106,800	
167 20年国債	500,000,000	438,930,000	
168 20年国債	610,000,000	524,844,000	
169 20年国債	540,000,000	455,020,200	
170 20年国債	520,000,000	435,728,800	
171 20年国債	450,000,000	374,737,500	
172 20年国債	170,000,000	143,089,000	
173 20年国債	550,000,000	460,383,000	



174	20年国債	800,000,000	665,928,000	
175	20年国債	520,000,000	437,741,200	
176	20年国債	610,000,000	510,734,700	
177	20年国債	530,000,000	433,746,700	
178	20年国債	660,000,000	546,513,000	
179	20年国債	550,000,000	453,183,500	
180	20年国債	580,000,000	501,195,400	
181	20年国債	500,000,000	437,660,000	
182	20年国債	530,000,000	478,378,000	
183	20年国債	490,000,000	463,299,900	
184	20年国債	550,000,000	492,943,000	
185	20年国債	550,000,000	491,007,000	
186	20年国債	530,000,000	504,830,300	
187	20年国債	400,000,000	367,204,000	
188	20年国債	350,000,000	337,078,000	
189	20年国債	480,000,000	484,488,000	
190	20年国債	600,000,000	593,928,000	
27	メキシコ国債	100,000,000	97,793,700	
11	フィリピン共和国	100,000,000	98,470,500	
国債証券 合計			109,744,947,020	
地方債証券	796 東京都公債	100,000,000	96,331,000	
	808 東京都公債	100,000,000	95,803,700	
	827 東京都公債	100,000,000	95,643,100	
	16 東京都20年	100,000,000	104,877,500	
	3-5 北海道公債	100,000,000	95,281,900	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	94,953,200	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,045,800	
	262 神奈川県公債	100,000,000	99,733,900	
	27 神奈川県20年	100,000,000	102,049,400	
	31 神奈川県20年	100,000,000	96,952,200	
	420 大阪府公債	200,000,000	197,285,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	212,606,600	
	26-2 京都府15年	100,000,000	101,101,100	
	2-1 京都府公債	200,000,000	192,581,600	
	19兵庫県公債20年	100,000,000	104,299,700	
	2-1 静岡県公債	100,000,000	96,289,800	
	8 静岡県20年	200,000,000	213,033,000	
21-5 愛知県公債	100,000,000	106,499,300		

26-4 愛知県20年	100,000,000	103,666,200	
27-12 愛知県15年	100,000,000	99,411,900	
29-5 広島県公債	100,000,000	98,443,900	
25-1 広島県20年	100,000,000	105,823,300	
2-7 埼玉県公債	100,000,000	95,795,600	
4 埼玉県30年	100,000,000	88,137,600	
9 埼玉県20年	100,000,000	106,945,200	
12 埼玉県20年	100,000,000	105,739,100	
29-1 福岡県公債	100,000,000	98,679,900	
5-1 福岡県公債	100,000,000	97,206,800	
13 千葉県20年	100,000,000	105,570,100	
16 千葉県20年	100,000,000	103,849,600	
28-2 新潟県公債	100,000,000	98,874,300	
153 共同発行地方	200,000,000	199,720,800	
168 共同発行地方	100,000,000	98,848,100	
170 共同発行地方	200,000,000	197,348,000	
195 共同発行地方	100,000,000	96,453,900	
196 共同発行地方	100,000,000	96,522,400	
206 共同発行地方	100,000,000	96,178,800	
244 共同発行地方	200,000,000	192,602,400	
255 共同発行地方	100,000,000	99,423,000	
4-3 長崎県公債	100,000,000	95,840,500	
6-1 大阪市5年	100,000,000	98,956,500	
6-2 大阪市公債	100,000,000	98,758,200	
11 名古屋市20年	200,000,000	212,776,600	
10 京都市20年	100,000,000	106,110,100	
20-1 神戸市20年	100,000,000	105,541,500	
14 横浜市20年	100,000,000	105,088,000	
19 横浜市20年	100,000,000	106,366,200	
26-5 札幌市15年	100,000,000	100,609,300	
2-4 札幌市公債	100,000,000	95,816,600	
4 川崎市公債30年	100,000,000	104,544,000	
1 北九州市15年	100,000,000	100,507,300	
17 北九州市20年	100,000,000	103,465,300	
23-4 福岡市20年	100,000,000	106,570,100	
1-5 千葉市公債	100,000,000	96,116,200	
3-2 徳島県公債	100,000,000	94,822,200	
1-1 山梨県公債	100,000,000	96,256,800	
2-2 岡山県公債	100,000,000	95,579,400	

地方債証券 合計			6,513,334,100	
特殊債券	47日本政策投資C0	100,000,000	100,588,900	
	174 日本政策投資	300,000,000	288,514,200	
	69 政保政策投資C	100,000,000	95,467,700	
	247 道路機構	200,000,000	162,019,600	
	86 政保道路機構	100,000,000	105,438,600	
	97 政保道路機構	100,000,000	106,383,200	
	160 政保道路機構	200,000,000	212,479,000	
	223 政保道路機構	100,000,000	102,596,500	
	235 政保道路機構	100,000,000	100,377,000	
	284 政保道路機構	200,000,000	174,273,600	
	298 政保道路機構	100,000,000	90,795,900	
	321 政保道路機構	200,000,000	196,952,600	
	403 政保道路機構	100,000,000	95,702,600	
	478 政保道路機構	100,000,000	99,618,200	
	F124地方公共団体	100,000,000	101,552,000	
	F143地方公共団体	100,000,000	101,484,900	
	1 地方公共団15年	100,000,000	101,612,600	
	31 地方公共団20	100,000,000	105,084,900	
	F192地方公共団体	100,000,000	101,194,500	
	F221地方公共団体	200,000,000	202,942,200	
	F226地方公共団体	100,000,000	100,907,800	
	97政保地方公共団	100,000,000	98,562,500	
	129 地方公共団体	200,000,000	191,647,400	
	F568地方公共団体	200,000,000	179,919,600	
	4 国際協力銀行C0	100,000,000	98,982,500	
	127 都市再生	100,000,000	98,778,100	
80 住宅支援機構	100,000,000	101,476,200		
123 住宅支援機構	100,000,000	105,698,300		
33 沖縄振興開発	200,000,000	196,218,400		
19 利付商工債	100,000,000	98,757,700		
特殊債券 合計			3,916,027,200	
社債券	4 香港上海銀行	100,000,000	99,398,700	
	33 首都高速道路	100,000,000	98,588,700	
	30 阪神高速道路	100,000,000	98,861,000	
	20 成田国際空港	100,000,000	98,853,700	
	111 東日本高速道	100,000,000	98,723,800	
	101 中日本高速道	400,000,000	393,908,000	
	88 西日本高速道	100,000,000	99,251,500	

32大和ハウス工業	300,000,000	297,316,200	
22 積水ハウス	100,000,000	97,964,600	
12 アサヒグループHD	100,000,000	98,661,800	
11サントリーホールディング	100,000,000	98,227,600	
11 ヒューリック	100,000,000	99,227,800	
23 森ビル	100,000,000	85,639,000	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	97,644,000	
35 東レ	300,000,000	296,916,000	
1 レゾナックHD	100,000,000	98,264,400	
4 アステラス製薬	300,000,000	294,897,000	
20 ZHD	100,000,000	96,767,600	
18 楽天グループ	100,000,000	83,261,500	
2 AGC	100,000,000	95,767,000	
7 日本製鉄	100,000,000	98,471,100	
32 住友電工	100,000,000	97,499,900	
16 クボタ	100,000,000	98,528,100	
62 日本電気	200,000,000	195,028,800	
17 パナソニック	100,000,000	99,185,900	
41 ソニーG	100,000,000	97,187,200	
15 デンソー	100,000,000	98,413,500	
31 トヨタ自動車	100,000,000	96,244,200	
6 楽天カード	100,000,000	97,125,000	
3 オリックス銀行	200,000,000	196,047,600	
1 日生2021基金	100,000,000	98,970,700	
7 凸版印刷	100,000,000	100,114,400	
31 豊田通商	200,000,000	195,549,600	
63 住友商事	100,000,000	95,556,000	
26 りそなホールデイン	100,000,000	98,164,800	
27 りそなホールデイン	200,000,000	196,714,600	
28 三井住友TB	300,000,000	294,892,200	
36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,116,400	
33 NTTファイナンス	100,000,000	99,981,600	
38 NTTファイナンス	200,000,000	198,307,800	
56 日産フィナンシャル	100,000,000	98,518,500	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	98,084,600	
78 トヨタファイナンス	100,000,000	98,399,000	
42 リコーリース	100,000,000	98,622,600	
22 イオンFS	200,000,000	197,147,000	
36 三井住友F&L	200,000,000	198,230,800	

1 SOMPOHD	100,000,000	98,507,100	
7 三井住友海上	100,000,000	98,735,400	
82 三井不動産	100,000,000	97,776,900	
143 三菱地所	100,000,000	96,885,500	
111 住友不動産	100,000,000	98,407,400	
13 NTTファイナンス	100,000,000	100,141,600	
107東日本旅客鉄	100,000,000	87,897,800	
41 東海旅客鉄道	100,000,000	104,965,800	
67 阪急阪神HLDG	100,000,000	95,512,400	
68 名古屋鉄道	200,000,000	195,609,400	
34 KDDI	100,000,000	99,606,400	
15 ソフトバンク	100,000,000	96,402,500	
509 関西電力	100,000,000	98,991,800	
538 関西電力	100,000,000	95,896,000	
448 中国電力	100,000,000	96,348,200	
560 東北電力	200,000,000	191,472,200	
332 北海道電力	100,000,000	91,202,900	
34 沖縄電力	100,000,000	98,122,600	
85 電源開発	100,000,000	99,340,100	
87 電源開発	100,000,000	97,212,000	
11 東京電力パワー	100,000,000	98,885,300	
16 JERA	100,000,000	98,617,300	
65 東京瓦斯	100,000,000	95,603,900	
50 大阪瓦斯	100,000,000	98,256,800	
社債券 合計		8,798,639,100	
合計		128,972,947,420	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,080,852	13,576,705
親投資信託受益証券	4,079,143,835	3,911,966,397
未収入金	-	3,747,113
流動資産合計	4,098,224,687	3,929,290,215
資産合計	4,098,224,687	3,929,290,215
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,672,481	4,340,960
未払受託者報酬	439,862	433,724
未払委託者報酬	4,838,937	4,771,368
その他未払費用	164,878	162,569
流動負債合計	11,116,158	9,708,621
負債合計	11,116,158	9,708,621
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 4,725,481,446	<sup>1</sup> 4,532,905,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 638,372,917	<sup>2</sup> 613,323,965
（分配準備積立金）	146,391,905	110,940,023
元本等合計	4,087,108,529	3,919,581,594
純資産合計	4,087,108,529	3,919,581,594
負債純資産合計	4,098,224,687	3,929,290,215

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自	2022年12月1日 至 2023年11月30日	自	2023年12月1日 至 2024年12月2日
<b>営業収益</b>				
受取利息		4		13,825
有価証券売買等損益		185,631,843		7,981,957
営業収益合計		185,631,839		7,995,782
<b>営業費用</b>				
支払利息		4,580		350
受託者報酬		856,164		880,307
委託者報酬		9,418,690		9,684,196
その他費用		320,924		329,958
営業費用合計		10,600,358		10,894,811
営業利益又は営業損失（ ）		196,232,197		2,899,029
経常利益又は経常損失（ ）		196,232,197		2,899,029
当期純利益又は当期純損失（ ）		196,232,197		2,899,029
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（ ）		16,242,350		1,720,727
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		376,614,307		638,372,917
剰余金増加額又は欠損金減少額		61,233,272		174,028,088
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		61,233,272		174,028,088
剰余金減少額又は欠損金増加額		143,002,035		147,800,834
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		143,002,035		147,800,834
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		638,372,917		613,323,965



## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	4,165,956,248円	4,725,481,446円
期中追加設定元本額	1,222,534,062円	1,099,909,120円
期中一部解約元本額	663,008,864円	1,292,485,007円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,725,481,446口	4,532,905,559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638,372,917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613,323,965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7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(304,888,501円)及び分配準備積立金(146,391,905円)より分配対象額は451,280,406円(1万口当たり954.99円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(321,952,424円)及び分配準備積立金(110,940,023円)より分配対象額は432,892,447円(1万口当たり955.00円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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	178,325,634	8,987,692
合計	178,325,634	8,987,692

## (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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8649円 (8,649円)	0.8647円 (8,647円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	4,621,342,466	3,911,966,397	
親投資信託受益証券 合計			3,911,966,397	
合計			3,911,966,397	

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

	2023年11月30日現在 金額 (円)	2024年12月2日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,283,809,493	1,646,945,582

コール・ローン		891,318,299	1,170,650,245
国債証券		124,881,940,329	122,350,460,496
派生商品評価勘定		1,478,454,208	152,516,700
未収入金		780,311	3,690,515,868
未収利息		879,415,540	918,237,985
前払費用		41,926,654	85,092,031
差入委託証拠金		229,923,855	235,718,382
流動資産合計		130,687,568,689	130,250,137,289
資産合計		130,687,568,689	130,250,137,289
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		808,867,978	14,127,817
未払金		549,951	3,946,490,227
未払解約金		62,456,656	6,871,583
流動負債合計		871,874,585	3,967,489,627
負債合計		871,874,585	3,967,489,627
純資産の部			
元本等			
元本	1	153,736,520,659	149,177,936,369
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	23,920,826,555	22,895,288,707
元本等合計		129,815,694,104	126,282,647,662
純資産合計		129,815,694,104	126,282,647,662
負債純資産合計		130,687,568,689	130,250,137,289

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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）、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>
<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		2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1.	1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
	期首元本額	136,999,425,944円	153,736,520,659円
	期中追加設定元本額	35,208,621,880円	39,121,045,221円

期中一部解約元本額	18,471,527,165円	43,679,629,511円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01 (適格機関投資家専用)	2,303,831,989円	2,390,526,713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)	116,370,084,077円	118,132,533,306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)	4,830,819,322円	4,621,342,466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)	13,366,736円	21,899,518円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	3,577,386,838円	3,762,005,236円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(投資一任 専用)	-円	11,715,977円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワS MA専用)	24,339,703,266円	13,269,419,534円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	2,301,328,431円	2,382,687,630円
ダイワバランスファンド2024-01 (適格機関投資家専用)	-円	2,308,639,040円
ダイワバランスファンド2024-05 (適格機関投資家専用)	-円	2,277,166,949円
計	153,736,520,659円	149,177,936,369円
2. 期末日における受益権の総数	153,736,520,659口	149,177,936,369口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は23,920,826,555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22,895,288,707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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2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</p>



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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	699,642,971	1,635,720,203
合計	699,642,971	1,635,720,203

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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								
債券先物取引								
買建	1,966,151,747	-	1,985,818,184	19,666,437	2,030,555,940	-	2,038,908,114	8,352,174
合計	1,966,151,747	-	1,985,818,184	19,666,437	2,030,555,940	-	2,038,908,114	8,352,174

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	125,441,920,883	-	124,792,001,090	649,919,793	126,036,335,302	-	125,903,497,993	132,837,309
アメリカ・ドル	58,873,704,780	-	57,429,287,736	1,444,417,044	57,870,422,533	-	57,879,347,745	8,925,212
イギリス・ポンド	6,371,602,401	-	6,505,950,259	134,347,858	6,809,585,174	-	6,801,876,680	7,708,494
イスラエル・シェケル	438,559,875	-	469,549,320	30,989,445	391,560,646	-	392,303,284	742,638
オーストラリア・ドル	1,874,626,099	-	1,911,887,439	37,261,340	1,674,062,404	-	1,669,632,025	4,430,379
オフショア・人民元	9,797,077,274	-	9,810,085,533	13,008,259	14,239,064,957	-	14,228,113,348	10,951,609
カナダ・ドル	2,645,540,288	-	2,634,916,969	10,623,319	2,437,302,922	-	2,432,575,652	4,727,270
シンガポール・ドル	589,632,624	-	590,685,952	1,053,328	561,447,618	-	560,710,366	737,252
スウェーデン・クローナ	276,581,011	-	290,937,653	14,356,642	302,543,596	-	302,358,301	185,295
デンマーク・クローネ	547,183,260	-	554,341,255	7,157,995	392,817,067	-	391,909,342	907,725
ニュージーランド・ドル	259,708,644	-	268,583,452	8,874,808	378,865,821	-	377,939,192	926,629
ノルウェー・クローネ	199,923,818	-	204,397,646	4,473,828	212,461,777	-	211,968,232	493,545
ポーランド・ズロチ	643,352,920	-	668,777,247	25,424,327	699,470,528	-	696,845,140	2,625,388
マレーシア・リンギット	673,724,800	-	669,977,392	3,747,408	653,675,926	-	644,323,269	9,352,657
メキシコ・ペソ	1,061,096,770	-	1,085,973,320	24,876,550	968,494,781	-	961,542,691	6,952,090
ユーロ	41,189,606,319	-	41,696,649,917	507,043,598	38,444,559,552	-	38,352,052,726	92,506,826
買建	-	-	-	-	2,654,326,400	-	2,651,525,800	2,800,600
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,201,189,600	-	1,201,272,800	83,200

イギリス・ ボンド	-	-	-	-	190,845,400	-	190,621,100	224,300
オフショア・ 人民元	-	-	-	-	310,698,000	-	310,339,500	358,500
ユーロ	-	-	-	-	951,593,400	-	949,292,400	2,301,000
合計	125,441,920,883	-	124,792,001,090	649,919,793	128,690,661,702	-	128,555,023,793	130,036,709

(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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	0.8444円	0.8465円
(1万口当たり純資産額)	(8,444円)	(8,465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	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	7,950,000.000	8,399,334.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	400,000.000	416,872.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,545,796.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	674,440.200	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,000,000.000	2,070,380.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	323,190.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	394,641.100	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,417,458.900	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,434,952.600	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	770,000.000	805,681.800	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	554,976.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	3,700,000.000	3,136,009.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	565,359.400	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,185,315.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	786,930.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,662,500.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,993,550.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	980,067.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	1,532,000.000	1,386,751.080	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	886,670.000	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,200,000.000	1,023,468.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	768,957.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	294,971.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	800,000.000	623,248.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	3,500,000.000	3,391,710.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	217,113.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,612,368.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	771,812.400	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,495,735.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	342,460.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	12,850,000.000	12,329,446.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	769,490.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	8,000,000.000	7,681,840.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	706,140.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,550,000.000	5,323,227.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	744,078.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	13,338,220.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	746,810.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	521,745.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,837,880.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	779,430.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	796,170.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	3,300,000.000	3,168,627.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	4,000,000.000	3,830,520.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,399,032.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,147,393.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,536,721.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,500,000.000	6,131,450.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,163,370.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	1,000,000.000	974,140.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,800,000.000	1,360,998.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,141,093.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,500,000.000	4,340,025.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	2,000,000.000	1,792,960.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	1,500,000.000	994,365.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	300,000.000	204,111.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,500,000.000	2,379,275.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,954,960.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	1,000,000.000	622,960.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,000,000.000	2,493,690.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,000,000.000	1,023,080.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	500,000.000	317,800.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,800,000.000	2,307,480.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,700,000.000	895,509.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	500,000.000	315,005.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	4,000,000.000	3,627,320.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	4,159,150.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	800,000.000	450,200.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	4,061,475.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	4,000,000.000	3,834,120.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	3,300,000.000	2,972,706.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	2,500,000.000	1,500,575.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,117,225.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,000,000.000	1,910,920.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	909,780.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	600,000.000	423,816.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	1,000,000.000	954,450.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	5,012,370.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,953,562.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	3,000,000.000	2,727,570.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	2,400,000.000	1,621,968.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,196,016.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	907,420.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,357,965.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	3,500,000.000	3,321,430.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,912,656.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,400,000.000	1,480,536.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	2,750,000.000	1,879,075.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	3,000,000.000	2,827,830.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	2,000,000.000	1,789,800.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	896,910.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,261,232.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	1,500,000.000	1,348,935.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,000,000.000	2,825,490.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	3,000,000.000	2,502,360.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	3,100,000.000	1,847,631.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,416,520.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,777,480.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,618,320.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,900,000.000	5,070,991.000	



1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	6,000,000.000	5,463,120.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,633,975.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	749,800.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,284,850.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,500,000.000	1,427,100.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	1,500,000.000	1,445,970.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	2,800,000.000	2,572,388.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,727,783.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	855,390.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	1,000,000.000	944,860.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	1,500,000.000	1,468,290.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,500,000.000	2,269,575.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,542,800.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	4,000,000.000	3,751,680.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,188,084.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	3,000,690.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	1,000,000.000	998,760.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	2,000,000.000	1,865,220.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,987,220.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	692,720.000	

3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	3,000,000.000	2,916,240.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,815,120.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	927,570.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,569,150.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,500,000.000	1,465,800.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	4,500,000.000	4,244,760.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,800,000.000	1,570,770.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,314,500.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	2,000,000.000	1,964,280.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	1,000,000.000	996,260.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	1,000,000.000	1,004,080.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	2,800,000.000	2,737,364.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	1,900,000.000	1,813,265.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,500,000.000	1,484,265.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	1,700,000.000	1,690,259.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,025,710.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	3,000,000.000	3,077,790.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	4,500,000.000	4,604,220.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	600,000.000	622,566.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,100,000.000	2,222,745.000	

4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	2,500,000.000	2,512,425.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	1,500,000.000	1,519,860.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	6,000,000.000	6,057,720.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	7,000,000.000	6,994,190.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	3,000,000.000	2,955,450.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	800,000.000	781,608.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	1,200,000.000	1,203,552.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,999,600.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	8,500,000.000	8,522,525.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	3,000,000.000	3,023,370.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	3,700,000.000	3,751,134.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	2,500,000.000	2,599,600.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,400,000.000	1,426,460.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	5,000,000.000	5,030,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	3,500,000.000	3,498,740.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	2,300,000.000	2,241,580.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	500,000.000	489,140.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,500,000.000	3,505,845.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	2,000,000.000	2,009,200.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	1,700,000.000	1,739,032.000	

アメリカ・ドル 小計			376,506,031.980 (56,558,736,124)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	496,683.900	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	475,000.000	455,472.750	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	650,000.000	362,238.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	610,408.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	464,967.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	605,351.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	734,464.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	231,202.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	500,000.000	288,750.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	350,000.000	178,605.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	693,216.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	300,000.000	184,200.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	325,440.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	256,589.500	
	0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,000,000.000	958,040.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	444,720.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	147,837.200	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,329,995.000		
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	1,000,000.000	933,700.000		

1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,200,000.000	574,512.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	1,000,000.000	653,570.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	100,000.000	86,822.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	1,500,000.000	1,143,720.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	99,720.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	500,000.000	405,215.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	500,000.000	182,370.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,097,030.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	800,000.000	746,720.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	588,140.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	600,000.000	523,020.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	800,000.000	809,736.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	500,000.000	514,650.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	700,000.000	702,380.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,000,000.000	989,470.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	300,000.000	281,910.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	1,000,000.000	1,001,210.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,000,000.000	1,000,150.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,035,147.960	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,200,000.000	1,211,784.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	907,954.500	
	4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	566,544.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	783,946.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	719,257.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	300,000.000	301,920.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	895,421.900	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	942,638.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	504,523.020	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	330,000.000	320,661.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	612,948.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	464,487.260	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	963,500.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	593,390.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	716,800.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	338,900.000	268,002.120	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	800,000.000	675,040.000	
	イギリス・ポンド 小計		33,586,191.410 (6,404,886,702)	
イスラエル・ シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,306,380.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,800,440.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,020,144.000	

	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	928,460.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,436,126.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	708,300.000	
イスラエル・シケル 小計			9,199,850.000 (380,718,313)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	905,633.190	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	311,190.400	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	365,124.540	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,405,697.580	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	678,556.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	691,488.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	184,000.000	159,355.040	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	622,783.840	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	588,589.250	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,196,625.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	200,000.000	189,076.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,000,000.000	926,310.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	400,625.400	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,531,728.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	690,752.500	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	490,725.000		

	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	1,000,000.000	810,610.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	500,000.000	416,495.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	904,300.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	956,620.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,000,000.000	932,370.000	
	オーストラリア・ドル 小計		16,174,655.240 (1,578,161,112)	
オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,000,000.000	3,057,000.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,930,040.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,821,590.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,433,950.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,104,070.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,673,279.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	8,000,000.000	8,275,840.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,769,860.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	18,000,000.000	19,589,400.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	20,000,000.000	20,436,800.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,000,000.000	9,139,690.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,394,960.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	7,000,000.000	9,078,790.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,444,512.000	



2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,108,400.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,150,220.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,281,190.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,897,410.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,484,020.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	10,000,000.000	10,790,500.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	6,400,000.000	8,555,008.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	7,000,000.000	9,129,400.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	8,800,000.000	10,741,896.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,670,135.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	4,153,149.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,656,425.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	12,000,000.000	12,231,600.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	9,800,000.000	10,371,928.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,188,200.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	10,500,000.000	10,750,950.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	6,093,300.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	9,000,000.000	9,527,040.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,140,670.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,296,040.000	

2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,375,760.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	2,093,080.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	13,000,000.000	13,551,980.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	4,000,000.000	4,102,680.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	4,726,440.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	8,000,000.000	8,493,760.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,682,370.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	20,000,000.000	20,255,200.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	8,000,000.000	8,555,840.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	8,000,000.000	8,428,160.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	4,000,000.000	4,141,160.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	6,000,000.000	7,174,800.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	9,000,000.000	9,456,480.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	6,000,000.000	6,265,740.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	20,565,000.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	11,000,000.000	11,422,950.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	15,000,000.000	15,191,850.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	11,000,000.000	11,482,240.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	5,000,000.000	5,823,950.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	12,000,000.000	12,614,640.000	

	2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	8,000,000.000	8,319,920.000	
	2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	10,000,000.000	10,285,300.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	25,000,000.000	25,328,750.000	
	2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	9,000,000.000	9,224,190.000	
	2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	10,000,000.000	10,243,100.000	
	2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	21,000,000.000	21,358,890.000	
	2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	8,000,000.000	8,163,760.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	20,000,000.000	20,102,400.000	
	2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	21,000,000.000	21,319,200.000	
	1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	10,000,000.000	10,109,500.000	
	1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	10,000,000.000	10,051,700.000	
	2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	8,000,000.000	8,055,040.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	8,000,000.000	8,012,160.000	
	オフショア・人民元 小計		671,345,252.000 (13,892,013,031)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	431,710.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,016,964.680	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	358,569.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	691,362.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	148,103.200	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	468,295.000	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,879,488.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	888,642.900	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	582,702.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,207,852.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	292,713.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,553,545.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	1,500,000.000	1,448,595.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,823,040.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	250,000.000	185,475.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,445,025.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	904,460.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	465,415.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	961,340.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,500,000.000	1,526,910.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	800,000.000	743,040.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,500,000.000	1,522,365.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,200,000.000	1,218,276.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	800,000.000	812,184.000	
	カナダ・ドル 小計		22,576,072.580 (2,416,768,570)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	206,349.500	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	604,380.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	237,566.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	439,656.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	503,365.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	297,366.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	198,120.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	627,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	296,975.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	372,720.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	143,140.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	1,000,000.000	971,750.000	
シンガポール・ドル 小計			4,898,387.500 (548,080,577)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,938,471.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,720,106.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,471,638.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	513,765.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,860,770.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,594,120.000	
スウェーデン・クローナ 小計			17,098,871.300 (234,938,492)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	4,740,000.000	6,226,179.600	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	3,098,432.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,606,330.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,494,912.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,776,380.000	
デンマーク・クローネ 小計			14,202,233.600 (301,229,375)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	1,015,770.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	282,585.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	247,482.000	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	481,480.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	425,240.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	428,055.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	135,508.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	250,000.000	251,017.500	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	701,932.000	
ニュージーランド・ドル 小計			3,969,069.500 (351,699,248)	
ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,390,417.600	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,881,290.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,904,240.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,853,020.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,234,675.000	

	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,737,360.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,826,800.000	
ノルウェー・クローネ 小計			13,827,802.600 (187,505,003)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,544,326.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,710,891.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,066,550.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,443,510.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	827,397.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	782,890.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,163,160.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	1,000,000.000	1,037,400.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	1,000,000.000	983,470.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	1,000,000.000	961,820.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	614,994.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,678,644.000	
ポーランド・ズロチ 小計			16,815,053.000 (619,025,999)	
マレーシア・リ ンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,833,004.800	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,026,580.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,968,934.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,402,870.000	

	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,510,500.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	778,204.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	517,455.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,546,791.800	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	505,865.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,081,280.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,754,736.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,512,615.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,215,144.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,302,340.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	400,000.000	389,448.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,384,586.000	
	マレーシア・リングgit 小計		19,730,354.100 (666,197,379)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	23,039,126.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,063,820.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	10,000,000.000	9,160,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	7,833,200.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	8,571,900.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,800,560.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,749,147.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,200,350.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,376,950.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	12,700,000.000	11,450,955.000	
7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	11,179,444.500		



	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	8,862,841.000	
メキシコ・ペソ 小計			122,288,594.000 (900,141,882)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	172,210.300	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	207,619.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	191,754.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	132,415.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	470,140.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	276,801.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	263,760.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	102,204.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	101,218.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	172,204.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	385,580.000	
	1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	279,861.000	
	2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	500,000.000	513,245.000	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	478,357.600	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	213,640.200	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	183,430.800	
	0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	964,000.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	165,128.000		

0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	574,596.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	652,932.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	400,783.500	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,100,000.000	689,975.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	47,919.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	866,270.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	151,318.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	74,811.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	450,695.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	167,876.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	998,500.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	825,896.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	274,476.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	409,133.200	
1% Belgium Government Bond 20260622	95,000.000	93,457.200	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	500,000.000	378,365.000	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	300,000.000	231,720.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	706,946.600	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	247,767.500	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	341,584.000	

1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	452,605.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	600,000.000	565,230.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	260,550.500	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	796,968.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	408,180.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	282,492.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	338,612.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	265,992.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	500,000.000	489,875.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,300,000.000	1,340,014.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	400,000.000	402,892.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	507,438.750	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	889,728.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	879,432.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,296,000.000	1,564,116.480	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,403,460.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,270,000.000	1,563,814.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,650,388.700	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	520,000.000	645,112.000	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	743,234.880	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,129,260.060	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,075,000.000	1,109,120.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	866,973.550	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,350,000.000	1,307,340.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	966,250.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,062,413.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,160,000.000	938,405.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	1,007,485.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,000,000.000	944,560.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,686,672.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	459,005.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,300,000.000	1,288,161.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	636,370.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	240,354.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,000,000.000	900,640.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	700,000.000	623,595.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	155,924.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,395,795.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	224,488.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	881,010.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	881,210.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	500,000.000	435,295.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	1,100,000.000	1,079,320.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	713,656.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	1,008,260.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,000,000.000	2,043,460.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	400,000.000	357,520.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	800,000.000	835,408.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	800,000.000	808,896.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	800,000.000	829,120.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	1,036,460.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	1,000,000.000	1,044,170.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	200,000.000	107,024.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	1,500,000.000	1,508,280.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	1,000,000.000	974,030.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,000,000.000	965,950.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,000,000.000	1,913,920.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,010,790.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,000,000.000	2,250,760.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,154,268.000	

4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,406,806.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	732,000.000	810,104.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,392,183.100	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,143,000.000	1,331,995.050	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,114,630.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	1,500,000.000	1,526,775.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,442,800.100	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,338,392.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	3,500,000.000	3,499,055.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	3,100,000.000	2,900,670.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,650,000.000	1,373,493.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	520,872.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,370,000.000	1,319,775.800	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,000,000.000	845,010.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	200,000.000	194,200.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	500,000.000	394,460.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	2,842,530.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,562,418.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,579,940.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,350,000.000	931,243.500	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,000,000.000	1,836,920.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	2,500,000.000	2,434,675.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	676,450.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	400,000.000	151,748.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	500,000.000	305,205.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,600,000.000	1,334,048.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	476,435.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	530,330.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,100,000.000	901,560.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	796,990.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,427,445.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,500,000.000	1,420,455.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	896,610.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	800,000.000	739,384.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	1,000,000.000	1,005,730.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,400,000.000	3,577,582.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	100,000.000	95,034.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	2,000,000.000	2,012,240.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	1,300,000.000	1,310,751.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	932,112.000	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,180,000.000	1,386,665.200	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	397,542.600	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	956,373.600	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,631,072.300	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	644,693.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	188,840.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	211,612.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	607,775.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	500,000.000	488,500.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	300,000.000	264,426.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	700,000.000	634,641.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	1,000,000.000	1,017,230.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,000,000.000	1,093,670.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,267,193.450	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	841,722.400	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	500,000.000	459,855.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	897,354.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	254,580.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	403,222.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	500,000.000	400,185.000	



2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,697,909.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	650,000.000	619,430.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	2,037,126.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	660,268.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,483,980.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	912,042.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	707,889.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	505,160.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,397,298.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	500,000.000	471,880.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	467,510.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	950,000.000	747,944.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	413,565.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	453,385.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	562,554.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,000,000.000	979,610.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	544,789.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	889,320.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	266,344.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	151,758.000	

0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,000,000.000	1,729,800.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	298,597.500	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	263,673.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	300,000.000	260,529.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	459,485.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	145,154.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	504,835.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	390,416.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,287,084.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	600,000.000	660,690.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,583,505.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,340,456.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	553,605.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	1,000,000.000	1,019,610.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	524,285.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	1,000,000.000	1,096,930.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	1,000,000.000	1,046,200.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,200,000.000	1,244,388.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,000,000.000	1,050,670.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	744,198.000	

5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,066,890.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,767,952.320	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,553,214.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,899,117.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,355,686.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,326,606.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	500,000.000	581,920.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	1,000,000.000	1,026,820.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,249,540.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	525,000.000	600,038.250	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,429,444.300	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,104,550.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	902,745.000	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	865,000.000	1,001,929.500	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	721,028.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	308,961.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	688,724.400	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	459,637.500	
1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	512,054.400	

1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	455,350.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	138,477.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	100,000.000	95,223.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	287,226.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	300,000.000	238,251.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	171,498.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	145,492.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	419,865.800	
4.15% Austria Government Bond 20370315	300,000.000	346,572.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	723,786.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	207,726.400	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	122,604.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,628,086.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	887,996.200	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,800,000.000	2,791,516.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,100,000.000	1,035,474.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,180,000.000	1,173,415.600	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	500,000.000	492,430.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,067,786.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	799,623.000	

1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,144,915.200	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	650,000.000	632,060.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,050,000.000	945,021.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	771,168.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	400,000.000	363,836.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	827,082.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	60,273.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	800,000.000	747,736.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	150,000.000	113,397.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	688,472.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	110,282.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,000,000.000	1,863,720.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	696,933.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	353,500.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	875,910.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,400,000.000	1,304,786.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	600,000.000	614,148.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,554,690.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	500,000.000	545,285.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	2,000,000.000	2,097,080.000	

	3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	1,000,000.000	1,040,100.000	
	3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,000,000.000	1,034,900.000	
	2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	1,000,000.000	1,014,460.000	
	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	828,981.200	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	1,013,958.000	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	971,112.000	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	597,760.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,059,860.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	490,000.000	624,554.000	
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	1,000,000.000	1,142,140.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	500,000.000	506,835.000	
	2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,000,000.000	1,004,680.000	
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	300,000.000	348,063.000	
	2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	500,000.000	490,655.000	
	1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	497,710.000	
	0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	500,000.000	454,725.000	
	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	600,000.000	527,088.000	
	ユーロ 小計		235,753,561.790 (37,310,358,689)	
	国債証券 合計		122,350,460,496 [122,350,460,496]	
	合計		122,350,460,496 [122,350,460,496]	

- (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 160銘柄	100%	46.3%
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シケル	国債証券 6銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券 67銘柄	100%	11.4%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 9銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 274銘柄	100%	30.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。



## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,165,304	18,517,989
親投資信託受益証券	3,642,958,449	5,165,614,850
未収入金	1,615,776	6,066,083
流動資産合計	3,660,739,529	5,190,198,922
資産合計	3,660,739,529	5,190,198,922
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,498,198	6,764,585
未払受託者報酬	390,669	579,041
未払委託者報酬	4,493,081	6,659,393
その他未払費用	146,428	217,070
流動負債合計	10,528,376	14,220,089
負債合計	10,528,376	14,220,089
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,858,028,543	1 3,844,113,893
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	792,182,610	1,331,864,940
（分配準備積立金）	472,082,385	569,934,207
元本等合計	3,650,211,153	5,175,978,833
純資産合計	3,650,211,153	5,175,978,833
負債純資産合計	3,660,739,529	5,190,198,922

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		18,110
有価証券売買等損益		368,395,074		230,264,776
営業収益合計		368,395,076		230,282,886
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,718		303
受託者報酬		684,212		1,031,961
委託者報酬		7,869,422		11,868,554
その他費用		256,439		386,836
営業費用合計		8,813,791		13,287,654
営業利益又は営業損失（ ）		359,581,285		216,995,232
経常利益又は経常損失（ ）		359,581,285		216,995,232
当期純利益又は当期純損失（ ）		359,581,285		216,995,232
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（ ）		20,336,679		31,424,404
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		330,273,024		792,182,610
剰余金増加額又は欠損金減少額		187,308,554		542,543,578
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		187,308,554		542,543,578
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,643,574		188,432,076
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,643,574		188,432,076
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		792,182,610		1,331,864,940

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	2,102,708,293円	2,858,028,543円
期中追加設定元本額	1,172,196,883円	1,644,957,223円
期中一部解約元本額	416,876,633円	658,871,873円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,858,028,543口	3,844,113,893口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2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(339,246,431円)、投資信託約款に規定される収益調整金(320,103,679円)及び分配準備積立金(132,835,954円)より分配対象額は792,186,064円(1万口当たり2,771.79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(16,311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(185,551,695円)、投資信託約款に規定される収益調整金(761,930,733円)及び分配準備積立金(384,366,201円)より分配対象額は1,331,864,940円(1万口当たり3,464.69円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	353,027,239	210,214,914
合計	353,027,239	210,214,914

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.2772円	1.3465円
(1万口当たり純資産額)	(12,772円)	(13,465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	552,210,261	1,023,908,265	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,136,925,687	4,141,706,585	
親投資信託受益証券 合計			5,165,614,850	
合計			5,165,614,850	

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、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「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。

「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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	145,917,985	205,148,165
コール・ローン	394,912,800	164,155,576
国債証券	39,718,411,872	48,270,386,284
派生商品評価勘定	77,686	1,849,481
未収入金	-	340,435,330
未収利息	655,194,068	825,961,196
前払費用	65,088,745	54,311,547
流動資産合計	40,979,603,156	49,862,247,579
資産合計	40,979,603,156	49,862,247,579
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,736,783	2,165,649
未払金	-	223,566,323
未払解約金	1,528,060	412,940
流動負債合計	3,264,843	226,144,912
負債合計	3,264,843	226,144,912
純資産の部		
元本等		
元本	1 22,944,309,020	26,769,377,774
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	18,032,029,293	22,866,724,893
元本等合計	40,976,338,313	49,636,102,667
純資産合計	40,976,338,313	49,636,102,667
負債純資産合計	40,979,603,156	49,862,247,579

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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）、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>
<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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	18,960,433,420円	22,944,309,020円
期中追加設定元本額	4,734,793,950円	4,841,013,936円
期中一部解約元本額	750,918,350円	1,015,945,182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)	436,622,799円	630,148,422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)	384,618,514円	478,992,594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)	406,652,289円	552,210,261円
D-I's 新興国債券インデッ クス	67,747,337円	69,589,528円
iFree 新興国債券インデッ クス	7,682,054,515円	9,664,720,039円
iFree 8資産バランス	4,426,992,141円	5,399,710,158円
ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし)(投資一任 専用)	4,111,811円	5,572,809円
DCダイワ新興国債券インデッ クスファンド	9,358,962,251円	9,809,644,218円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	-円	63,261円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	-円	1,499,302円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	-円	1,801,503円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	137,565,883円	117,579,630円
ダイワ・ノーロード 新興国債券 ファンド	38,981,480円	37,846,049円
計	22,944,309,020円	26,769,377,774円
2. 期末日における受益権の総数	22,944,309,020口	26,769,377,774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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	102,667,406	617,584,420
合計	102,667,406	617,584,420

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間を指しております。

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	-	-	-	-	303,863,042	-	302,783,303	1,079,739
タイ・バーツ	-	-	-	-	212,926,140	-	211,830,390	1,095,750
チェコ・コルナ	-	-	-	-	6,907,450	-	6,891,720	15,730
トルコ・リラ	-	-	-	-	25,046,720	-	25,068,760	22,040
ハンガリー・フォリント	-	-	-	-	58,982,000	-	58,991,702	9,702
ユーロ	-	-	-	-	732	-	731	1
買建	123,592,687	-	121,933,590	1,659,097	439,103,607	-	437,707,700	1,395,907
インド・ルピー	-	-	-	-	364,162,000	-	364,900,000	738,000
オフショア・人民元	-	-	-	-	21,327,900	-	20,685,900	642,000
チェコ・コルナ	36,479,164	-	36,556,850	77,686	-	-	-	-
トルコ・リラ	57,123,220	-	55,533,500	1,589,720	-	-	-	-
ハンガリー・フォリント	29,990,303	-	29,843,240	147,063	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	18,803,763	-	18,392,800	410,963
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	15,111,530	-	14,703,400	408,130

南アフリカ・ ランド	-	-	-	-	19,698,414	-	19,025,600	672,814
合計	123,592,687	-	121,933,590	1,659,097	742,966,649	-	740,491,003	316,168

## (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.7859円	1.8542円
(1万口当たり純資産額)	(17,859円)	(18,542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・ルピー	5.85% India Government Bond 20301201	48,000,000.000	45,852,960.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	57,000,000.000	58,806,900.000	

7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	74,000,000.000	75,526,620.000	
7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	46,000,000.000	47,102,160.000	
7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	33,000,000.000	36,028,410.000	
6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	36,000,000.000	35,604,000.000	
7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	38,000,000.000	38,870,960.000	
5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	37,000,000.000	35,427,500.000	
5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	48,000,000.000	45,896,640.000	
6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	66,000,000.000	63,783,720.000	
6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	58,000,000.000	56,008,860.000	
6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	58,000,000.000	58,397,300.000	
6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	53,000,000.000	52,387,850.000	
7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	51,000,000.000	51,610,980.000	
7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	57,000,000.000	59,879,070.000	
7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	42,000,000.000	42,824,460.000	
7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	70,000,000.000	72,934,400.000	
7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	70,000,000.000	72,794,400.000	
7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	54,000,000.000	55,687,500.000	
7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	39,000,000.000	39,544,440.000	
7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	40,000,000.000	40,638,000.000	
7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	85,000,000.000	88,696,650.000	

	7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	65,000,000.000	67,028,650.000	
	7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	27,000,000.000	27,546,480.000	
	7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	24,000,000.000	24,769,200.000	
	7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	8,396,880.000	
	7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	66,000,000.000	67,215,720.000	
	7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	29,000,000.000	29,298,700.000	
	7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	18,000,000.000	18,186,840.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007	30,000,000.000	30,240,000.000	
	インド・ルピー 小計		1,446,986,250.000 (2,575,635,525)	
インドネシア・ ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	16,697,530,000.000	
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	10,000,000,000.000	10,954,200,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	7,000,000,000.000	7,250,250,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	9,000,000,000.000	9,337,500,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,700,000,000.000	8,610,602,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	17,959,310,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20300915	24,300,000,000.000	24,505,821,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	22,781,880,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	19,000,000,000.000	19,793,630,000.000	
	5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	20,600,000,000.000	20,283,584,000.000	
	6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	26,300,000,000.000	25,865,787,000.000	

6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	6,927,992,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	35,290,134,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	15,700,000,000.000	15,165,729,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	15,000,000,000.000	15,085,200,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,593,134,000.000	
7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	19,800,000,000.000	19,919,592,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	15,941,898,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	18,000,000,000.000	18,160,920,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	13,000,000,000.000	13,171,080,000.000	
6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	20,000,000,000.000	19,688,200,000.000	
6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	26,000,000,000.000	26,142,220,000.000	
6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	5,500,000,000.000	5,419,700,000.000	
6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715	7,500,000,000.000	7,411,425,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	2,900,000,000.000	2,998,339,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,085,450,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	5,100,000,000.000	5,821,905,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	22,024,000,000.000	22,688,464,080.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,117,222,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	16,030,000,000.000	16,152,789,800.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	16,450,000,000.000	16,160,973,500.000	

	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	14,075,000,000.000	13,815,316,250.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	29,432,982,000.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	13,020,000,000.000	14,094,280,200.000	
インドネシア・ルピア 小計			515,325,040,730.000 (4,895,587,887)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,753,072.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	11,250,000.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,082,500.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			25,085,572.000 (87,325,385)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	2,200,000.000	2,241,800.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,117,568.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,340,671.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	3,400,000.000	3,498,362.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,345,698.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,101,451.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,965,504.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,197,480.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	4,000,000.000	4,060,720.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	3,700,000.000	3,903,463.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,856,290.000	
3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,985,176.000		



3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	7,572,886.000	
3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,246,850.000	
3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,593,940.000	
3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,512,680.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,597,560.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,887,498.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,517,060.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,735,375.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,854,040.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,175,080.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,664,675.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,252,580.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,437,320.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,646,400.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,768,804.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,791,279.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,161,040.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	1,900,000.000	1,909,215.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,674,464.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,440,118.000	

2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,282,144.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,417,932.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,928,364.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	3,000,000.000	3,026,370.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,157,470.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,309,952.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,633,176.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,673,700.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,898,024.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,416,457.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,630,760.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	2,000,000.000	2,026,220.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,362,304.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,132,870.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,084,750.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	1,000,000.000	1,038,450.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,557,555.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,237,656.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,906,048.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,000,000.000	2,329,580.000	

2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,137,400.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,055,680.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,522,928.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,300,000.000	4,471,957.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,052,600.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,637,005.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	800,000.000	819,448.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	2,200,000.000	2,237,598.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	1,500,000.000	1,514,745.000	
2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,766,878.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	3,900,000.000	3,979,833.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	600,000.000	609,120.000	
2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,470,384.000	
2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	1,700,000.000	1,782,348.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	1,000,000.000	1,005,170.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	3,000,000.000	3,020,640.000	
2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	500,000.000	507,060.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	1,000,000.000	1,000,290.000	
2.17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829	3,300,000.000	3,326,862.000	
2.25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829	1,000,000.000	1,008,530.000	

	2.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925	1,100,000.000	1,095,490.000	
	1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	500,000.000	501,980.000	
オフショア・人民元 小計			235,626,775.000 (4,875,777,729)	
コロンビア・ペ ソ	6% Colombian TES 20280428	6,320,000,000.000	5,678,393,600.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	5,410,000,000.000	5,334,368,200.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,900,000,000.000	4,393,095,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,344,410,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	600,000,000.000	591,282,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	5,900,000,000.000	4,650,262,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	4,400,000,000.000	4,014,868,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	6,410,000,000.000	4,149,449,400.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	3,000,000,000.000	2,072,940,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	4,587,462,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	7,722,441,000.000	
	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	5,200,000,000.000	5,900,752,000.000	
	11.5% COLOMBIAN TES 20460725	2,400,000,000.000	2,364,576,000.000	
	コロンビア・ペソ 小計			55,804,299,200.000 (1,890,538,048)
セルビア・ディ ナール	4.5% Serbia Treasury Bonds 20260111	24,000,000.000	24,072,000.000	
	5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	26,443,750.000	
	4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	34,168,750.000	
	7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	32,770,000.000	
セルビア・ディナール 小計			117,454,500.000 (159,521,299)	

タイ・パーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	53,850,115.500	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,000,000.000	31,586,520.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	42,713,496.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	37,918,486.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	43,400,000.000	43,508,066.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	48,500,000.000	53,646,335.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	34,796,347.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	39,000,000.000	40,231,230.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	48,000,000.000	52,326,720.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	37,564,835.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	19,053,315.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	37,910,210.000	
	2% Thailand Government Bond 20311217	60,000,000.000	59,374,200.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	26,304,740.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	59,466,460.000	
	2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	56,000,000.000	57,169,280.000	
	3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	53,446,515.000	
	2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	43,500,000.000	43,720,980.000	
	3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	47,000,000.000	52,184,570.000	
	3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	49,000,000.000	53,083,660.000	

	2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,282,500.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	37,475,820.000	
	2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	21,000,000.000	21,893,760.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	21,000,000.000	21,235,410.000	
	2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	1,000,000.000	1,020,060.000	
	タイ・パーツ 小計		1,021,763,630.500 (4,444,671,793)	
チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,646,656.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	15,980,699.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	27,400,000.000	26,348,662.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	23,912,350.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	27,000,000.000	25,152,660.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	29,500,000.000	28,470,155.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	25,390,945.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	28,700,000.000	24,727,059.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,031,780.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	15,561,018.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,676,210.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,694,210.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	15,700,000.000	15,097,434.000	
	6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	19,500,000.000	20,123,610.000	

	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	27,818,700.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	22,021,715.000	
	1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	11,125,100.000	
	4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	16,000,000.000	17,190,400.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	12,000,000.000	13,068,600.000	
	6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	9,165,520.000	
	4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	14,300,000.000	14,919,619.000	
	3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303	4,000,000.000	3,757,960.000	
	3.6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603	4,000,000.000	3,850,960.000	
	チェコ・コルナ 小計		419,732,022.000 (2,629,998,877)	
チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	496,845,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	928,028,100.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	689,793,300.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	1,035,000,000.000	991,633,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	708,840,000.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	242,864,600.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	850,000,000.000	871,292,500.000	
	6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	200,000,000.000	218,716,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	510,000,000.000	516,145,500.000	
	チリ・ペソ 小計		5,664,158,500.000 (873,866,374)	

ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,778,838.000	
	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,670,875.000	
	10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	21,220,000.000	
ドミニカ・ペソ 小計			48,669,713.000 (121,036,709)	
トルコ・リラ	10.6% Turkey Government Bond 20260211	5,570,000.000	4,179,505.200	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,029,995.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	9,000,000.000	5,554,440.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	15,000,000.000	9,376,950.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	9,100,000.000	7,508,319.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	7,882,829.000	
	16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	6,444,955.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	7,901,880.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	16,645,790.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	52,000,000.000	49,832,640.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	39,650,495.000	
	トルコ・リラ 小計			157,007,798.200 (680,142,081)
ハンガリー・ フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	248,537,700.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	170,000,000.000	159,378,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	373,000,000.000	382,119,850.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	194,598,000.000	



	3.25% Hungary Government Bond 20311022	332,000,000.000	282,870,640.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	243,000,000.000	232,998,120.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	137,085,280.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	211,449,280.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	265,000,000.000	226,135,100.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	236,243,700.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	93,051,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	130,000,000.000	83,613,400.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	54,106,500.000	
	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	95,338,000.000	
	4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	215,100,200.000	
	9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	190,000,000.000	201,014,300.000	
	7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	90,000,000.000	94,626,900.000	
	ハンガリー・フォリント 小計		3,148,266,370.000 (1,206,393,636)	
ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,350,000.000	18,071,158.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	21,400,000.000	19,067,828.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	11,300,000.000	9,720,147.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	10,400,000.000	8,737,040.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	3,850,000.000	3,177,828.500	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	17,300,000.000	16,127,406.000	

	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	28,200,000.000	24,476,754.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	31,500,000.000	25,597,845.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	15,900,000.000	11,351,964.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	7,150,000.000	3,718,500.500	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	9,200,000.000	6,155,076.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701	1,400,000.000	878,948.000	
ブラジル・リアル 小計			147,080,495.500 (3,699,309,790)	
ペルー・ソル	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,270,000.000	1,331,163.200	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,333,417.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,366,631.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,617,240.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,775,571.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	3,900,000.000	4,128,033.000	
	7.6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	1,800,000.000	1,899,342.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	175,000.000	185,473.750	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,466,250.200	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,551,474.500	
ペルー・ソル 小計			25,654,596.650 (1,024,683,072)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	8,190,000.000	7,893,194.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	6,540,000.000	6,164,865.600	

	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	9,748,725.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,538,330.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,791,779.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	8,150,000.000	6,380,553.500	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	5,994,282.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,166,852.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	4,350,000.000	4,179,436.500	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	9,900,000.000	10,270,260.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	7,000,000.000	6,884,290.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	3,680,000.000	3,539,497.600	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	600,000.000	595,566.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,481,431.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	5,750,000.000	5,699,802.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		97,328,865.100 (3,583,045,374)	
マレーシア・リ ンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,707,706.500	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,837,350.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,530,108.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	4,200,000.000	4,290,132.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,221,840.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,041,197.000	

3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,850,000.000	3,848,883.500	
3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,531,206.000	
4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,450,744.000	
3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	3,800,000.000	3,823,864.000	
3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	1,100,000.000	1,102,387.000	
3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	4,850,000.000	4,854,510.500	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,876,950.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	2,350,000.000	2,362,713.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,208,221.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,700,000.000	3,736,371.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,864,808.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,649,504.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,463,508.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,880,359.500	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,100,000.000	3,126,071.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	4,350,000.000	4,404,897.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,077,635.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	3,000,000.000	3,005,400.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,283,928.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	4,300,000.000	4,252,657.000	

	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	5,400,000.000	5,057,748.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	3,100,000.000	3,056,755.000	
	4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	3,400,000.000	3,488,332.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,430,788.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,500,000.000	1,556,295.000	
	3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	3,900,000.000	3,906,903.000	
	4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	4,500,000.000	4,622,535.000	
	4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,503,222.000	
	4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,703,212.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,650,000.000	2,772,191.500	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,300,851.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,173,077.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	500,000.000	506,740.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	700,000.000	711,683.000	
	4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	3,800,000.000	3,896,634.000	
	マレーシア・リングgit 小計		145,119,918.600 (4,899,988,563)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	65,500,000.000	62,357,965.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	44,700,000.000	35,384,520.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	68,700,000.000	62,931,261.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	54,800,000.000	42,925,936.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	55,400,000.000	47,488,326.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	52,000,000.000	49,642,840.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	47,500,000.000	45,275,100.000	

	7.5% Mexican Bonos 20270603	57,530,000.000	54,765,683.500	
	10% Mexican Bonos 20361120	16,890,000.000	16,884,764.100	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	54,730,000.000	52,206,947.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	36,600,000.000	32,039,274.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	67,850,000.000	61,176,952.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	62,620,000.000	49,826,107.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	40,830,000.000	35,132,990.100	
	メキシコ・ペソ 小計		648,038,667.000 (4,770,083,020)	
ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,742,040.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,417,480.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,442,050.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,371,388.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,260,486.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,413,060.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,750,000.000	2,611,015.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,144,825.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,222,478.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,040,514.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,092,632.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,909,430.000	
	4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,767,205.000	
3.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20251125	2,000,000.000	1,947,740.000		

	8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	2,500,000.000	2,638,350.000	
	8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,846,772.000	
	8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	2,700,000.000	2,791,071.000	
	7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,706,158.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	1,400,000.000	1,407,602.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,700,000.000	2,671,974.000	
	7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,510,925.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	1,800,000.000	1,810,908.000	
	7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	1,400,000.000	1,373,302.000	
	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	1,500,000.000	1,449,585.000	
	ルーマニア・レイ 小計		54,588,990.000 (1,736,120,944)	
南アフリカ・ラ ンド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	58,650,000.000	61,204,207.500	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	12,980,254.400	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	11,106,541.600	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	35,040,000.000	31,311,043.200	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	78,020,000.000	64,191,735.200	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	58,800,000.000	50,697,360.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	63,000,000.000	60,663,330.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	39,450,762.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	59,800,000.000	55,829,878.000	

	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	61,700,000.000	56,800,403.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	42,789,786.000	
	11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	9,500,000.000	10,155,880.000	
	南アフリカ・ランド 小計		497,181,180.900 (4,116,660,178)	
国債証券 合計			48,270,386,284 [48,270,386,284]	
合計			48,270,386,284 [48,270,386,284]	

- (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・ルピー	国債証券 30銘柄	100%	5.3%
インドネシア・ルピア	国債証券 34銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.2%
オフショア・人民元	国債証券 74銘柄	100%	10.1%
コロンビア・ペソ	国債証券 13銘柄	100%	3.9%
セルビア・ディナール	国債証券 4銘柄	100%	0.3%
タイ・バーツ	国債証券 25銘柄	100%	9.2%
チェコ・コルナ	国債証券 23銘柄	100%	5.4%
チリ・ペソ	国債証券 9銘柄	100%	1.8%
ドミニカ・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.3%
トルコ・リラ	国債証券 11銘柄	100%	1.4%
ハンガリー・フォリント	国債証券 17銘柄	100%	2.5%
ブラジル・リアル	国債証券 12銘柄	100%	7.7%
ペルー・ソル	国債証券 10銘柄	100%	2.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	7.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 41銘柄	100%	10.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.9%
ルーマニア・レイ	国債証券 24銘柄	100%	3.6%



南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	8.5%
-----------	------	------	------	------

## 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。

「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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,395,766,728	3,265,896,841
コール・ローン	2,194,701,959	1,275,014,429
国債証券	274,718,308,942	319,553,739,746
派生商品評価勘定	3,136,806	1,328,423
未収入金	225,675	4,518,890,574
未収利息	2,015,893,116	2,514,700,486
前払費用	80,168,280	140,302,704
流動資産合計	283,408,201,506	331,269,873,203
資産合計	283,408,201,506	331,269,873,203
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,667,893	4,073,361
未払金	1,015,369	5,914,536,798
未払解約金	65,224,094	62,601,463
流動負債合計	72,907,356	5,981,211,622
負債合計	72,907,356	5,981,211,622
純資産の部		
元本等		
元本	1 82,595,678,754	89,294,936,390
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	200,739,615,396	235,993,725,191
元本等合計	283,335,294,150	325,288,661,581

純資産合計	283,335,294,150	325,288,661,581
負債純資産合計	283,408,201,506	331,269,873,203

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2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）、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>
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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	76,340,507,617円	82,595,678,754円
期中追加設定元本額	11,600,344,011円	16,190,059,355円
期中一部解約元本額	5,345,172,874円	9,490,801,719円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	391,220,587円	324,211,441円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	7,319,300円	4,781,204円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	40,271,896円	30,636,462円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	15,003,665円	14,033,041円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	206,248,674円	166,011,488円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	566,369,227円	842,983,481円
外国債券インデックスファンド VA(適格機関投資家専用)	-円	618,852,106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)	804,205,846円	983,420,556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)	3,747,848,437円	6,128,924,602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)	850,255,984円	1,136,925,687円
D-I's 外国債券インデック ス	2,616,753円	1,834,882円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	19,605,277円	21,719,854円
iFree 外国債券インデック ス	2,159,651,283円	1,372,465,220円
iFree 8資産バランス	2,274,181,036円	2,783,422,183円
iFree 年金バランス	497,028,931円	654,931,679円

D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	317,728円	2,273,344円
D Cダイワ外国債券インデック ス	51,424,951,579円	51,547,640,284円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,152,680,509円	1,194,034,129円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	811,578,029円	928,965,590円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	624,049,099円	743,852,613円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	691,231,526円	741,160,878円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	546,358,716円	608,421,588円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	218,171,346円	292,249,850円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	36,831,686円	36,879,849円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	18,569,302円	22,326,311円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	1,946,640,644円	2,472,851,337円
ダイワつみたてインデックスバ ランス3 0	4,601,402円	5,041,201円
ダイワつみたてインデックスバ ランス5 0	1,919,154円	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバ ランス7 0	3,291,011円	8,864,908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)	1,093,939,740円	2,502,295,766円
ダイワ世界バランスファンド4 0 V A	93,247,794円	87,623,017円
ダイワ世界バランスファンド6 0 V A	25,462,305円	26,313,609円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	2,826,420,113円	2,422,802,891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)	174,572,917円	150,695,281円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	-円	220,791円
スタイル9(4資産分散・バラ ンス型)	-円	2,520,283円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	-円	2,277,327円

スタイル9(6資産分散・保守型)	-円	50,244円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	1,709,577円
スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	599,353円
スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	76,963円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	1,684,869円
スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	1,889,635円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジなし)(投資一任専用)	-円	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	160,388,033円	132,221,944円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	66,632,761円	68,212,649円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	3,178,053,407円	4,076,068,144円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,811,265,010円	6,022,461,217円
ダイワライフスタイル25	26,830,233円	25,044,104円
ダイワライフスタイル50	59,333,757円	58,177,404円
ダイワライフスタイル75	16,514,057円	17,056,310円
計	82,595,678,754円	89,294,936,390円
2. 期末日における受益権の総数	82,595,678,754口	89,294,936,390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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	6,503,057,307	8,215,890,678
合計	6,503,057,307	8,215,890,678

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	-	-	-	-	476,962,250	-	475,765,323	1,196,927
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	89,511,064	-	89,254,590	256,474
シンガポール・ドル	-	-	-	-	45,701,997	-	45,642,511	59,486
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	128,416,184	-	128,048,469	367,715
ユーロ	-	-	-	-	213,333,005	-	212,819,753	513,252
買建	1,999,333,300	-	1,995,802,213	3,531,087	1,656,792,290	-	1,652,850,425	3,941,865
アメリカ・ドル	493,745,664	-	489,320,447	4,425,217	398,967,188	-	398,128,488	838,700
イギリス・ポンド	49,001,213	-	48,927,699	73,514	333,726,431	-	333,253,337	473,094
イスラエル・シェケル	20,745,465	-	22,211,377	1,465,912	53,402,839	-	53,489,729	86,890
オーストラリア・ドル	7,724,319	-	7,697,515	26,804	-	-	-	-
オフショア・人民元	1,040,150,311	-	1,041,531,390	1,381,079	483,104,282	-	482,482,694	621,588
カナダ・ドル	28,848,147	-	28,769,881	78,266	38,156,338	-	38,082,332	74,006
シンガポール・ドル	16,185,993	-	16,214,908	28,915	-	-	-	-

スウェーデン	-	-	-	-	11,630,489	-	11,623,366	7,123
・クローナ								
ニュージーラ	-	-	-	-	52,620,253	-	52,491,554	128,699
ンド・ドル								
ノルウェー	-	-	-	-	25,831,178	-	25,771,172	60,006
クローネ								
ポーランド	-	-	-	-	91,035,683	-	90,674,460	361,223
ズロチ								
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	108,926,260	-	108,144,361	781,899
ユーロ	342,932,188	-	341,128,996	1,803,192	59,391,349	-	58,708,932	682,417
合計	1,999,333,300	-	1,995,802,213	3,531,087	2,133,754,540	-	2,128,615,748	2,744,938

## (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	3.4304円	3.6429円
(1万口当たり純資産額)	(34,304円)	(36,429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	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	873,562.050	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	749,072.680	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	769,128.840	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	788,355.960	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,559,661.140	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,217,383.440	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	912,473.100	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	555,661.040	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	532,276.020	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	962,740.730	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,114,161.900	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,080,701.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,216,400.900	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,042,663.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	678,000.000	681,071.340	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,032,904.250	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,452,091.810	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,312,110.360			

4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,367,265.900	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,403,164.320	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,228,976.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,369,519.860	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,115,156.130	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,133,588.510	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,282,695.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,182,862.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,832,471.160	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,863,577.580	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,883,700.390	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,818,887.690	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,131,785.030	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,577,999.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,195,509.380	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,863,000.000	2,829,183.940	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,462,898.700	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,459,179.380	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	523,384.390	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,715,445.960	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	830,819.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,444,572.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,036,286.360	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,161,212.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,904,077.600	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,085,297.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	769,490.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,495,237.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,839,887.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,138,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,566,480.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,621,107.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,829,684.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,216,585.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,863,375.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,092,634.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,338,290.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,025,446.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,241,235.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,416,121.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,502,712.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,568,687.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,508,593.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,956,980.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,473,330.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,225,780.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,452,675.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,645,226.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,446,625.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,435,350.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,137,856.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,630,549.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,728,460.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,908,050.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,700,460.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,406,725.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,213,456.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,458,402.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,667,532.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,388,075.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,860,710.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,801,625.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,061,665.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,903,420.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,381,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,394,400.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,143,995.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,741,024.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	280,710.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,476,560.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,652,364.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,201,232.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	511,540.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,542,400.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,200,435.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,191,895.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,592,800.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,531,600.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,265,974.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,150,050.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,173,905.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,603,400.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,151,934.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,606,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,826,700.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,331,932.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,903,344.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,512,750.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,499,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,792,650.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,305,740.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,541,357.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,990,675.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,777,300.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,548,900.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,319,892.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,863,350.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,645,360.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,818,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,477,389.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,284,900.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,455,140.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,325,248.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,840,538.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,444,520.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,178,108.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,526,550.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,744,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,574,544.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,405,871.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,894,810.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,655,660.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,474,500.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,484,550.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,710,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,496,450.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,296,405.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,341,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,933,666.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,833,040.000	

1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,412,480.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,608,140.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,777,480.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,065,648.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,593,120.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,769,840.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,641,246.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,915,236.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,509,771.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,874,500.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,569,700.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,757,000.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,795,190.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,819,900.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,544,003.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,756,050.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,283,085.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,851,920.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,905,410.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,669,160.000	



2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,928,740.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,858,400.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,936,580.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,928,567.500	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,624,385.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,011,280.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,736,400.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,151,411.200	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,435,400.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,353,070.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,475,175.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,500,805.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,001,500.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,691,692.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,450,657.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,987,220.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,474,750.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,979,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,364,975.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,487,820.000	

3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,493,085.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,948,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,489,995.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,860,400.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,487,820.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,630,240.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,318,925.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,922,875.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,632,549.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,980,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,989,140.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,510,250.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,758,960.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,643,908.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,986,320.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,912,610.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,961,120.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,965,000.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,357,584.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,886,840.000	

3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,314,500.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,641,318.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,473,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,994,540.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,946,420.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,486,910.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,020,400.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,500,735.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,753,930.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,015,300.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,771,750.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,275,873.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,982,810.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,100,279.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,025,710.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,020,790.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,538,895.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,274,298.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,007,500.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,162,720.000	

4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,231,600.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,830,248.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,386,503.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,221,675.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,609,785.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,517,395.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,039,720.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,038,480.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,007,340.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,986,520.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,411,215.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	3,000,000.000	2,997,060.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,995,020.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,779,456.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	986,460.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	996,600.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	8,078,230.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,996,160.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,298,844.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	3,008,880.000	

4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,623,904.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	5,018,550.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,228,132.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,010,350.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,002,800.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,999,600.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,213,780.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,038,950.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,520,400.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,617,470.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,032,640.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,552,075.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,644,400.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	7,278,880.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,566,150.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,692,624.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,043,750.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,364,009.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,553,325.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,023,040.000	

4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,517,275.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	100,609.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,213,574.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,209,492.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,266,385.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,998,200.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,233,300.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,933,360.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	4,500,000.000	4,402,260.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,910,200.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,713,924.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,464,135.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,901,350.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	980,740.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,444,425.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	779,464.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,231,345.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,301,445.700	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,008,350.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	1,900,000.000	1,908,740.000	

	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,201,470.000	
	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,600,000.000	2,659,696.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,694,300.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,806,322.000	
アメリカ・ドル 小計			1,005,944,295.080 (151,112,952,007)	
イギリス・ポ ンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	786,109.580	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,404,773.850	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	980,830.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,079,380.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	935,100.300	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,430,719.100	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,377,120.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	778,128.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	698,775.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,150,000.000	586,845.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,299,780.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	730,660.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,057,680.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	2,750,000.000	830,142.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,437,060.000		

0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,423,104.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	679,252.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,554,110.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,955,875.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,500,000.000	739,800.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,520,990.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	861,768.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,372,497.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,344,194.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	4,000,000.000	3,049,920.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	648,180.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,917,548.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	299,086.800	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,994,600.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	933,400.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,433,236.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,100,500.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	871,700.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,226,774.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	2,000,000.000	2,058,600.000	



4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,505,100.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,879,993.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,080,000.000	1,014,876.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	1,500,000.000	1,487,385.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,102,541.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,100,000.000	1,100,165.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	900,000.000	883,440.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	805,104.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,020,099.080	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,050,212.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,351,512.600	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,809,850.560	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,575,271.320	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,275,980.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,239,884.800	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,079,816.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,389,056.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,247,835.020	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,793,758.200	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,593,664.800	

	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,034,740.120	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,519,439.500	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,315,630.400	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	2,020,147.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,096,048.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,285,951.200	
イギリス・ポンド 小計			87,875,741.930 (16,757,903,986)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,864,134.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,395,030.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,710,198.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,040,288.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,114,152.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,027,472.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,204,110.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	190,668.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,853,202.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	820,000.000	556,329.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,938,440.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	958,100.000	
3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,464,825.000		

イスラエル・シュケル 小計			21,316,948.000 (882,161,391)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,026,214.190	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,316,724.380	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,296,521.480	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,753,611.080	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,041,701.220	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,129,718.520	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	685,919.520	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,618,195.040	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,114,953.440	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	950,856.440	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,435,950.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,796,222.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,658,509.700	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,091,900.600	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,416,726.400	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,194,155.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,673,220.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	763,350.000		
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,026,525.000		

	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,128,492.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,332,784.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,537,310.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,913,240.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,491,792.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	896,886.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,094,709.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	800,000.000	791,368.000	
	オーストラリア・ドル 小計		40,177,555.010 (3,920,124,042)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,298,800.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,330,800.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,373,450.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,144,650.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,416,280.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,563,440.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,448,240.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	12,067,755.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,494,910.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,603,750.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,152,880.000	

3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,531,391.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,345,590.000	
3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,048,490.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,957,192.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,597,560.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	18,000,000.000	18,386,280.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,108,150.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,836,270.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,403,350.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,855,725.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,357,040.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,476,960.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	21,000,000.000	25,634,070.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,767,355.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,473,095.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,076,000.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,328,100.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,620,192.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,705,750.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,358,500.000	

3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,702,630.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,292,800.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,187,560.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,019,920.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	33,489,280.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,903,370.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,641,524.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	23,041,395.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,839,460.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,997,310.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,687,200.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,484,880.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,042,200.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,802,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,882,250.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	19,000,000.000	22,720,200.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,091,770.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	42,028,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,461,570.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,988,750.000	

2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	41,538,000.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,383,700.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,784,500.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,876,800.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	41,932,440.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,687,000.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	61,113,600.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	37,843,920.000	
2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,175,860.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	51,999,500.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,654,740.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,460,250.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,199,280.000	
1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,203,580.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	44,000,000.000	45,069,640.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,247,570.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,835,550.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,429,870.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,230,400.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,456,000.000	

	1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,306,600.000	
	1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,232,650.000	
	2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	44,302,720.000	
	1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,009,570.000	
	1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,994,300.000	
	1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,003,960.000	
	1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,999,350.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,003,040.000	
	オフショア・人民元 小計		1,702,042,074.000 (35,220,016,229)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	755,000.000	708,567.500	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,102,178.920	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,338,020.790	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,209,572.760	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,018,086.300	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,016,622.680	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,252,220.830	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	948,554.100	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,184,857.200	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	631,260.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,948,114.400	



2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,190,366.200	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,152,782.500	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,730,420.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,028,033.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	289,968.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,099,168.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,966,035.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,119,370.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,899,366.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,396,245.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	96,958.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,194,300.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,182,241.800	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,323,322.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	599,514.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,662,090.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	835,920.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,214,040.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,014,910.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,877,382.000	

	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,031,820.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,690,616.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,012,800.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,552,425.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	820,216.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	710,661.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	1,100,000.000	1,116,753.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,707,344.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	1,500,000.000	1,486,320.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	800,000.000	799,800.000	
	カナダ・ドル 小計		57,159,242.480 (6,118,896,907)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	784,738.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	814,905.700	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	397,600.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	594,582.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	629,206.250	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	681,959.360	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	445,770.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	712,500.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	548,350.000	

	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	615,979.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	458,190.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	559,080.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	421,000.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	194,350.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	237,720.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	668,670.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,350.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	402,200.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	607,080.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	315,198.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	110,704.000	
	シンガポール・ドル 小計		10,300,132.710 (1,152,481,849)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,261,949.300	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,090,034.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,894,813.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,390,849.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,102,976.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,492,650.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,971,660.000	

	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	1,200,000.000	1,228,632.000	
スウェーデン・クローナ 小計			33,433,564.400 (459,377,175)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,945,583.480	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,938,126.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,864,641.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,180,080.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	444,095.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	2,067,620.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,587.000	
デンマーク・クローネ 小計			31,490,732.480 (667,918,436)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	609,462.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,412,925.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	404,220.600	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	577,776.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	450,754.400	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	228,861.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	972,807.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	476,760.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	376,688.400	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	257,465.200	

	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	197,858.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	511,085.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	702,849.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	501,380.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,266,213.000	
ニュージーランド・ドル 小計			8,947,105.100 (792,802,983)	
ノルウェー・ク ローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,219,868.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,273,913.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,332,420.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,567,063.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,290,576.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,040,380.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,552,780.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,537,030.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,444,605.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,534,685.000	
ノルウェー・クローネ 小計			32,793,321.800 (444,677,444)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,218,377.520	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,988,168.800	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,348,740.000	

	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,405,850.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,022,526.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,409,202.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	487,340.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,407,900.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,187,000.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,877,000.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,966,940.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,328,190.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	1,985,220.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	904,870.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	847,666.730	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,403,917.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		43,788,908.050 (1,612,036,103)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,375,206.890	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,518,119.440	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,534,938.620	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,334,554.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,098.010	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,429,925.350	

3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,899,202.000	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,445,236.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,262,590.200	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,013,039.700	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,565,236.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,203,958.700	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,108,496.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,338,028.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,193,420.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	655,466.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,339,152.200	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,342,968.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,003,600.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,703,835.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,620,823.500	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,685,916.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,380,470.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,053,292.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,765.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,464,554.000	

	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,000,370.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,216,176.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	813,352.000	
マレーシア・リングgit 小計			46,758,789.610 (1,578,815,207)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,501,198.700	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	16,861,080.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,412,210.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	28,982,840.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,715,700.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	21,957,410.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,381,300.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,531,600.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,624,137.600	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,871,249.060	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,182,021.600	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,539,618.660	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,136,949.750	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,595,391.260	
7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,835,573.680		
メキシコ・ペソ 小計			300,128,280.310 (2,209,184,246)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	329,918.680	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	794,382.610	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	276,825.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	767,016.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	414,901.900	



0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	470,140.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	461,335.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	233,616.000	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	272,544.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	438,275.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	202,436.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	516,612.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	192,790.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	302,742.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	746,296.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	265,572.000	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	400,732.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	311,526.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,027,090.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	410,596.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	103,796.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	505,965.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	611,126.240	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	620,347.840	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	157,226.400	

0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,233,920.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	445,845.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,149,192.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,193,932.800	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	872,817.400	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	752,700.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	261,216.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	167,716.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,039,524.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	453,954.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	149,622.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,656,990.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,352,085.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	251,814.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	299,550.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,342,081.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	528,580.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,029,690.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	850,128.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	515,485.000	

3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	528,640.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	809,944.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,623,068.080	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	674,180.360	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,439,240.880	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	941,372.120	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	571,576.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,065,262.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	463,565.000	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	512,376.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,421,594.100	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	588,386.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,413,075.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	521,101.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	194,814.400	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	585,058.000	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,129,968.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,354,448.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	237,031.900	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,190,980.000	

1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	531,984.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	783,800.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,546,170.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	604,338.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	736,386.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,115,158.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	1,040,650.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,915.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,301,496.750	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,404,489.920	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,044,325.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,354,622.880	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,662,873.040	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,838,261.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	771,000.000	915,431.430	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,425,000.000	3,008,455.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,291,254.230	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,330,118.520	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,785,096.760	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,764,031.460	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,092,350.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,343,528.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,125,750.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,187,239.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,807,125.900	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,823,069.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,872,696.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,404,088.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,754,030.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,596,199.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,590,925.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,682,478.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,894,600.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,621,152.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,081,056.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,692,615.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,871,088.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,861,060.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	954,074.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,409,616.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	616,847.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,308,242.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,366,128.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,649,240.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,096,364.500	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,226,432.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,452,152.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,737,723.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	893,800.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,506,224.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,537,200.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,426,688.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,800,000.000	1,865,520.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	500,000.000	518,230.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,654,595.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,123,752.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,784.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	804,416.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	810,560.000	
2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,012,590.000	

2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,111.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,142,866.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,704,660.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,966,576.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,955,450.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	423,653.200	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	101,079.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,900.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,761.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,108,646.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,262.300	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,739,637.740	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,227,000.000	2,701,751.860	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,091,486.350	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	3,280,258.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,612,681.960	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,687,167.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,913,819.710	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,711,081.100	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,168,397.390	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,088,000.000	1,086,694.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,085,626.510	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,790,784.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,282,545.530	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,470,358.980	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	903,061.830	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,901,527.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,340,677.700	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,301,400.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,011,746.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,116,554.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,470,251.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,643,892.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,965,958.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	6,350,000.000	5,832,221.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,718,974.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,503,362.100	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,921,610.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,488,190.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,299,700.000	



0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	561,467.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,000,000.000	1,831,230.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,835,388.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,800,000.000	4,573,776.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,378,858.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,950,560.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,390,970.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,092,009.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,882,577.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	896,610.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,940,883.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,218,336.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,670,242.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,351,557.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,367,136.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	665,238.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,118,972.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,158,540.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	1,010,580.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	2,700,000.000	2,722,329.000	

5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,258,287.470	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,044,820.700	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,031,817.060	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,496,391.120	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,027,301.840	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	134,783.220	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,132,394.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,290,316.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,105,188.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	906,432.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,244,586.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,207,333.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	661,287.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,128,725.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	653,661.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	827,424.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	97,700.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	528,852.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,087,956.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	915,507.000	

2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,324,986.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	670,698.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	1,014,300.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,213,973.700	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,670,596.240	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,403,490.720	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,899,201.150	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,882,500.460	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,366,246.000	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,364,478.280	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,082,420.200	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,048,220.640	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	774,758.160	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,432,815.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,508,142.700	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,572,400.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,683,044.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,226,212.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,077,572.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,584,119.000	

3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,284,312.900	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,464,964.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,957,797.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,095,947.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,179,700.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,776,538.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,283,542.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,220,330.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,240,695.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,813,540.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,968,939.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,120,096.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,665,337.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,167,405.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,689,708.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	799,032.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	531,153.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,772,396.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,556,820.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,527,922.000	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,067,704.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	660,000.000	437,943.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	747,520.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,669,929.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,987,904.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	868,430.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,389,322.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	580,616.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	292,191.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	807,736.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,546,208.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,244,892.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	201,736.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,608,855.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,340,953.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,083,220.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	316,701.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,546,680.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,753,408.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	885,768.000	

3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	509,805.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	965,754.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,258,284.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,303,553.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	732,340.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	923,931.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,276,799.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,597,635.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	636,408.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,678.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,036,990.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,127,620.000	
3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	100,927.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	412,732.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	737,709.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	53,278.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	500,000.000	516,780.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,541,445.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,280.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	525,335.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	203,090.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	744,198.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,317,290.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	806,968.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,408,630.740	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,385,010.860	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,156,577.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,644,952.040	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,924,867.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,796,737.360	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,610,493.120	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,125,517.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,606,439.100	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,072,132.090	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,418,578.020	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,541,187.300	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,291,768.640	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,104,000.000	1,278,763.200	

4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,031,070.040	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	856,689.600	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	705,718.220	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	769,312.890	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	973,329.630	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	839,063.750	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,056,604.560	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	500,885.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	770,960.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	692,385.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	714,172.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	909,549.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	476,502.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	284,140.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	479,075.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	714,376.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	685,992.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	290,984.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	86,325.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	212,086.000	
2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	305,151.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	911,550.750	



4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,586,144.520	
4.85% Austria Government Bond 20260315	300,000.000	310,194.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	413,008.960	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	760,364.640	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	763,482.750	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	397,441.300	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	398,599.520	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,040,624.080	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,002,382.640	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,724,719.010	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,837,495.680	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,050,000.000	1,044,141.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,590,181.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,870,854.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,706,512.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,006,048.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,333,760.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,980,044.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,813,116.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,542,336.000	

1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	2,046,577.500	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,492,124.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,316,185.600	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	843,822.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	400,000.000	385,596.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,243,208.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	982,774.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	486,995.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,893,298.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	358,416.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,329,650.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	542,059.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,659,783.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	424,200.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	859,023.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,839,411.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,178,592.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,355,164.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,692,758.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,023,580.000	

3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,694,796.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,318,607.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,290,197.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,598,055.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	629,124.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,704,260.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,338.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,101,780.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,688,704.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	400,000.000	413,960.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,892.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,656,397.110	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,976,091.480	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,255,407.620	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,358,760.960	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,082,624.900	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,957,389.900	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,655,705.400	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	550,000.000	628,177.000	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	714,863.600	

	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	851,482.800	
	3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	684,967.500	
	2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,306,084.000	
	4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	470,000.000	545,298.700	
	2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	706,543.200	
	1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	995,420.000	
	0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	818,505.000	
	0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	599,056.400	
	0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	550,000.000	460,938.500	
	1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	530,000.000	332,961.900	
	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	658,860.000	
	1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	394,903.600	
	1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	543,751.500	
	3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	539,100.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	648,043.200	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	261,084.000	
	ユーロ 小計		610,542,093.650 (96,624,391,741)	
	国債証券 合計		319,553,739,746 [319,553,739,746]	
	合計		319,553,739,746 [319,553,739,746]	

- (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 282銘柄	100%	47.5%
イギリス・ポンド	国債証券 61銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 79銘柄	100%	11.0%
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.1%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 15銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 401銘柄	100%	30.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン J - R E I T 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8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,528,777	3,696,413
親投資信託受益証券	1,587,270,788	1,949,180,390
未収入金	800,000	880,000
流動資産合計	1,592,599,565	1,953,756,803
資産合計	1,592,599,565	1,953,756,803
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,703,290	1,401,847
未払受託者報酬	171,321	215,910
未払委託者報酬	1,628,014	2,051,554
その他未払費用	42,743	53,891
流動負債合計	4,545,368	3,723,202
負債合計	4,545,368	3,723,202
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,230,899,425	1,611,185,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	357,154,772	338,848,009
（分配準備積立金）	166,740,806	142,356,776
元本等合計	1,588,054,197	1,950,033,601
純資産合計	1,588,054,197	1,950,033,601
負債純資産合計	1,592,599,565	1,953,756,803

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		4,120
有価証券売買等損益		40,170,553		101,840,398
<b>営業収益合計</b>		<b>40,170,553</b>		<b>101,836,278</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,036		45
受託者報酬		343,024		403,232
委託者報酬		3,259,521		3,831,425
その他費用		85,579		100,641
<b>営業費用合計</b>		<b>3,689,160</b>		<b>4,335,343</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>43,859,713</b>		<b>106,171,621</b>
経常利益又は経常損失（ ）		43,859,713		106,171,621
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>43,859,713</b>		<b>106,171,621</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		16,455,728		6,301,011
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>409,249,059</b>		<b>357,154,772</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		75,446,672		144,562,752
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>75,446,672</b>		<b>144,562,752</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		100,136,974		62,998,905
<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>100,136,974</b>		<b>62,998,905</b>
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>357,154,772</b>		<b>338,848,009</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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,264,409,915円	1,230,899,425円
期中追加設定元本額	281,356,784円	605,515,174円
期中一部解約元本額	314,867,274円	225,229,007円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,230,899,425口	1,611,185,592口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(360,351,979円)及び分配準備積立金(166,740,806円)より分配対象額は527,092,785円(1万口当たり4,282.18円)であり、分配を行っておりません。	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(547,582,115円)及び分配準備積立金(142,356,776円)より分配対象額は689,938,891円(1万口当たり4,282.18円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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	28,114,153	99,327,426
合計	28,114,153	99,327,426

## (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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2902円 (12,902円)	1.2103円 (12,103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	627,169,597	1,949,180,390	
親投資信託受益証券 合計			1,949,180,390	
合計			1,949,180,390	

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

	2023年11月30日現在 金額 (円)	2024年12月2日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,024,339,250	7,060,487,249

投資証券	2	416,780,111,300	265,597,237,527
未収入金		500,241,718	597,306,501
未収配当金		2,682,217,341	2,174,967,845
前払金		365,680,000	385,784,000
差入委託証拠金		-	501,289,457
流動資産合計		428,352,589,609	276,317,072,579
資産合計		428,352,589,609	276,317,072,579
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		254,296,000	420,000,000
未払金		158,646,863	89,365,335
未払解約金		901,360,000	936,294,800
流動負債合計		1,314,302,863	1,445,660,135
負債合計		1,314,302,863	1,445,660,135
純資産の部			
元本等			
元本	1	129,201,842,129	88,442,480,672
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		297,836,444,617	186,428,931,772
元本等合計		427,038,286,746	274,871,412,444
純資産合計		427,038,286,746	274,871,412,444
負債純資産合計		428,352,589,609	276,317,072,579

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	147,448,613,818円	129,201,842,129円
期中追加設定元本額	17,185,276,767円	6,916,802,022円
期中一部解約元本額	35,432,048,456円	47,676,163,479円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	4,187,074,945円	3,447,380,821円
ダイワJ - REITオープン （毎月分配型）	111,110,413,487円	68,080,584,803円
ダイワJ - REITオープン （年1回決算型）	438,845,892円	733,610,640円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	20,503,299円	25,489,842円
iFree J - REITイン デックス	649,355,691円	608,076,523円
iFree 8資産バランス	2,374,516,718円	3,271,469,481円
ダイワJ - REITオープン （奇数月決算型）	1,824,743円	105,330,975円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	53,164円	372,978円
DC・ダイワJ - REITオー プン	5,467,205,540円	5,229,181,761円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	8,378,112円	9,857,945円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	8,435,457円	10,759,137円
ダイワ国内REITインデッ クス（投資一任専用）	3,341,234円	5,620,035円

	ダイワ・ノーロード J - R E I T ファンド	99,575,641円	85,920,670円
	ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス	2,923,082,696円	4,295,944,821円
	ダイワ J - R E I T インデックス(ダイワ S M A 専用)	542,727,874円	1,203,034,471円
	ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス	480,234,415円	627,169,597円
	スタイル9(6資産分散・保守型)	-円	73,264円
	スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	2,749,656円
	スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	1,481,277円
	スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	98,681円
	スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	2,036,590円
	スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	1,088,616円
	ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T	886,273,221円	695,148,088円
計		129,201,842,129円	88,442,480,672円
2.	期末日における受益権の総数	129,201,842,129口	88,442,480,672口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,922,750,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 706,000,000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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2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	7,027,830,470	16,135,828,789
合計	7,027,830,470	16,135,828,789

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	10,588,480,000	-	10,334,800,000	253,680,000	9,695,784,000	-	9,276,400,000	419,384,000
合計	10,588,480,000	-	10,334,800,000	253,680,000	9,695,784,000	-	9,276,400,000	419,384,000

(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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	3.3052円	3.1079円
(1万口当たり純資産額)	(33,052円)	(31,079円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,118	691,945,800	
	サンケイリアルエステート	8,856	663,314,400	
	SOSILA物流リート投	13,793	1,467,575,200	
	東海道リート投資法	4,723	494,025,800	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	9,546	5,498,496,000	
	森ヒルズリート	32,508	4,056,998,400	
	産業ファンド	50,616	5,765,162,400	
	アドバンス・レジデンス	27,169	7,965,950,800	
	A P I 投資法人	13,437	4,313,277,000	
	G L P 投資法人	92,858	11,811,537,600	
	コンフォリア・レジデンシャル	13,997	3,997,543,200	
	日本プロロジスリート	48,158	11,346,024,800	
	星野リゾート・リート	11,692	2,580,424,400	
	O n e リート投資法人	4,822	1,094,111,800	
	イオンリート投資	33,911	4,269,394,900	
	ヒューリックリート投資法	24,428	3,234,267,200	
	日本リート投資法人	8,979	2,828,385,000	
	積水ハウス・リート投資	83,070	6,055,803,000	
	トーセイ・リート投資法人	6,010	742,836,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	6,816	712,953,600	
	サムティ・レジデンシャル	7,532	692,944,000	
	野村不動産マスターF	88,492	12,495,070,400	
	いちごホテルリート投資	4,575	664,747,500	
	ラサールロジポート投資	35,393	5,022,266,700	
	スターアジア不動産投	50,944	2,562,483,200	
	マリモ地方創生リート	5,020	555,714,000	
	三井不ロジパーク	60,259.944	6,104,332,327	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法 人	5,836	384,008,800	
	投資法人みらい	38,067	1,526,486,700	
	三菱地所物流REIT	9,546	3,298,143,000	
	CREロジスティクスファンド	11,901	1,674,470,700	
	ザイマックス・リート	4,733	527,256,200	
タカラレーベン不動産投	18,054	1,534,590,000		
日本ビルファンド	161,249	20,220,624,600		

ジャパンリアルエステイト	28,396	15,731,384,000	
日本都市ファンド投資法人	143,348	12,958,659,200	
オリックス不動産投資	55,082	9,143,612,000	
日本プライムリアルティ	18,906	6,220,074,000	
NTT都市開発リート投資法人	28,099	3,192,046,400	
東急リアル・エステート	18,535	2,915,555,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	20,020	1,951,950,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	61,839	8,465,759,100	
森トラストリート投資法人	53,286	3,255,774,600	
インヴィンシブル投資法人	152,312	9,702,274,400	
フロンティア不動産投資	10,257	4,031,001,000	
平和不動産リート	20,270	2,373,617,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,574	4,877,532,400	
福岡リート投資法人	15,598	2,213,356,200	
KDX不動産投資法人	77,341	11,345,924,700	
いちごオフィスリート投資法人	20,171	1,587,457,700	
大和証券オフィス投資法人	11,454	3,381,220,800	
阪急阪神リート投資法人	13,181	1,552,721,800	
スターツプロシード投資法人	4,792	817,994,400	
大和ハウスリート投資法人	41,459	9,606,050,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	101,560	6,967,016,000	
大和証券リビング投資法人	40,830	3,682,866,000	
ジャパンエクセレント投資法人	23,738	2,770,224,600	
投資証券 合計		265,597,237,527	
合計		265,597,237,527	

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。

野村不動産マスターF 5,000口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,142,397	1,915,893
親投資信託受益証券	891,102,376	1,062,175,288
未収入金	370,000	690,000
流動資産合計	893,614,773	1,064,781,181
資産合計	893,614,773	1,064,781,181
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,071,224	864,985
未払受託者報酬	93,492	112,743
未払委託者報酬	1,286,246	1,550,727
その他未払費用	23,298	34,040
流動負債合計	2,474,260	2,562,495
負債合計	2,474,260	2,562,495
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 892,484,246	<sup>1</sup> 908,115,457
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 1,343,733	<sup>2</sup> 154,103,229
（分配準備積立金）	142,992,385	109,499,851
元本等合計	891,140,513	1,062,218,686
純資産合計	891,140,513	1,062,218,686
負債純資産合計	893,614,773	1,064,781,181

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		1,563
有価証券売買等損益		55,089,335		158,990,912
営業収益合計		55,089,335		158,992,475
<b>営業費用</b>				
支払利息		342		8
受託者報酬		186,595		215,119
委託者報酬		2,566,939		2,958,906
その他費用		52,438		65,498
営業費用合計		2,806,314		3,239,531
営業利益又は営業損失( )		57,895,649		155,752,944
経常利益又は経常損失( )		57,895,649		155,752,944
当期純利益又は当期純損失( )		57,895,649		155,752,944
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( )		4,547,412		14,847,198
期首剰余金又は期首欠損金( )		58,648,768		1,343,733
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,900,788		15,694,947
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,900,788		15,694,947
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,545,052		1,153,731
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,545,052		1,153,731
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,343,733		154,103,229

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	796,904,885円	892,484,246円
期中追加設定元本額	244,526,761円	252,406,519円
期中一部解約元本額	148,947,400円	236,775,308円
2. 計算期間末日における受益権の総数	892,484,246口	908,115,457口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,343,733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7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2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(212,721,154円)及び分配準備積立金(142,992,385円)より分配対象額は355,713,539円(1万口当たり3,985.66円)であり、分配を行っておりません。</p>	<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(1,533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(252,446,531円)及び分配準備積立金(109,498,318円)より分配対象額は361,946,382円(1万口当たり3,985.69円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、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8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	52,853,930	148,638,230
合計	52,853,930	148,638,230

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	0.9985円	1.1697円
(1万口当たり純資産額)	(9,985円)	(11,697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	1,122,450,902	1,062,175,288	
親投資信託受益証券 合計			1,062,175,288	
合計			1,062,175,288	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2023年11月30日現在 金額 (円)	2024年12月2日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	204,867,307	271,305,535
コール・ローン	168,014,570	624,423,880
投資信託受益証券	290,216,878	278,839,206
投資証券	20,916,686,723	27,226,042,081
派生商品評価勘定	415,959,236	19,006,137
未収入金	2,295,148	335,802,064
未収配当金	36,022,464	32,482,591
差入委託証拠金	322,735,371	505,976,998
流動資産合計	22,356,797,697	29,293,878,492
資産合計	22,356,797,697	29,293,878,492
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	63,170,376	26,449,695
未払金	64,002,805	737,106
未払解約金	370,000	2,610,000
流動負債合計	127,543,181	29,796,801
負債合計	127,543,181	29,796,801
純資産の部		
元本等		
元本	1 27,609,942,776	30,924,216,543
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 5,380,688,260	1,660,134,852
元本等合計	22,229,254,516	29,264,081,691
純資産合計	22,229,254,516	29,264,081,691
負債純資産合計	22,356,797,697	29,293,878,492

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	23,966,027,015円	27,609,942,776円
期中追加設定元本額	8,684,470,737円	10,771,745,433円
期中一部解約元本額	5,040,554,976円	7,457,471,666円

計	27,609,942,776円	30,924,216,543円
2. 期末日における受益権の総数	27,609,942,776口	30,924,216,543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5,380,688,260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1,660,134,852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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	11,321,410	7,932,082
投資証券	570,820,118	1,393,093,667
合計	559,498,708	1,401,025,749

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	670,411,589	-	692,742,792	22,331,203	1,668,369,387	-	1,662,333,621	6,035,766
合計	670,411,589	-	692,742,792	22,331,203	1,668,369,387	-	1,662,333,621	6,035,766

## (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	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	20,032,685,987	-	19,702,228,330	330,457,657	28,017,617,099	-	28,019,024,891	1,407,792
アメリカ・ドル	15,687,238,579	-	15,303,544,172	383,694,407	22,395,507,271	-	22,396,692,352	1,185,081
イギリス・ポンド	972,658,268	-	992,531,260	19,872,992	1,243,049,054	-	1,243,019,566	29,488
イスラエル・シェケル	27,624,871	-	29,356,796	1,731,925	40,052,394	-	40,120,949	68,555
オーストラリア・ドル	1,321,571,164	-	1,348,928,453	27,357,289	2,013,870,664	-	2,014,040,191	169,527
カナダ・ドル	326,535,264	-	325,331,163	1,204,101	373,094,744	-	373,143,720	48,976
シンガポール・ドル	721,803,008	-	723,092,592	1,289,584	858,121,267	-	858,060,465	60,802
ニュージーランド・ドル	67,290,105	-	69,771,830	2,481,725	32,118,178	-	32,126,591	8,413
ユーロ	642,895,116	-	650,695,468	7,800,352	819,147,343	-	819,104,230	43,113
香港・ドル	265,069,612	-	258,976,596	6,093,016	242,656,184	-	242,716,827	60,643
合計	20,032,685,987	-	19,702,228,330	330,457,657	28,017,617,099	-	28,019,024,891	1,407,792

## (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	0.8051円	0.9463円
(1万口当たり純資産額)	(8,051円)	(9,463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	18,910	1,856,205.600	
	アメリカ・ドル	小計		1,856,205.600 (278,839,206)	
投資信託受益証券 合計				278,839,206 [278,839,206]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	14,125	195,631.250	
		URBAN EDGE PROPERTIES	14,222	327,248.220	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	11,952	183,821.760	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,648	3,918,106.800	

SIMON PROPERTY GROUP INC	35,924	6,595,646.400	
BXP INC	17,031	1,396,371.690	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,973	141,201.320	
VORNADO REALTY TRUST	19,425	836,246.250	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,348	139,807.360	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,190	369,369.000	
UNITI GROUP INC	28,619	169,138.290	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,686	126,430.020	
EQUITY RESIDENTIAL	39,992	3,065,786.720	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	26,244	422,790.840	
EPR PROPERTIES	8,876	402,704.120	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	26,697.400	
GLOBAL NET LEASE INC	23,196	171,882.360	
EQUINIX INC	11,129	10,922,890.920	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,862	322,710.020	
CHATHAM LODGING TRUST	5,858	53,952.180	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,021	823,142.040	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14,940	259,956.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,201	60,498.900	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	24,944.400	
HOST HOTELS & RESORTS INC	82,337	1,516,647.540	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,881	1,412,173.490	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,233	66,347.050	
RLJ LODGING TRUST	17,979	183,565.590	
FARMLAND PARTNERS INC	5,044	64,109.240	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,293	91,637.650	
KIMCO REALTY CORP	79,017	2,020,464.690	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,392	65,714.880	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	42,553	779,570.960	
WHITESTONE REIT	5,164	76,014.080	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32,163	1,659,932.430	

PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,535	138,373.200	
PARK HOTELS & RESORTS INC	24,489	380,803.950	
INVITATION HOMES INC	66,780	2,287,215.000	
OUTFRONT MEDIA INC	16,148	310,203.080	
LAMAR ADVERTISING CO-A	10,301	1,380,540.020	
JBG SMITH PROPERTIES	10,140	173,292.600	
ALEXANDER & BALDWIN INC	8,512	167,516.160	
GLADSTONE LAND CORP	3,874	46,526.740	
AMERICOLD REALTY TRUST	30,643	731,141.980	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	28,289.700	
VICI PROPERTIES INC	122,746	4,002,747.060	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	28,124.120	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,321	362,055.420	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,552	700,823.200	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,826	90,439.240	
BROADSTONE NET LEASE INC	22,097	386,918.470	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,279	87,375.820	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,568	158,353.920	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	26,341	575,287.440	
PARAMOUNT GROUP INC	22,318	108,465.480	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15,767	172,806.320	
NETSTREIT CORP	9,070	147,024.700	
CTO REALTY GROWTH INC	2,544	51,923.040	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	25,677	1,080,488.160	
STAG INDUSTRIAL INC	21,346	785,319.340	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	23,453.790	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,551	36,147.670	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	14,359	567,180.500	
ORION OFFICE REIT INC	6,028	25,498.440	
DIGITAL CORE REIT UNITS	114,700	70,540.500	
VENTAS INC	48,428	3,102,781.960	

CARETRUST REIT INC	18,076	538,484.040	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,900	275,633.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	35,323	1,062,162.610	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,148	10,144.200	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	27,460	514,325.800	
UMH PROPERTIES INC	8,018	153,945.600	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	1,769	54,662.100	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,449	25,759.710	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	4,650	63,844.500	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	1,890	61,878.600	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	17,471	520,810.510	
LINEAGE INC	6,961	441,466.620	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,056	16,917.120	
CURBLINE PROPERTIES	11,053	268,145.780	
IRON MOUNTAIN INC	34,384	4,252,269.280	
TERRENO REALTY CORP	11,358	688,635.540	
SUN COMMUNITIES INC	13,737	1,735,395.210	
ACADIA REALTY TRUST	12,347	319,169.950	
ALEXANDER'S INC	274	61,269.140	
PROLOGIS INC	108,532	12,674,366.960	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,249	2,011,587.270	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,193	113,080.800	
SAUL CENTERS INC	1,434	58,951.740	
VERIS RESIDENTIAL INC	9,468	172,791.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,499	1,572,374.200	
COUSINS PROPERTIES INC	17,833	566,019.420	
SITE CENTERS CORP	5,526	85,763.520	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,703	982,113.630	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,526	2,336,521.960	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15,513	829,169.850	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,818	1,028,619.700	
GETTY REALTY CORP	5,843	192,117.840	
WELLTOWER INC	67,832	9,373,025.760	

HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,495	1,814,065.050	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,426	403,347.960	
SERVICE PROPERTIES TRUST	21,206	58,952.680	
EQUITY COMMONWEALTH	12,581	255,897.540	
KILROY REALTY CORP	12,384	514,307.520	
LTC PROPERTIES INC	5,098	196,731.820	
LXP INDUSTRIAL TRUST	34,501	322,584.350	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,700	2,248,992.000	
MACERICH CO/THE	25,318	536,994.780	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,863	1,559,487.790	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,092	390,301.800	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	21,528	946,801.440	
REALTY INCOME CORP	102,080	5,909,411.200	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	13,178	434,215.100	
PUBLIC STORAGE	18,463	6,426,047.150	
REGENCY CENTERS CORP	19,147	1,447,321.730	
SAFEHOLD INC	5,586	119,316.960	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12,818	473,881.460	
SL GREEN REALTY CORP	7,597	594,009.430	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	26,555	69,043.000	
UDR INC	35,181	1,613,400.660	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,629	68,727.510	
WP CAREY INC	25,652	1,463,703.120	
ELME	10,316	174,753.040	
AGREE REALTY CORP	11,768	903,782.400	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,223	1,227,356.030	
CUBESMART	26,397	1,308,235.320	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	23,835	256,226.250	
DIGITAL REALTY TRUST INC	36,075	7,059,516.750	
EXTRA SPACE STORAGE INC	24,842	4,246,988.320	
CENTERSPACE	1,793	129,992.500	
KITE REALTY GROUP TRUST	25,747	709,844.790	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	59,087.550	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,197	91,519.170	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24,294	225,448.320	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	70,337	308,779.430	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	22,165.550	
	DOUGLAS EMMETT INC	19,623	379,901.280	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	20,950.200	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	18,106.000	
	PRIME US REIT	75,240	12,414.600	
アメリカ・ドル 小計			145,184,841.390 (21,809,666,874)	
イギリス・ポ ンド	WAREHOUSE REIT PLC	48,892	40,922.600	
	HELICAL PLC	13,564	26,856.720	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	44,442	16,310.210	
	HAMMERSON REIT PLC	53,208	155,686.600	
	ASSURA PLC	348,996	138,062.810	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	74,712	65,746.560	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	51,354	31,428.640	
	CLS HOLDINGS PLC	20,382	16,570.560	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	64,471	44,291.570	
	REGIONAL REIT LTD	5,468	6,867.800	
	NEWRIVER REIT PLC	39,166	29,805.320	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	228,896	312,671.930	
	CUSTODIAN REIT PLC	51,902	41,884.910	
	PRS REIT PLC/THE	64,664	67,121.230	
	CARE REIT PLC	53,298	43,544.460	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46,825	28,656.900	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	72,687	61,057.080	
	AEW UK REIT PLC	20,041	19,399.680	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	146,049	104,132.930	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	58,444	63,820.840	
	HOME REIT PLC	84,338	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	87,295	526,388.850	
	SEGRO PLC	158,486	1,236,190.800	
UNITE GROUP PLC/THE	48,680	429,357.600		
BRITISH LAND CO PLC	116,886	454,452.760		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	47,602	143,758.040		
DERWENT LONDON PLC	13,160	278,202.400		

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	156,626	149,186.260	
	WORKSPACE GROUP PLC	16,213	91,279.190	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,605	190,629.220	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,018	246,752.960	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	239,330	464,300.200	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	55,879	27,883.620	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	290,714	404,383.170	
イギリス・ポンド 小計			5,957,604.420 (1,136,115,162)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	101,181	206,105.690	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	245,106.000	
	REIT 1 LTD	23,763	450,071.220	
イスラエル・シュケル 小計			901,282.910 (37,297,880)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	131,319	956,002.320	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	53,426	60,638.510	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	71,161	86,104.810	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	41,505	110,818.350	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	184,360	70,056.800	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65,118	191,446.920	
	RURAL FUNDS GROUP	50,015	93,528.050	
	WAYPOINT REIT	82,030	205,895.300	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	81,207	328,076.280	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	63,092.590	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	100,600	194,661.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	218,423	273,028.750	
	REGION GROUP	141,852	310,655.880	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	36,785	94,905.300	
	NATIONAL STORAGE REIT	167,311	418,277.500	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,925	72,428.250	
SCENTRE GROUP	634,283	2,334,161.440		

	ARENA REIT	47,510	196,691.400	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	26,446	97,850.200	
	BWP TRUST	67,950	230,350.500	
	GPT GROUP	233,879	1,113,264.040	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	63,158	216,631.940	
	MIRVAC GROUP	481,764	1,040,610.240	
	STOCKLAND	291,458	1,521,410.760	
	ABACUS GROUP UNIT	52,859	63,959.390	
	GOODMAN GROUP	213,327	8,087,226.570	
	VICINITY CENTRES	472,433	1,020,455.280	
	CHARTER HALL GROUP	57,750	907,830.000	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,782	231,199.100	
	オーストラリア・ドル 小計		20,591,257.470 (2,009,088,992)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,700	37,318.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5,725	92,287.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	55,238.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,600	53,856.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,100	131,705.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	36,900.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,700	79,128.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,800	288,800.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16,500	209,715.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,900	96,921.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,700	227,838.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	19,600	274,008.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	44,592.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6,500	100,035.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8,700	223,677.000	



	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,000	458,500.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	15,700	155,901.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	17,900	340,279.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,000	19,180.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,000	214,200.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,400	92,032.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,700	139,909.000	
	カナダ・ドル 小計		3,372,019.000 (360,974,634)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL DC REIT	14,344	0.000	
	KEPPEL DC REIT	166,800	370,296.000	
	AIMS APAC REIT	85,000	107,950.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	363,700	330,967.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,400	46,480.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	212,300	118,888.000	
	EC WORLD REIT	32,900	4,606.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	436,500	1,143,630.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	670,700	1,314,572.000	
	SUNTEC REIT	271,600	309,624.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	418,500	535,680.000	
	KEPPEL REIT	294,800	252,054.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	315,200	280,528.000	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	754,700	196,222.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	90,100	77,035.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	146,100	311,193.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	190,400	95,200.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	143,800	102,817.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000	182,400.000	

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	256,900	596,008.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	287,300	353,379.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	144,600	88,929.000	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	298,700	82,142.500	
シンガポール・ドル 小計			6,900,601.000 (772,108,246)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	127,754	265,728.320	
ニュージーランド・ドル 小計			265,728.320 (23,546,187)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,612	109,073.800	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	3,188	123,056.800	
	HAMBORNER REIT AG	8,268	53,493.960	
	WERELDHAVE NV	4,001	55,613.900	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,325	800,807.000	
	NSI NV	1,842	36,361.080	
	ICADE	3,301	73,480.260	
	CARMILA	5,717	94,330.500	
	ALTAREA	505	48,682.000	
	GECINA SA	5,365	511,552.750	
	KLEPIERRE	22,728	650,475.360	
	COVIVIO	5,513	286,676.000	
	MERCIALYS	9,081	95,168.880	
	AEDIFICA	4,893	284,038.650	
	COFINIMMO	3,920	222,656.000	
	RETAIL ESTATES	1,301	76,498.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,192	380,576.640	
	CARE PROPERTY INVEST	4,054	49,620.960	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,623	111,407.250	
	MONTEA NV	2,185	145,739.500	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	16,723.980		
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5,518	45,523.500		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	35,781	195,364.260		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	40,604	422,281.600		

	CROMWELL REIT EUR	36,800	59,616.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58,308	53,060.280	
ユーロ 小計			5,001,879.710 (791,597,483)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	18,539	86,577,130.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,618	76,941,700.000	
	LOTTE REIT CO LTD	19,578	60,300,240.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	6,661	35,369,910.000	
	JR REIT XXVII	23,768	70,828,640.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,929	25,465,055.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20,694	99,331,200.000	
韓国・ウォン 小計			454,813,875.000 (48,847,010)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291,000	285,180.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	96,000	173,760.000	
	FORTUNE REIT	183,000	732,000.000	
	LINK REIT	314,600	10,649,210.000	
	CHAMPION REIT	254,000	429,260.000	
香港・ドル 小計			12,269,410.000 (236,799,613)	
投資証券 合計			27,226,042,081 [27,226,042,081]	
合計			27,504,881,287 [27,504,881,287]	

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 140銘柄	1.3%	98.7%	80.3%
イギリス・ポンド	投資証券	34銘柄	-%	100%	4.1%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	29銘柄	-%	100%	7.3%
カナダ・ドル	投資証券	22銘柄	-%	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券	23銘柄	-%	100%	2.8%
ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券	26銘柄	-%	100%	2.9%
韓国・ウォン	投資証券	7銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券	5銘柄	-%	100%	0.9%

## 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オンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年12月1日から2024年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年11月30日現在	第8期 2024年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,164,856	2,641,288
親投資信託受益証券	905,355,753	1,468,963,214
未収入金	475,000	880,000
流動資産合計	907,995,609	1,472,484,502
資産合計	907,995,609	1,472,484,502
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,110,827	1,086,247
未払受託者報酬	96,547	156,588
未払委託者報酬	1,328,190	2,153,665
その他未払費用	24,054	39,075
流動負債合計	2,559,618	3,435,575
負債合計	2,559,618	3,435,575
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,614,846,205	1,781,836,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	290,589,786	687,212,782
（分配準備積立金）	181,455,216	415,709,937
元本等合計	905,435,991	1,469,048,927
純資産合計	905,435,991	1,469,048,927
負債純資産合計	907,995,609	1,472,484,502

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日		自 2023年12月1日 至 2024年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		2,270
有価証券売買等損益		50,330,140		298,613,461
営業収益合計		50,330,140		298,615,731
<b>営業費用</b>				
支払利息		318		8
受託者報酬		183,746		272,051
委託者報酬		2,527,830		3,741,846
その他費用		45,770		67,855
営業費用合計		2,757,664		4,081,760
営業利益又は営業損失（ ）		47,572,476		294,533,971
経常利益又は経常損失（ ）		47,572,476		294,533,971
当期純利益又は当期純損失（ ）		47,572,476		294,533,971
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,131,987		25,567,925
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		228,293,160		290,589,786
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,161,971		199,413,244
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		56,161,971		199,413,244
剰余金減少額又は欠損金増加額		39,305,834		71,756,294
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		39,305,834		71,756,294
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		290,589,786		687,212,782

## (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8期	
	自2023年12月1日 至2024年12月2日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2024年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年12月2日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首元本額	563,974,089円	614,846,205円
期中追加設定元本額	149,533,418円	310,734,109円
期中一部解約元本額	98,661,302円	143,744,169円
2. 計算期間末日における受益権の総数	614,846,205口	781,836,145口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第7期	第8期
	自2022年12月1日 至2023年11月30日	自2023年12月1日 至2024年12月2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(35,532,221円)、投資信託約款に規定される収益調整金(160,837,463円)及び分配準備積立金(145,922,995円)より分配対象額は342,292,679円(1万口当たり5,567.13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(2,220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(268,963,557円)、投資信託約款に規定される収益調整金(288,510,798円)及び分配準備積立金(146,744,160円)より分配対象額は704,220,735円(1万口当たり9,007.27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8期 自2023年12月1日 至2024年12月2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。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期
	2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2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	48,690,472	282,976,921
合計	48,690,472	282,976,921

## (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7期	第8期
2023年11月30日現在	2024年12月2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8期
自2023年12月1日
至2024年12月2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7期	第8期
	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.4726円	1.8790円
(1万口当たり純資産額)	(14,726円)	(18,790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	348,914,091	1,468,963,214	
親投資信託受益証券 合計			1,468,963,214	
合計			1,468,963,214	

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

	2023年11月30日現在 金額(円)	2024年12月2日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		521,486,479	542,559,096
コール・ローン		264,510,296	414,916,867
投資信託受益証券		1,224,352,455	2,335,702,280
投資証券		32,271,184,951	45,631,535,219
派生商品評価勘定		17,911,189	12,193,806
未収入金		1,097,216	2,391,344
未収配当金		54,636,716	54,028,433
差入委託証拠金		251,998,169	550,543,477
流動資産合計		34,607,177,471	49,543,870,522
資産合計		34,607,177,471	49,543,870,522
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,643,851	45,352,151
未払金		64,302,455	96,147,875
未払解約金		17,087,000	5,011,800
流動負債合計		91,033,306	146,511,826
負債合計		91,033,306	146,511,826
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,495,625,942	11,733,194,875
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		24,020,518,223	37,664,163,821
元本等合計		34,516,144,165	49,397,358,696
純資産合計		34,516,144,165	49,397,358,696
負債純資産合計		34,607,177,471	49,543,870,522

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年12月1日 至2024年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

## (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券につい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。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

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

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

<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、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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1. 1 期首	2022年12月1日	2023年12月1日
期首元本額	9,066,118,780円	10,495,625,942円
期中追加設定元本額	2,238,016,506円	2,195,066,692円
期中一部解約元本額	808,509,344円	957,497,759円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01	93,059,749円	82,616,918円
（適格機関投資家専用）		
ダイワファンドラップ 外国RE	1,708,228,155円	2,204,202,511円
ITインデックス（為替ヘッジ		
なし）		
ダイワファンドラップオンライ	275,301,269円	348,914,091円
ン 外国REITインデックス		
（為替ヘッジなし）		
D - I ' s グローバルREIT	1,638,253円	1,445,976円
インデックス		
DCダイワ・ターゲットイヤー	17,641,872円	19,067,880円
2050		
i F r e e 外国REITイン	718,741,519円	642,354,449円
デックス		
i F r e e 8資産バランス	2,427,391,242円	2,473,326,927円

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	376,775,346円	396,610,437円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	249,457,006円	232,186,406円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	607,839円	3,633,741円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,041,015,425円	4,434,965,999円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,380,081円	7,257,662円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,649,739円	8,063,452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)	3,207,527円	4,337,231円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	144,489,423円	130,015,618円
スタイル9(6資産分散・保守型)	-円	34,142円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	1,707,350円
スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	1,422,835円
スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	42,365円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	1,125,932円
スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	1,150,162円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	248,223,853円	194,322,966円
ダイワ・ノーロードグローバルREITファンド	67,053,492円	61,954,074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)	13,068,046円	241,636,478円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	92,696,106円	82,346,237円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資家専用)	-円	79,777,774円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資家専用)	-円	78,675,262円

計	10,495,625,942円	11,733,194,875円
2. 期末日における受益権の総数	10,495,625,942口	11,733,194,875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2023年12月1日 至2024年12月2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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年12月2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あります。

(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	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	61,881,850	129,301,399
投資証券	1,504,754,960	7,363,524,623
合計	1,442,873,110	7,492,826,022

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)		(円)		(円)	
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	1,015,541,639	-	1,027,092,345	11,550,706	1,519,101,970	-	1,485,938,206	33,163,764
合計	1,015,541,639	-	1,027,092,345	11,550,706	1,519,101,970	-	1,485,938,206	33,163,764

(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	2023年11月30日現在				2024年12月2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	245,130,366	-	241,846,998	3,283,368	452,331,868	-	452,337,287	5,419
アメリカ・ドル	170,188,396	-	166,000,842	4,187,554	289,899,632	-	289,913,600	13,968
ユーロ	74,941,970	-	75,846,156	904,186	162,432,236	-	162,423,687	8,549
合計	245,130,366	-	241,846,998	3,283,368	452,331,868	-	452,337,287	5,419

### (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)

	2023年11月30日現在	2024年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,2886円 (32,886円)	4,2101円 (42,101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	158,400	15,548,544.000	
	アメリカ・ドル 小計			15,548,544.000 (2,335,702,280)	
投資信託受益証券 合計				2,335,702,280 [2,335,702,280]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,085	319,727.250	
		URBAN EDGE PROPERTIES	23,660	544,416.600	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,880	305,754.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,697	6,518,488.950	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	59,930	11,003,148.000	
		BXP INC	28,362	2,325,400.380	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,900	220,116.000	
		VORNADO REALTY TRUST	32,400	1,394,820.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18,648	229,743.360	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,656	615,885.600	
		UNITI GROUP INC	46,942	277,427.220	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,188	197,129.160	
		EQUITY RESIDENTIAL	66,657	5,109,925.620	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,798	705,585.780	
		EPR PROPERTIES	14,806	671,748.220	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	43,500.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	37,994	281,535.540	
		EQUINIX INC	18,506	18,163,268.880	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18,098	537,691.580	
CHATHAM LODGING TRUST	8,953	82,457.130			

RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,643	1,365,025.320	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	24,893	433,138.200	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,748	89,737.200	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	37,080.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	137,386	2,530,650.120	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	61,489	2,354,413.810	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,116	104,396.600	
RLJ LODGING TRUST	29,435	300,531.350	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	100,866.560	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	13,053	144,235.650	
KIMCO REALTY CORP	131,785	3,369,742.450	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,995	106,635.550	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	71,003	1,300,774.960	
WHITESTONE REIT	8,817	129,786.240	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	53,636	2,768,153.960	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	23,773	226,318.960	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,784	634,191.200	
INVITATION HOMES INC	111,425	3,816,306.250	
OUTFRONT MEDIA INC	26,900	516,749.000	
LAMAR ADVERTISING CO-A	17,100	2,291,742.000	
JBG SMITH PROPERTIES	16,561	283,027.490	
ALEXANDER & BALDWIN INC	13,894	273,433.920	
GLADSTONE LAND CORP	6,132	73,645.320	
AMERICOLD REALTY TRUST	51,043	1,217,885.980	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	43,262.730	
VICI PROPERTIES INC	204,800	6,678,528.000	
BRT APARTMENTS CORP	2,049	41,102.940	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,539	603,861.780	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,295	1,169,459.500	

PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,517	140,868.580	
BROADSTONE NET LEASE INC	36,819	644,700.690	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,816	136,969.280	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,128	259,600.320	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	43,931	959,453.040	
PARAMOUNT GROUP INC	35,039	170,289.540	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,774	282,483.040	
NETSTREIT CORP	14,791	239,762.110	
CTO REALTY GROWTH INC	3,700	75,517.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	42,824	1,802,033.920	
STAG INDUSTRIAL INC	35,577	1,308,877.830	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	36,960.740	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,925	55,617.250	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	23,963	946,538.500	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	38,273.040	
DIGITAL CORE REIT UNITS	169,000	103,935.000	
VENTAS INC	80,745	5,173,332.150	
CARETRUST REIT INC	32,800	977,112.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	14,800	458,356.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	58,891	1,770,852.370	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	12,802.350	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	45,776	857,384.480	
UMH PROPERTIES INC	13,139	252,268.800	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	87,014.400	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	6,019	34,850.010	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,900	94,737.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,829	92,621.460	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	29,100	867,471.000	
LINEAGE INC	11,600	735,672.000	

MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	25,632.000	
CURBLINE PROPERTIES	18,444	447,451.440	
IRON MOUNTAIN INC	57,313	7,087,898.710	
TERRENO REALTY CORP	18,927	1,147,544.010	
SUN COMMUNITIES INC	22,907	2,893,841.310	
ACADIA REALTY TRUST	20,544	531,062.400	
ALEXANDER'S INC	393	87,878.730	
PROLOGIS INC	181,100	21,148,858.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,360	3,346,582.800	
BRANDYWINE REALTY TRUST	33,041	185,029.600	
SAUL CENTERS INC	2,261	92,949.710	
VERIS RESIDENTIAL INC	15,496	282,802.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	20,768	2,612,614.400	
COUSINS PROPERTIES INC	29,716	943,185.840	
SITE CENTERS CORP	9,022	140,021.440	
EASTGROUP PROPERTIES INC	9,442	1,626,006.820	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,467	3,870,504.820	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,842	1,381,254.900	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,663	1,710,438.950	
GETTY REALTY CORP	9,698	318,870.240	
WELLTOWER INC	113,135	15,632,994.300	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	137,640	3,026,703.600	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,674	671,078.040	
SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	84,459.180	
EQUITY COMMONWEALTH	20,957	426,265.380	
KILROY REALTY CORP	20,667	858,300.510	
LTC PROPERTIES INC	8,490	327,629.100	
LXP INDUSTRIAL TRUST	57,532	537,924.200	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,791	3,741,370.560	
MACERICH CO/THE	46,000	975,660.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,466	2,601,119.780	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,456	648,152.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	35,842	1,576,331.160	
REALTY INCOME CORP	170,316	9,859,593.240	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	21,964	723,713.800	
PUBLIC STORAGE	30,803	10,720,984.150	

	REGENCY CENTERS CORP	31,907	2,411,850.130	
	SAFEHOLD INC	8,705	185,938.800	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	21,335	788,754.950	
	SL GREEN REALTY CORP	13,762	1,076,050.780	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,467	105,214.200	
	UDR INC	58,660	2,690,147.600	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,429	102,479.510	
	WP CAREY INC	42,776	2,440,798.560	
	ELME	16,897	286,235.180	
	AGREE REALTY CORP	19,586	1,504,204.800	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,353	2,044,835.330	
	CUBESMART	44,011	2,181,185.160	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,752	427,334.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	60,204	11,781,320.760	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	41,421	7,081,334.160	
	CENTERSPACE	2,959	214,527.500	
	KITE REALTY GROUP TRUST	42,907	1,182,945.990	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	86,962.440	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,128	143,134.080	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	40,119	372,304.320	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,379	515,293.810	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	30,569.550	
	DOUGLAS EMMETT INC	32,658	632,258.880	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	35,191.180	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	29,766.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	25,726.800	
	アメリカ・ドル 小計		241,837,878.600 (36,328,886,123)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	65,094.320	
	HELICAL PLC	20,666	40,918.680	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	22,394.700	
	HAMMERSON REIT PLC	91,676	268,243.970	

	ASSURA PLC	601,321	237,882.580	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	121,852	107,229.760	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	47,109.310	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	24,110.320	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	77,232.540	
	REGIONAL REIT LTD	31,830	39,978.480	
	NEWRIVER REIT PLC	59,545	45,313.740	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	400,976	547,733.210	
	CUSTODIAN REIT PLC	90,504	73,036.720	
	PRS REIT PLC/THE	102,467	106,360.740	
	CARE REIT PLC	78,863	64,431.070	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	38,514.990	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	125,239	105,200.760	
	AEW UK REIT PLC	27,617	26,733.250	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	255,846	182,418.190	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	95,301	104,068.690	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,922	922,119.660	
	SEGREO PLC	277,633	2,165,537.400	
	UNITE GROUP PLC/THE	85,276	752,134.320	
	BRITISH LAND CO PLC	204,758	796,099.100	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	82,018	247,694.360	
	DERWENT LONDON PLC	23,052	487,319.280	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	269,866	257,047.360	
	WORKSPACE GROUP PLC	28,401	159,897.630	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	44,854	333,938.030	
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,322	432,251.840	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	419,254	813,352.760	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	46,805.700	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	509,269	708,393.170	
	イギリス・ポンド 小計		10,346,596.630 (1,973,095,977)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	156,103	317,981.810	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	46,479	426,677.220	
	REIT 1 LTD	40,686	770,592.840	



イスラエル・シュケル 小計			1,515,251.870 (62,705,820)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	228,654	1,664,601.120	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	100,621.150	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	106,601	128,987.210	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	71,065	189,743.550	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	104,357.500	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	111,495	327,795.300	
	RURAL FUNDS GROUP	79,145	148,001.150	
	WAYPOINT REIT	142,830	358,503.300	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	139,043	561,733.720	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	104,052.950	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	175,165	338,944.270	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	373,987	467,483.750	
	REGION GROUP	242,880	531,907.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	55,242	142,524.360	
	NATIONAL STORAGE REIT	291,323	728,307.500	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	43,255	116,355.950	
	SCENTRE GROUP	1,104,418	4,064,258.240	
	ARENA REIT	82,725	342,481.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	41,492	153,520.400	
	BWP TRUST	116,344	394,406.160	
	GPT GROUP	407,232	1,938,424.320	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	109,971	377,200.530	
	MIRVAC GROUP	838,850	1,811,916.000	
STOCKLAND	507,488	2,649,087.360		
ABACUS GROUP UNIT	90,924	110,018.040		
GOODMAN GROUP	371,447	14,081,555.770		
VICINITY CENTRES	822,602	1,776,820.320		
CHARTER HALL GROUP	100,554	1,580,708.880		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	79,716	402,565.800		
オーストラリア・ドル 小計			35,696,883.300 (3,482,944,904)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	55,580.000	

PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,941	160,248.920	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	76,244.000	
SLATE GROCERY REIT	5,500	82,280.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,400	230,020.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	57,564.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	129,024.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,500	494,000.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	28,200	358,422.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,800	161,172.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,700	389,298.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	33,500	468,330.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	70,604.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,200	172,368.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,800	380,508.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,400	797,790.000	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,766	265,786.380	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,200	593,112.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	31,647.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,100	364,140.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,000	158,180.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,100	238,027.000	
カナダ・ドル 小計		5,734,345.300 (613,861,664)	

シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	24,155	0.000	
	KEPPEL DC REIT	280,883	623,560.260	
	AIMS APAC REIT	134,700	171,069.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	623,090	567,011.900	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	101,600	71,120.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	363,740	203,694.400	
	EC WORLD REIT	36,500	5,110.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	747,777	1,959,175.740	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,149,022	2,252,083.120	
	SUNTEC REIT	465,200	530,328.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	716,900	917,632.000	
	KEPPEL REIT	496,600	424,593.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	530,956	472,550.840	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,271,302	330,538.520	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	131,700	112,603.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	250,276	533,087.880	
	STARHILL GLOBAL REIT	293,700	146,850.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	242,242	173,203.030	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	82,300	312,740.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	440,069	1,020,960.080	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	492,084	605,263.320		
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	217,000	133,455.000		
OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	469,400	129,085.000		
シンガポール・ドル 小計			11,695,714.590 (1,308,633,505)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	218,742	454,983.360	
ニュージーランド・ドル 小計			454,983.360 (40,316,076)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,680	181,632.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,201	200,758.600	

	HAMBORNER REIT AG	12,056	78,002.320	
	WERELDHAVE NV	6,098	84,762.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,650	1,368,934.000	
	NSI NV	3,090	60,996.600	
	ICADE	5,324	118,512.240	
	CARMILA	9,521	157,096.500	
	ALTAREA	837	80,686.800	
	GECINA SA	9,170	874,359.500	
	KLEPIERRE	38,853	1,111,972.860	
	COVIVIO	9,424	490,048.000	
	MERCIALYS	15,523	162,681.040	
	AEDIFICA	8,364	485,530.200	
	COFINIMMO	6,701	380,616.800	
	RETAIL ESTATES	2,180	128,184.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,099	650,591.080	
	CARE PROPERTY INVEST	6,301	77,124.240	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,912	181,794.000	
	MONTEA NV	3,565	237,785.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	17,290.350	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	69,399.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	59,589	325,355.940	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	69,411	721,874.400	
	CROMWELL REIT EUR	59,320	96,098.400	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	88,042	80,118.220	
ユーロ 小計			8,422,204.790 (1,332,898,130)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	29,133	136,051,110.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,401	120,915,650.000	
	LOTTE REIT CO LTD	29,483	90,807,640.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	55,585,080.000	
	JR REIT XXVII	37,352	111,308,960.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	43,237,765.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	33,975	163,080,000.000	
韓国・ウォン 小計			720,986,205.000 (77,433,918)	

香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	490,980.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	327,610.000	
	FORTUNE REIT	313,000	1,252,000.000	
	LINK REIT	547,700	18,539,645.000	
	CHAMPION REIT	398,000	672,620.000	
香港・ドル 小計			21,282,855.000 (410,759,102)	
投資証券 合計			45,631,535,219 [45,631,535,219]	
合計			47,967,237,499 [47,967,237,499]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	6.0%	94%	80.5%
	投資証券 141銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-%	100%	4.1%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	7.3%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券 23銘柄	-%	100%	2.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	2.8%
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.9%

## 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。

## 2【ファンドの現況】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## 【純資産額計算書】

2024年12月30日

資産総額	7,262,358,871円
負債総額	3,036,032円
純資産総額（ - ）	7,259,322,839円
発行済数量	3,391,848,190口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.1402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

2024年12月30日

資産総額	431,783,605,199円
負債総額	14,239,153,946円
純資産総額（ - ）	417,544,451,253円
発行済数量	203,873,244,351口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0481円

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	3,310,553,334円
負債総額	876,141円
純資産総額（ - ）	3,309,677,193円
発行済数量	1,616,108,715口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0479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

2024年12月30日

資産総額	150,656,036,651円
------	------------------

負債総額	7,401,290,328円
純資産総額( - )	143,254,746,323円
発行済数量	42,981,632,554口
1単位当たり純資産額( / )	3.3329円

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

#### 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	5,191,655,504円
負債総額	4,110,508円
純資産総額( - )	5,187,544,996円
発行済数量	1,711,932,859口
1単位当たり純資産額( / )	3.0302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

2024年12月30日

資産総額	708,622,749,220円
負債総額	625,196,470円
純資産総額( - )	707,997,552,750円
発行済数量	97,816,242,760口
1単位当たり純資産額( / )	7.2380円

#### (参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

#### 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	42,453,348,262円
負債総額	27,970,621円
純資産総額( - )	42,425,377,641円
発行済数量	14,760,253,850口
1単位当たり純資産額( / )	2.8743円

### ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス



## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	2,267,973,988円
負債総額	1,035,921円
純資産総額( - )	2,266,938,067円
発行済数量	2,429,938,831口
1単位当たり純資産額( / )	0.9329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

2024年12月30日

資産総額	127,422,852,267円
負債総額	202,257,530円
純資産総額( - )	127,220,594,737円
発行済数量	97,130,194,657口
1単位当たり純資産額( / )	1.3098円

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	3,865,077,204円
負債総額	815,361円
純資産総額( - )	3,864,261,843円
発行済数量	4,552,520,049口
1単位当たり純資産額( / )	0.8488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

2024年12月30日

資産総額	129,496,718,516円
負債総額	6,193,304,027円
純資産総額( - )	123,303,414,489円
発行済数量	148,361,970,231口
1単位当たり純資産額( / )	0.8311円

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

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	5,382,295,518円
負債総額	1,148,459円
純資産総額( - )	5,381,147,059円
発行済数量	3,864,961,583口
1単位当たり純資産額( / )	1.3923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

2024年12月30日

資産総額	337,607,885,211円
負債総額	45,678,812円
純資産総額( - )	337,562,206,399円
発行済数量	89,726,141,857口
1単位当たり純資産額( / )	3.7621円

## (参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	51,951,373,006円
負債総額	192,381,856円
純資産総額( - )	51,758,991,150円
発行済数量	26,822,126,026口
1単位当たり純資産額( / )	1.9297円

ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	1,988,563,595円
負債総額	877,726円

純資産総額( - )	1,987,685,869円
発行済数量	1,636,486,673口
1単位当たり純資産額( / )	1.2146円

## (参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	266,271,638,575円
負債総額	847,027,900円
純資産総額( - )	265,424,610,675円
発行済数量	85,086,675,514口
1単位当たり純資産額( / )	3.1195円

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	975,483,333円
負債総額	254,810円
純資産総額( - )	975,228,523円
発行済数量	905,945,315口
1単位当たり純資産額( / )	1.0765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

2024年12月30日

資産総額	28,192,951,254円
負債総額	1,522,726,576円
純資産総額( - )	26,670,224,678円
発行済数量	30,615,992,553口
1単位当たり純資産額( / )	0.8711円

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## 純資産額計算書

2024年12月30日

資産総額	1,427,102,712円
負債総額	361,737円
純資産総額( - )	1,426,740,975円
発行済数量	781,220,790口
1単位当たり純資産額( / )	1.8263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

2024年12月30日

資産総額	48,651,638,081円
負債総額	115,882,518円
純資産総額( - )	48,535,755,563円
発行済数量	11,857,973,304口
1単位当たり純資産額( / )	4.0931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、ます。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2024年12月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

過去5年間における資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

##### 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。

2024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	91	340,875
追加型株式投資信託	791	30,692,916
株式投資信託 合計	882	31,033,791
単位型公社債投資信託	77	144,018
追加型公社債投資信託	14	1,440,104
公社債投資信託 合計	91	1,584,122
総合計	973	32,617,913



## 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、「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282条及び第306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。

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65期事業年度（2023年4月1日から2024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66期事業年度に係る中間会計期間（2024年4月1日から2024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る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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,982	4,813
有価証券	346	503
前払費用	393	481
未収委託者報酬	12,525	16,513
未収収益	47	78
関係会社短期貸付金	22,100	23,400
その他	59	88
流動資産計	37,455	45,878
固定資産		
有形固定資産	1	176
建物	3	2
器具備品	193	174
無形固定資産	1,482	1,342
ソフトウェア	1,351	1,063
ソフトウェア仮勘定	131	279
投資その他の資産	13,824	13,660

投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

(単位:百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	101	158
未払金	5,874	6,187
未払収益分配金	38	39
未払償還金	12	12
未払手数料	4,525	5,849
その他未払金	2	285
未払費用	3,987	5,035
未払法人税等	560	3,842
未払消費税等	327	872
賞与引当金	692	1,048
その他	2	1
流動負債計	11,545	17,146
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,276	2,227
役員退職慰労引当金	51	62
その他	0	-
固定負債計	2,329	2,289
負債合計	13,874	19,435
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048

福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	-	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	-
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 12,737
当期純利益	-	-	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 436	△ 436	△ 436
当期変動額合計	△ 436	△ 436	△ 2,856
当期末残高	534	534	39,084

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	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	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

## 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の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員及び参与についても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。

## (重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

## (表示方法の変更)

## (損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」のその他に表示していた171百万円は、「受取配当金」25百万円、「その他」146百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	38百万円	39百万円
器具備品	296百万円	308百万円

## 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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
未払金	1,178百万円	236百万円

## 3 保証債務

前事業年度（2023年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,112百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万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 2022年4月1日 至 2023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
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

## (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

2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,316百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,955円
基準日	2023年3月31日
効力発生日	2023年6月27日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27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

2024年6月19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	11,858百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,546円
基準日	2024年3月31日
効力発生日	2024年6月20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グループ通算制度における通算親法人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。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いません。

## 前事業年度（2023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
有価証券及び投資有価証券	57	7,882	-	7,939
資産合計	57	7,882	-	7,939

## 当事業年度（2024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
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	-	8,285
資産合計	144	8,141	-	8,285

## (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

## 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。

(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	666	666
子会社株式	1,448	1,448
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（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,448百万円）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（2024年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,448百万円）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（2023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	57	55	1
(2) その他	5,084	3,923	1,161
小計	5,141	3,978	1,163
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,798	3,190	392
小計	2,798	3,190	392
合計	7,939	7,168	771

(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（2024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	144	55	89
（2）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	213
小計	1,543	1,756	213
合計	8,285	6,079	2,205

（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 2022年4月1日 至 2023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	2,359	296	244
合計	2,359	296	244

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

## 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について257百万円、関係会社株式について229百万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132百万円の減損処理を行っております。

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．確定給付制度

## （1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	322	266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

## (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,276百万円	2,227百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,276	2,227

## (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	150百万円	138百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

## 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184百万円、当事業年度187百万円であります。

## (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
	(2023年3月31日)	(2024年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	459	486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	356	740
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
繰延税金負債合計	515	899
繰延税金資産の純額	824	524

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（2023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（2024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。

3．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社はグループ通算制度を適用しております。また、「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）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（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76,221百万円、その他717百万円であります。

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	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)	17,100 0	関係会社短期貸付金 -	22,100 -
-----	---------------	---------	---------	---------	--------------	----	------	-----------------------	-------------	----------------	-------------

## 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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	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)	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

## 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 2022年4月1日 至 2023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)	2,112	-	-

## 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 2023年4月1日 至 2024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)	2,354	-	-

## 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 2022年4月1日 至 2023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)	13,072	未払手数料	2,663
							不動産の賃借料(注3)	1,062	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	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)	883	未払費用	81

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・保守については、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。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
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)	902	未払費用	87

## 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・保守については、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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,983.42円	1株当たり純資産額	15,956.63円
1株当たり当期純利益	3,955.35円	1株当たり当期純利益	4,546.57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、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,317	11,859
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)

(株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行)

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日（予定）
資金の用途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

## 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 (2024年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	60
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748

その他	1,095
投資その他の資産合計	14,924
固定資産合計	16,211
資産合計	58,128

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2024年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金	6,580
未払費用	5,540
未払法人税等	4,405
賞与引当金	910
その他	2 1,107

流動負債合計	18,545
--------	--------

## 固定負債

退職給付引当金	2,270
役員退職慰労引当金	55

固定負債合計	2,325
--------	-------

## 負債合計

負債合計	20,870
------	--------

## 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	8,774
---------	-------

利益剰余金合計	9,148
---------	-------

## 株主資本合計

株主資本合計	35,818
--------	--------

## 評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金	1,438
--------------	-------

評価・換算差額等合計	1,438
------------	-------

## 純資産合計

純資産合計	37,257
-------	--------

## 負債・純資産合計

負債・純資産合計	58,128
----------	--------

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

当中間会計期間	
(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	44,508
その他営業収益	483
営業収益合計	44,992
営業費用	
支払手数料	18,092
その他営業費用	9,300
営業費用合計	27,392
一般管理費	1 6,708
営業利益	10,890
営業外収益	2 281
営業外費用	3 21
経常利益	11,150
特別利益	4 491
特別損失	5 154
税引前中間純利益	11,487
法人税、住民税及び事業税	4,086
法人税等調整額	183
中間純利益	7,584

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		

当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,858	11,858	11,858
中間純利益	-	-	-	7,584	7,584	7,584
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	-	-	-	4,274	4,274	4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,858
中間純利益	-	-	7,584
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	91	91	91
当中間期変動額 合計	91	91	4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

## 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）其他有価証券

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、執行役員及び参与についても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。

## 5．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用してまいりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

## （中間貸借対照表関係）

### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2024年9月30日現在)
有形固定資産	358百万円

## 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(2024年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万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 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	184百万円
有価証券償還益	45百万円
受取配当金	27百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
為替差損	17百万円

## 4 特別利益の項目

	当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
投資有価証券売却益	380百万円
固定資産売却益	
美術品	83百万円
ゴルフ会員権	26百万円

## 5 特別損失の項目



## 当中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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
2024年6月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 3月31日	2024年 6月20日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2024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	1,602	8,991	-	10,594
資産合計	1,602	8,991	-	10,594

## ( 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、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

有価証券及び投資有価証券

市場で取得した株式及び上場投資信託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のうちレベル1の時価を採用しているもの以外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。

( 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	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

## ( 有価証券関係 )

当中間会計期間（2024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 1,386百万円）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	123	55	67

(2) その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,756	3,988	232
小計	3,756	3,988	232
合計	10,594	8,520	2,073

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 342百万円)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44,508百万円、その他483百万円であります。

##### (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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024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 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	14,283.03円
1株当たり中間純利益	2,907.52円

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
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 )

( 株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行 )

2024年5月15日開催の株主総会及び2024年6月27日開催の臨時株主総会において、株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行について決議し、2024年10月1日付で払込手続きが完了いたしました。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式 652,132株

払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込日	2024年10月1日
資金の用途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぼ生命保険：20%

#### 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

2024年5月15日、株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき2024年10月1日、かんぼ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。

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 (2024年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないません。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）を行ないません。

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ないません。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。





## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2024年2月22日	有価証券報告書、有価証券届出書
2024年8月23日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2024年5月27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65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2024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。

**強調事項**

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックスの2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックスの2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2024年12月2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**

2025年1月24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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックスの2023年12月1日から2024年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックスの2024年12月2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**

2024年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	渡部 啓太
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松田 好弘

**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2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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。

**強調事項**

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年10月1日付で株式会社かんぼ生命保険を割当先とする新株式発行を実施している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成



基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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。