# 【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長　殿 |
| 【提出日】 | 2019年8月23日提出 |
| 【発行者名】 | 大和証券投資信託委託株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 取締役社長　松下　浩一 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 西脇　保宏<br>連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 【電話番号】 | 03-5555-3431 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス<br>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）<br>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）<br>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<br>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）<br>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）<br>ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス<br>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）<br>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） |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 | 各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で90兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当ありません。 |

# 第一部　【証券情報】

## (1) 【ファンドの名称】

ダイワファンドラップオンライン 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）

（注1）上記の総称を「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」とします。
（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。
（注3）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸイ ： FWO ＴＯＰＩＸインデックス
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 ： FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
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 ： FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）
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 ： FWO 日本債券インデックス
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 ： FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
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 ： FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）
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 ： FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス
インデックス

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

## (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」と

いいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

**(3) 【発行(売出)価額の総額】**

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で90兆円を上限とします。

**(4) 【発行(売出)価格】**

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）
・委託会社のホームページ
　アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

**(5) 【申込手数料】**

① 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、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）

② 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。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

**(6) 【申込単位】**

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

**(7) 【申込期間】**

2019年8月24日から2020年2月21日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

**(8) 【申込取扱場所】**

大和証券株式会社　　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
（国内のすべての営業所等で取扱います。）

**(9) 【払込期日】**

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

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

**(10) 【払込取扱場所】**

大和証券株式会社　　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
（国内のすべての営業所等で取扱います。）

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。
株式会社　証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

① 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。受益権の取得申込者は、販売会社に投資一任契約の資産を管理する口座を開設した者に限るものとします。受益権の取得申込者は、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 下表に掲げる各ファンドについて、下表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および換金の申込みの受付けは行ないません。

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

※申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合せ下さい。

③　委託会社の各営業日（※）の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（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。
（※）前②の申込受付中止日を除きます。

④　金融商品取引所（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をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FWO ＴＯＰＩＸインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等*）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

*「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。

⑤　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。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。

⑥「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を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

⑦　取得申込金額に利息は付きません。

⑧　振替受益権について
ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。
ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）
◆投資信託振替制度とは、

**ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。**

**・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません**

# 第二部　【ファンド情報】

## 第１　【ファンドの状況】

### １　【ファンドの性格】

#### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果をめざすマザーファンドを通じて、特定の有価証券に投資し、各市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 国内 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 株式 |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（株式　一般）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | 日本 |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 対象インデックス | ＴＯＰＩＸ |

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 株式 |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（株式　一般）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジあり（フルヘッジ） |
| | 対象インデックス | その他の指数（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）） |

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 株式 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（株式　一般）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし |

＜FWO 日本債券インデックス＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 国内 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 債券 |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（債券　一般）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | 日本 |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 対象インデックス | その他の指数（ＤＢＩ総合指数） |

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 債券 |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（債券　公債）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジあり（フルヘッジ） |
| | 対象インデックス | その他の指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）） |

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 債券 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（債券　一般）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし |

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 国内 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 不動産投信（リート） |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（不動産投信）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | 日本 |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 対象インデックス | その他の指数（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）） |

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 不動産投信（リート） |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（不動産投信）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジあり（フルヘッジ） |

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

| | | |
|---|---|---|
| 商品分類 | 単位型投信・追加型投信 | 追加型投信 |
| | 投資対象地域 | 海外 |
| | 投資対象資産(収益の源泉) | 不動産投信（リート） |
| | 補足分類 | インデックス型 |
| 属性区分 | 投資対象資産 | その他資産（投資信託証券（不動産投信）） |
| | 決算頻度 | 年1回 |
| | 投資対象地域 | グローバル（除く日本） |
| | 投資形態 | ファミリーファンド |
| | 為替ヘッジ | 為替ヘッジなし |
| | 対象インデックス | その他の指数（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）） |

※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

- 「追加型投信」…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
- 「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
- 「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
- 「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

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「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
- 「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
- 「債券　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
- 「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
- 「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

- 「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
- 「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
- 「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
- 「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- 「その他の指数」…日経225、ＴＯＰＩＸにあてはまらないすべてのもの

＜FW0 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<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（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。

＜FW0 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類 |
|---|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞**

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） |
|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>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<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　　）<br>不動産投信<br>その他資産<br>（投資信託証券<br>（株式　一般））<br>資産複合<br>（　　）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回<br>年2回<br>年4回<br>年6回<br>（隔月）<br>年12回<br>（毎月）<br>日々<br>その他<br>（　） | グローバル<br>（除く日本）<br>日本<br>北米<br>欧州<br>アジア<br>オセアニア<br>中南米<br>アフリカ<br>中近東<br>（中東）<br>エマージング | ファミリー<br>ファンド<br>ファンド・オブ・<br>ファンズ | あり<br>（　　）<br>なし |

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**＜FWO 日本債券インデックス＞**

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類 |
|---|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞**

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類 |
|---|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞**

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） |
|---|---|---|
| 単位型投信 | 国　内 | 株　式 |
| 追加型投信 | 海　外 | 債　券 |
| | 内　外 | 不動産投信 |
| | | その他資産（　） |
| | | 資産複合 |

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜FWO Ｊ－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<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） |
|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>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<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　　）<br>不動産投信<br>その他資産<br>（投資信託証券<br>（不動産投信））<br>資産複合<br>（　　）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回<br>年2回<br>年4回<br>年6回<br>（隔月）<br>年12回<br>（毎月）<br>日々<br>その他<br>（　） | グローバル<br>（除く日本）<br>日本<br>北米<br>欧州<br>アジア<br>オセアニア<br>中南米<br>アフリカ<br>中近東<br>（中東）<br>エマージング | ファミリー<br>ファンド<br>ファンド・オブ・<br>ファンズ | あり<br>（フルヘッジ）<br>なし |

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞**

## 商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） | 補足分類 |
|---|---|---|---|
| 単位型投信<br>追加型投信 | 国　内<br>海　外<br>内　外 | 株　式<br>債　券<br>不動産投信<br>その他資産<br>（　　）<br>資産複合 | インデックス型<br>特殊型 |

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

**※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<br>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<br>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） | トピックス・インデックス・マザーファンド |
| 海外の株式 | FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース） | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド |
| | FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし） | MSCIコクサイ指数（円ベース） | 外国株式インデックスマザーファンド |
| | | FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算） | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド |
| わが国の債券 | FWO 日本債券インデックス | ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数 | 日本債券インデックスマザーファンド |
| 海外の債券 | FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース） | 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド |
| | FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし） | FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | 外国債券インデックスマザーファンド |
| | | JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ 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）（円ベース）(注) | ダイワ・グローバルREITインデックス・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。

（注）当ファンドは、特定の指数（「S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）」）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行なうマザーファンドに投資するとともに、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

●各ファンドの運用方針

## FWO TOPIXインデックス

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

◆東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

## FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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

## FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

◆ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、株式およびETF（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態で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(注2)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をめざして運用を行ないます。**

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

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

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

## 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<br>（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・マーケッツ 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）

**海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。**

◆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。

◆保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

◆為替ヘッジは一定間隔で行なうため、保有実質外貨建資産とヘッジ金額が一致するとは限りません。

※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。

※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）
東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。

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

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

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

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス
－エマージング・マーケッツ 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う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&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、分配を行なわないことがあります。

| 主な投資制限 |
|---|
| ●FWO TOPIXインデックス<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は、行ないません。 |
| ●FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）<br>●FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |
| ●FWO 日本債券インデックス<br>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。<br>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ます。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は、行ないません。 |
| ●FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）<br>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。<br>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ます。<br>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。<br>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。<br>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |
| ●FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）<br>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。<br>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ます。<br>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。<br>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。<br>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |

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

●FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

*「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。

**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リートの売買の約定価格と東証REIT指数の算出に使用する価格の差
- Ｊリートの銘柄数、市場規模が限られること
- 不動産投信指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- Ｊリートおよび不動産投信指数先物の流動性が低下した場合における売買の影響
- Ｊリートおよび不動産投信指数先物取引の最低取引単位の影響
- 東証REIT指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- 追加設定および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

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

**FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）**

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 「FWO TOPIXインデックス」は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、「FWO TOPIXインデックス」の購入者または公衆に対し、「FWO TOPIXインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ㈱東京証券取引所は、当社または「FWO TOPIXインデックス」の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は「FWO TOPIXインデックス」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

MSCIコクサイ指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

The Daiwa Fund Wrap 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® Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.
FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

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

JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス―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.

- 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。
- ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 「FWO J−REITインデックス」は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ㈱東京証券取引所は、「FWO J−REITインデックス」の購入者または公衆に対し、「FWO J−REITインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ㈱東京証券取引所は、当社または「FWO J−REITインデックス」の購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は「FWO J−REITインデックス」の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）（以下「当インデックス」といいます。）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。「FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）」は、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

### (2) 【ファンドの沿革】

2017年1月11日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

<table>
<tr><td>受益者</td><td colspan="2">お申込者</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="2">収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）</td></tr>
<tr><td>お取扱窓口</td><td>販売会社<br>大和証券株式会社</td><td>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。<br>①受益権の募集の取扱い<br>②一部解約請求に関する事務<br>③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</td></tr>
<tr><td>↑↓※1</td><td colspan="2">収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）</td></tr>
</table>

| | | |
|---|---|---|
| 委託会社 | 大和証券投資信託委託株式会社 | 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。<br>①受益権の募集・発行<br>②信託財産の運用指図<br>③信託財産の計算<br>④運用報告書の作成　　など |

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

| | | |
|---|---|---|
| 受託会社 | 三井住友信託銀行株式会社<br>再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社 | 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日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。<br>①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br>②信託財産の計算　　など |

損益↑↓投資

| | |
|---|---|
| 投資対象 | ファミリーファンド方式で運用を行ないます。<br>＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞<br>　東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）　など<br>＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞<br>　外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）　など<br>＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞<br>　外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）、新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）、新興国の企業のＤＲ（預託証券）、FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券）　など<br>＜FWO 日本債券インデックス＞<br>　わが国の公社債　など<br>＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞<br>　外国の公社債　など<br>＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞<br>　外国の公社債、新興国通貨建ての債券　など<br>＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞<br>　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<br>＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞<br>　海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券　など |

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

＜委託会社の概況（2019年6月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

| | |
|---|---|
| 1959年12月12日 | 設立登記 |
| 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） |

・大株主の状況

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

## 2　【投資方針】

### (1)　【投資方針】

①　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） | 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 |
| FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | |

※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。

② 投資態度

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

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

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

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

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

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FWO 日本債券インデックス＞

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

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

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

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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

＜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ないます。

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

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

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ないます。

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

ハ．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。

＜投資先ファンドについて＞

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

| | |
|---|---|
| 投資先ファンド | 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<br>（「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」を通じて実質的に投資します。） |
| 選定の方針 | 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指数の構成銘柄であること。 |

くわしくは前掲「１　ファンドの性格　(1) ファンドの目的及び基本的性格＜ファンドの特色＞」および後掲「＜参　考＞マザーファンド（ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド）の概要」をご参照下さい。

＜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に投資し、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの運用にあたっては、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。

ハ．保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

※　保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。

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。

＜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）＞

① 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)⑧、⑨、⑩および⑪に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託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書

＜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書

＜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。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

＜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。

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

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

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

＜FW0 Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

①　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)⑧に定めるものに限ります。）
   ハ．約束手形
   ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ．為替手形

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

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

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

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

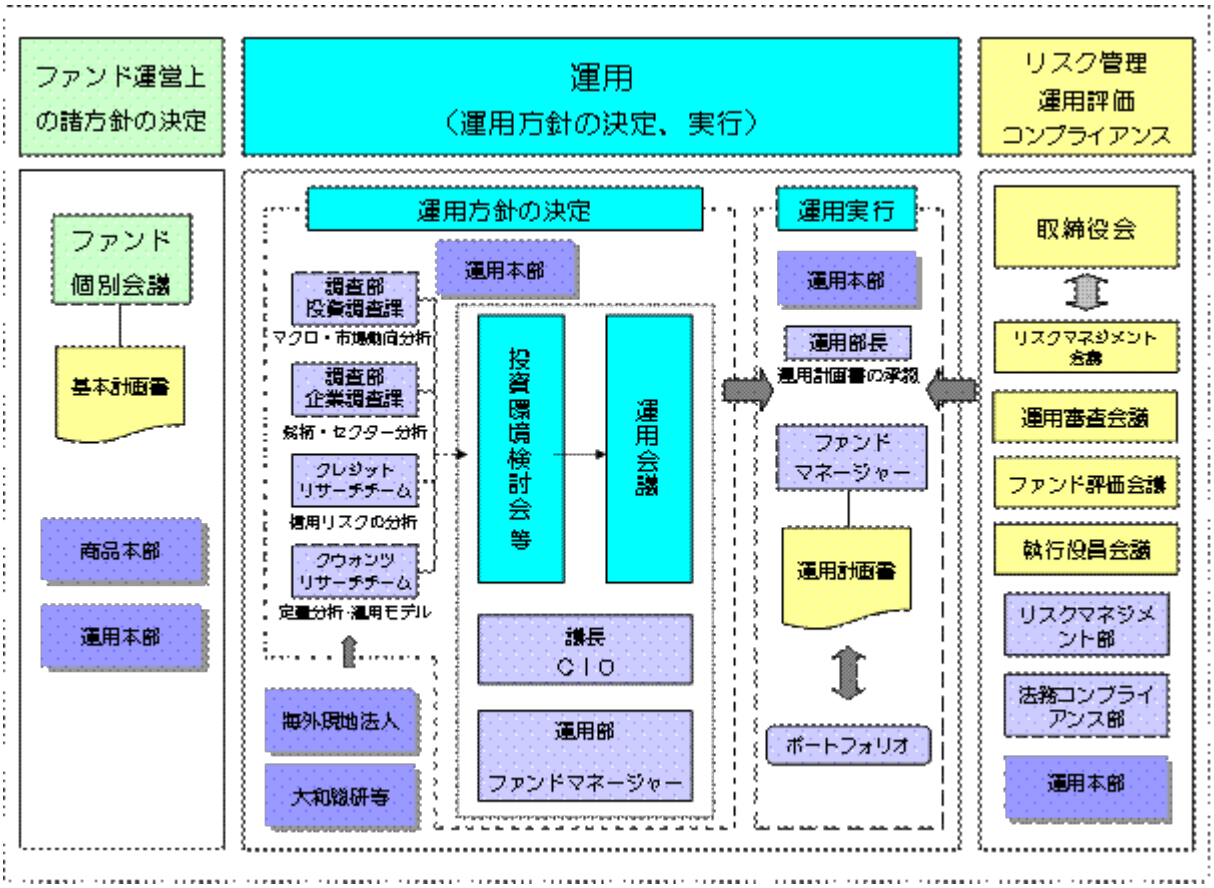
※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

＜各ファンド共通＞

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。




② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．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。

ニ．運用計画書の作成・承認

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

③　職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営
・ファンドマネージャーの任命・変更
・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
・各ファンドの分配政策の決定
・代表取締役に対する随時の的確な状況報告
・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承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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。

ハ．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。

ニ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

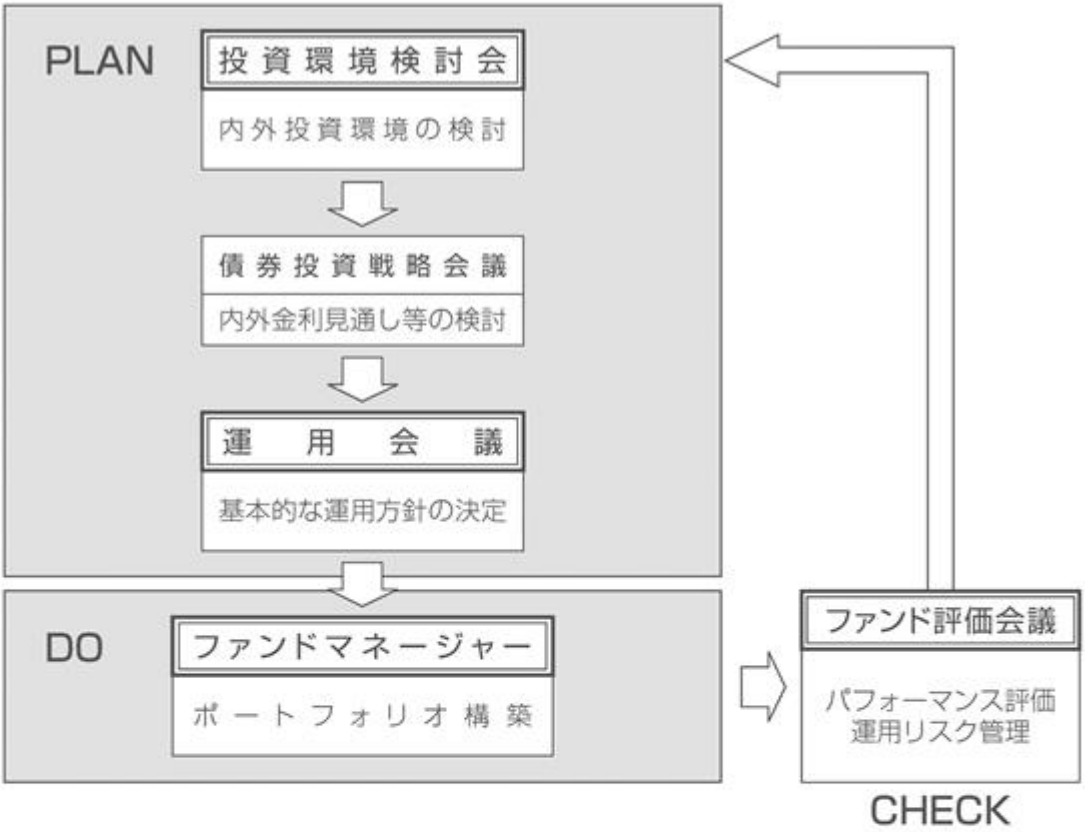
※　上記の運用体制は2019年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

＜運用プロセスについて＞

＜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）＞




**PLAN**

投資環境検討会では、主にマクロ分析を基に内外投資環境について検討します。債券投資戦略会議では、内外金利の動向について検討し、金利見通しを策定します。運用会議で、基本的な運用方針を決定し、これを踏まえてファンドマネージャーがファンドの運用方針を策定し、運用部長が承認します。

**DO**

ファンドマネージャーは、承認された運用方針に基づきポートフォリオを構築します。

**CHECK**

ファンド評価会議でパフォーマンス評価、ファンドの運用リスク分析を行ない、運用へフィードバックを行ないます。

**(4) 【分配方針】**

**＜各ファンド共通＞**

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

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

**③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。**

**(5) 【投資制限】**

**① 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。

② 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ます。）の行使等により取得したものに限ります。

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

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

＜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ます。）の行使等により取得したものに限ります。

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ます。）の行使等により取得したものに限ります。

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。

③ 新株引受権証券等（信託約款）

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞
（規定なし）

④　投資信託証券（信託約款）
＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞
＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FWO 日本債券インデックス＞
＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞
マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）
＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞
＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FWO 日本債券インデックス＞
＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

（規定なし）

⑥　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 日本債券インデックス＞

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑦　信用取引（信託約款）

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FWO 日本債券インデックス＞

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権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）

⑧　先物取引等（信託約款）

＜FW0 ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW0 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。

＜FW0 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW0 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW0 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW0 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW0 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW0 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑨　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（以下本ハ．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．前ハ．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 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（以下本ハ．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．前ハ．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）

⑩　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（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)③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．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）

⑪　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）

⑫　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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

ニ．委託会社は、直物為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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）

⑬　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。

⑭　有価証券の貸付け（信託約款）

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 日本債券インデックス＞

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

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

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑮　外貨建資産（信託約款）

＜FWO ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FWO 日本債券インデックス＞

外貨建資産への投資は、行ないません。

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑯　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑰　外国為替予約取引（信託約款）

＜FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑱　信用リスク集中回避（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

⑲　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 | 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。 |
| 投資態度 | 投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。<br>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。<br>ロ．ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。<br>ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。 |
| 主な投資制限 | ①　株式<br>株式への投資には、制限を設けません。<br>②　先物取引等<br>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。<br>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。<br>③　スワップ取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 |

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 | ①　主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>②　保有外貨建資産については、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。<br>③　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。<br>④　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 | ①　株式<br>株式への投資割合には、制限を設けません。<br>②　新株引受権証券等<br>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。<br>③　投資信託証券<br>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。<br>④　同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限<br>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。<br>⑤　同一銘柄の転換社債等<br>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。<br>⑥　外貨建資産<br>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>⑦　先物取引等<br>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。）。<br>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。<br>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。<br>⑧　スワップ取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。<br>⑨　金利先渡取引および為替先渡取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>へ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 |

外国株式インデックスマザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | 投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 |
| 主要投資対象 | 外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。<br>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。<br>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。 |
| 主な投資制限 | ①　株式への投資割合には、制限を設けません。<br>②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | 投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 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。）<br>ロ．新興国の企業のＤＲ（預託証券）<br>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） |
| 投資態度 | 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。<br>※　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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①　株式<br>株式への投資割合には、制限を設けません。<br>②　投資信託証券<br>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。<br>③　外貨建資産<br>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>④　先物取引等<br>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。）。<br>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。<br>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。<br>⑤　スワップ取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。<br>⑥　金利先渡取引および為替先渡取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 |

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。<br>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 | ①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。<br>②　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。<br>③　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。<br>④　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。<br>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。<br>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。<br>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①　株式<br>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。<br>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。<br>②　投資信託証券<br>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。<br>③　外貨建資産<br>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>④　先物取引等<br>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。）。<br>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。<br>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。<br>⑤　スワップ取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。<br>⑥　金利先渡取引および為替先渡取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 |

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 | 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。<br>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。<br>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。 |
| 主な投資制限 | ①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。<br>②　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。<br>③　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。<br>④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 |

ダイワ新興国債券インデックス・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・マーケッツ 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 | 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・マーケッツ 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。<br>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。<br>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。<br>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。<br>②　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。<br>③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>④　先物取引等<br>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。）。<br>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。<br>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。<br>⑤　スワップ取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。<br>⑥　金利先渡取引および為替先渡取引<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 |

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | 東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 |

| | |
|---|---|
| 主要投資対象 | 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。<br>※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．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。<br>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。<br>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。<br>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 | ①　株式<br>株式への直接投資は、行ないません。<br>②　投資信託証券<br>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。<br>③　同一銘柄の投資信託証券<br>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。<br>④　外貨建資産<br>外貨建資産への直接投資は、行ないません。<br>⑤　先物取引<br>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。 |

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

| | |
|---|---|
| 運用の基本方針 | Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | 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。<br>※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．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＆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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。 |

| | |
|---|---|
| 主な投資制限 | ①　株式への直接投資は、行ないません。<br>②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。<br>③　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。<br>④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。<br>⑤　先物取引<br>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。 |

## 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＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　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）＞

①　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①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。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。

③　その他

（FW0 ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FW0 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

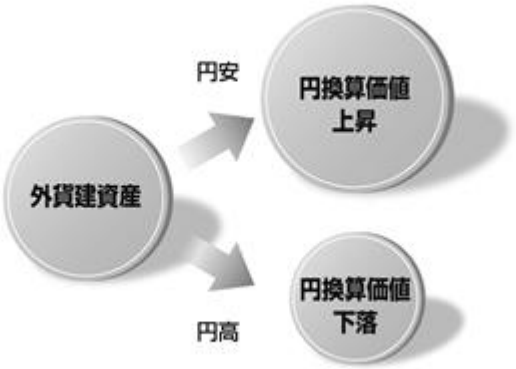
当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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。

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉




※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO 日本債券インデックス＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

②　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　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①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

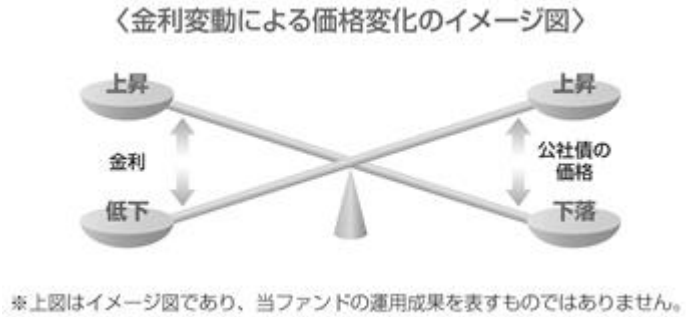
（FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

①　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。

②　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②と同内容）

③　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

①　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が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。

②　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

①　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が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。

②　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②と同内容）

③　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②と同内容）

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

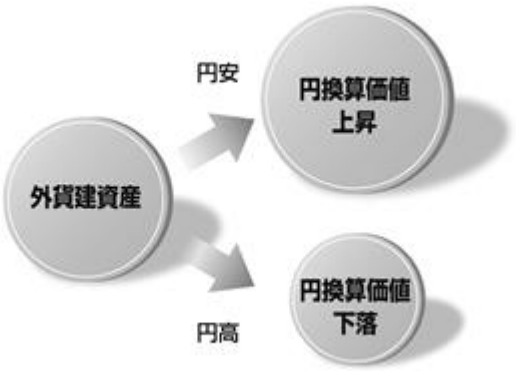
①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

（FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉




※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

③　その他

（FWO ＴＯＰＩＸインデックスの②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。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「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けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

②　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けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。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。

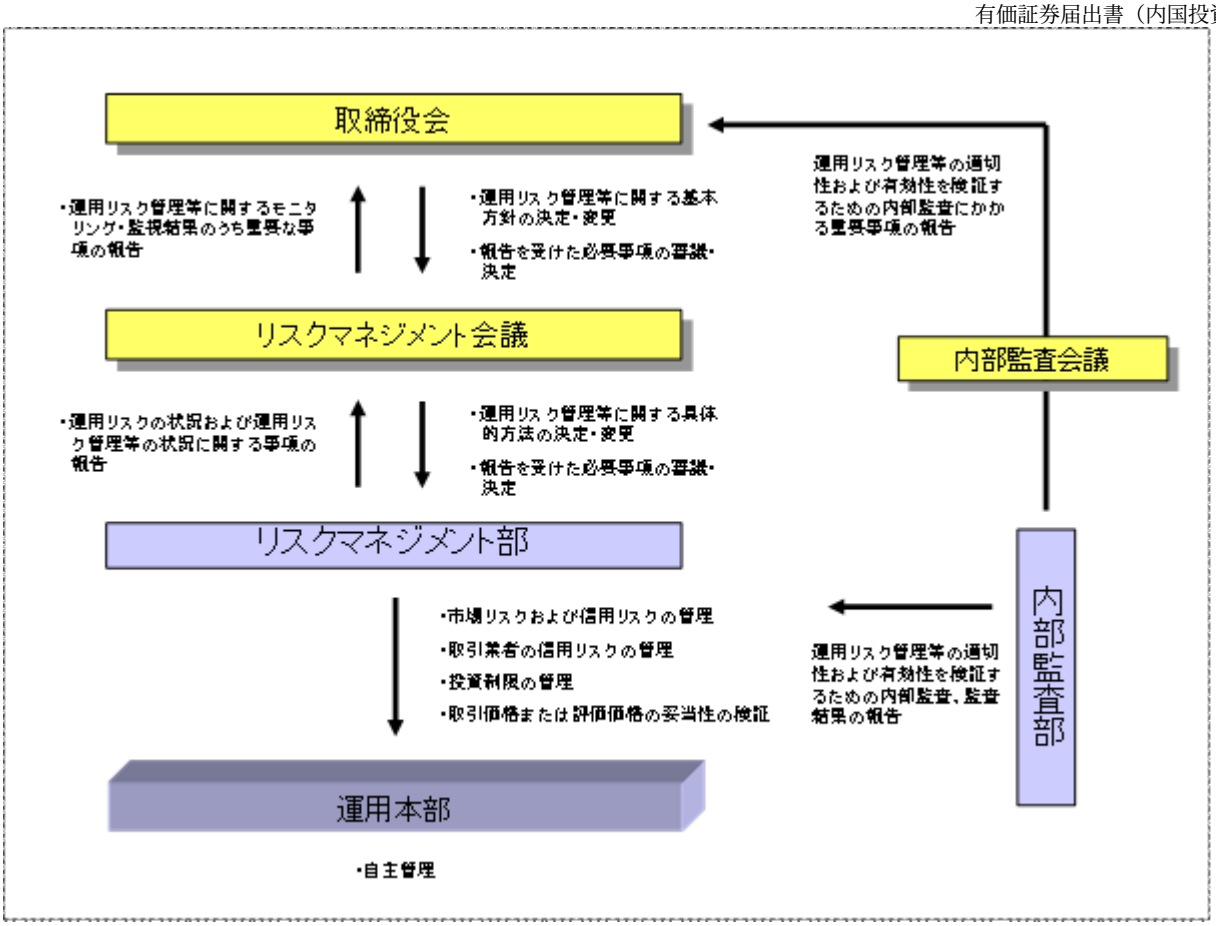
(3) その他の留意点

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。

(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

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

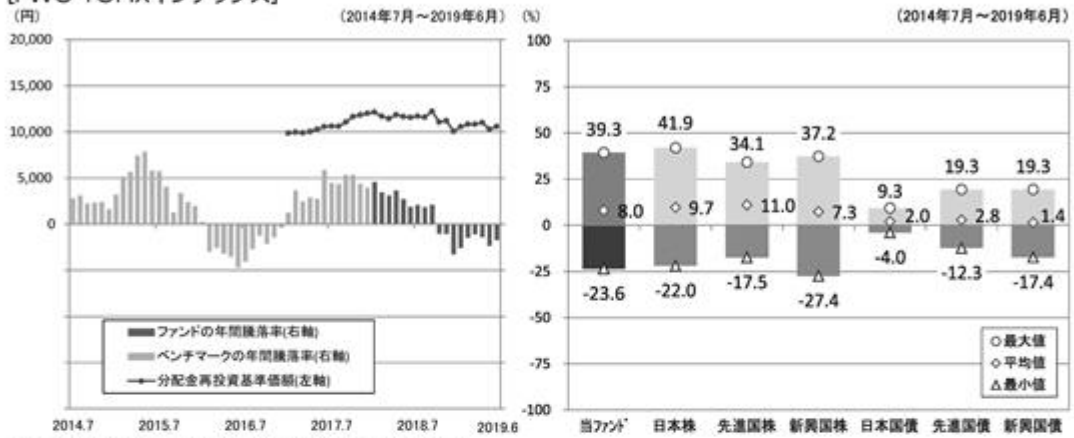
# 参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

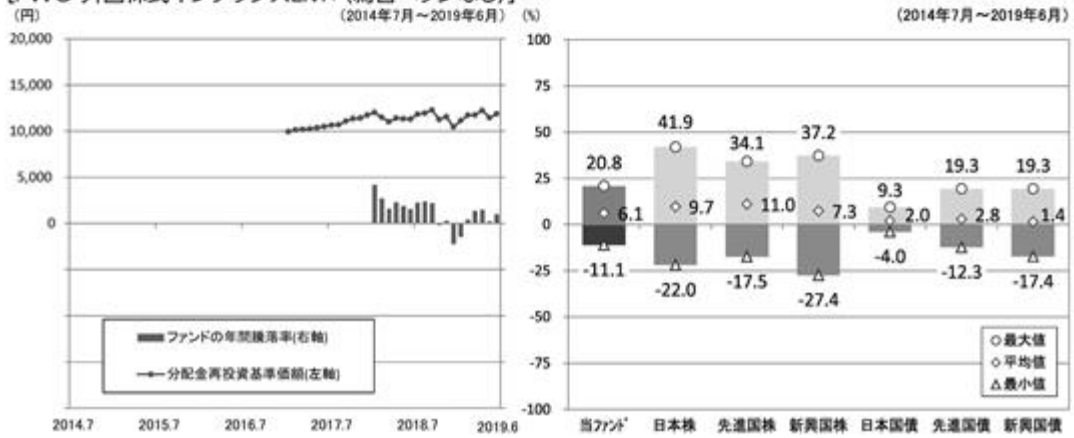
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[FWO TOPIXインデックス]

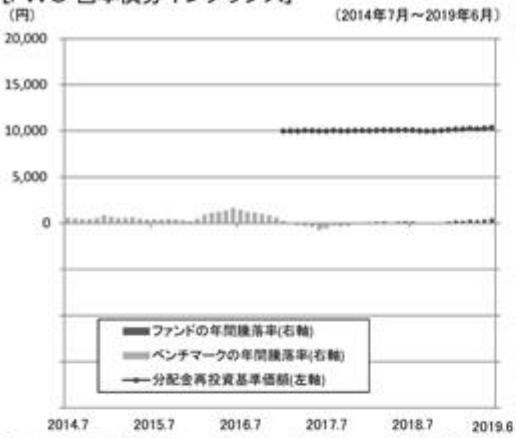


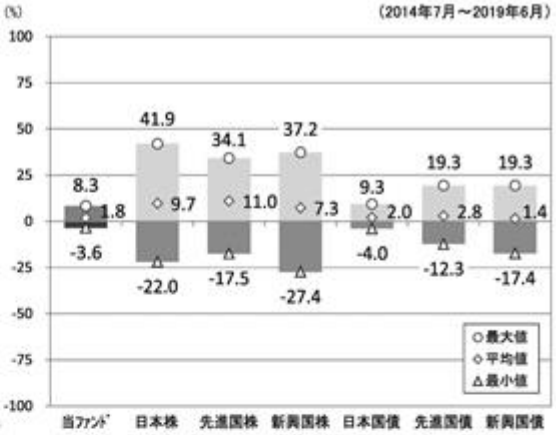

[FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]

[FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]

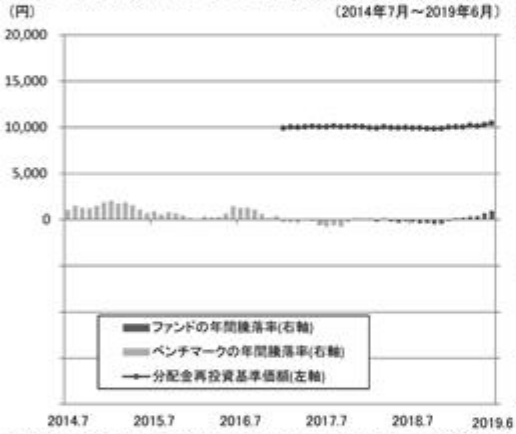


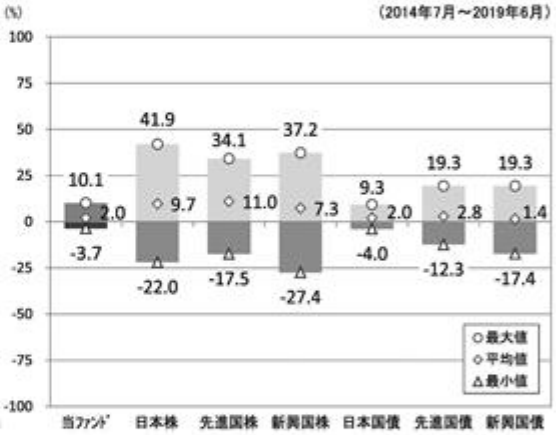
[FWO 日本債券インデックス]



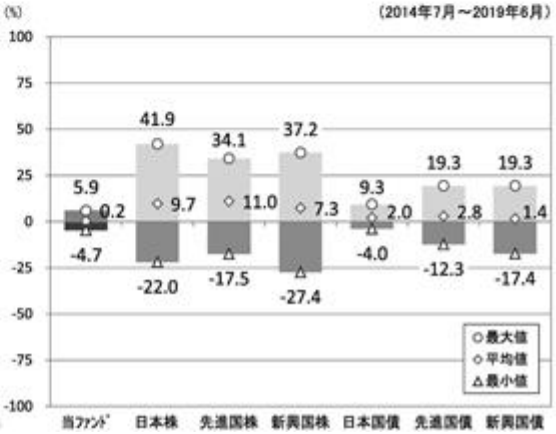




[FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]

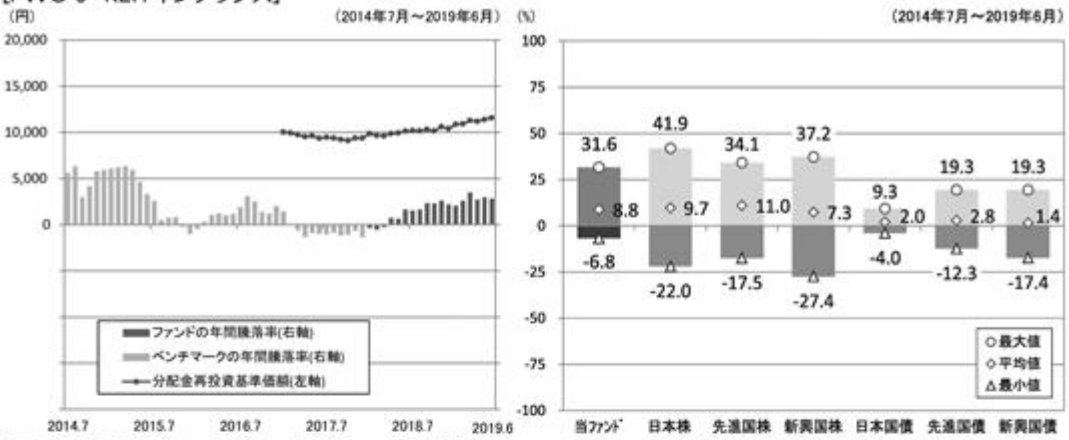


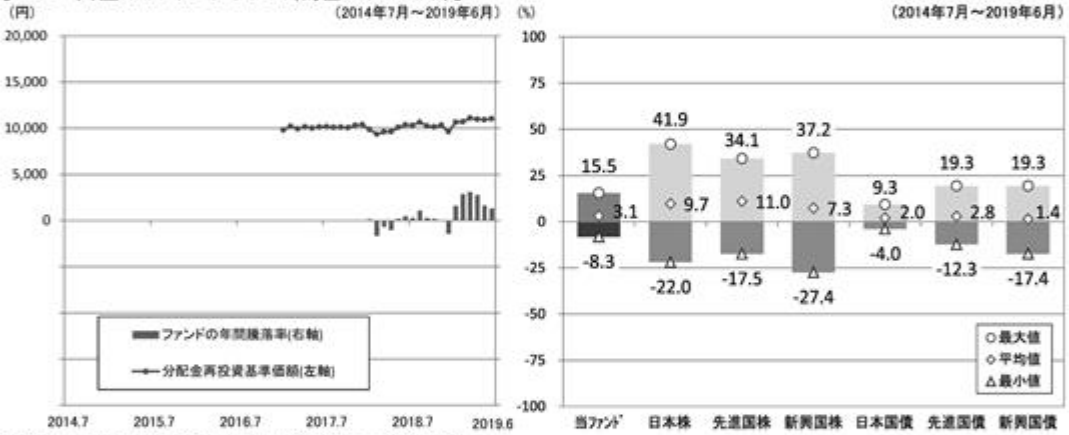

[FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



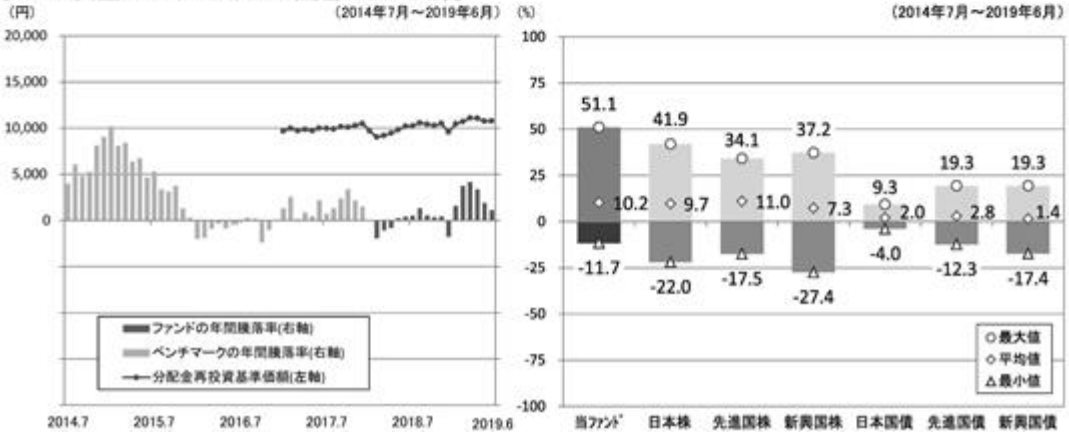
[FWO J-REITインデックス]




[FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]




[FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

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

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

## 4　【手数料等及び税金】

### (1)　【申込手数料】

①　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、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

②　申込手数料には、消費税等が課されます。

③　「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

### (2)　【換金(解約)手数料】

①　換金手数料

ありません。

②　信託財産留保額

ありません。

### (3)　【信託報酬等】

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

| ファンド名 | 信託報酬率 |
|---|---|
| FWO ＴＯＰＩＸインデックス | 年率0.2268%※（税抜0.21%） |
| FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 年率0.3294%※（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0.3402%※（税抜0.315%） |
| FWO 日本債券インデックス | 年率0.2214%※（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0.2592%※（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0.27%※（税抜0.25%） |
| FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 年率0.2268%※（税抜0.21%） |
| FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） | 年率0.3186%※（税抜0.295%） |
| FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | 年率0.3186%※（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0.108%※(税抜0.10%)

ロ．1%以上の場合 …… 年率0.2214%※(税抜0.205%)

※消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、以下のとおりとなります。

| 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%)

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

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、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%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（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①ｲ.の場合 | 年率0.065%（税抜） | 年率0.025%（税抜） | 年率0.01%（税抜） |
| 前①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%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（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%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（税抜） |

＜FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|---|---|---|
| 年率0.14%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（税抜） |

＜FWO 外国ＲＥＩＴ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0.225%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（税抜） |

＜FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|---|---|---|
| 年率0.225%<br>（税抜） | 年率0.05%<br>（税抜） | 年率0.02%<br>（税抜） |

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

**(4)　【その他の手数料等】**

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

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

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

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

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

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

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

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

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

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

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

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

（※）上記は、2019年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

**（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。**

# 5 【運用状況】

## 【ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス】

### (1) 【投資状況】 (2019年6月28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 | | 2,520,967,716 | 99.99 |
| | 内 日本 | 2,520,967,716 | 99.99 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 173,708 | 0.01 |
| 純資産総額 | | 2,521,141,424 | 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】 (2019年6月28日現在)

#### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 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 | 2,524,754,849 | 1.0485<br>2,647,330,217 | 0.9985<br>2,520,967,716 | 99.99 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### ① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 1,308,490,516 | 1,308,490,516 | 1.1827 | 1.1827 |
| 2018年6月末日 | 1,888,380,761 | ― | 1.1553 | ― |
| 7月末日 | 1,959,939,321 | ― | 1.1700 | ― |
| 8月末日 | 2,001,075,934 | ― | 1.1580 | ― |
| 9月末日 | 2,117,638,948 | ― | 1.2221 | ― |
| 10月末日 | 1,947,363,351 | ― | 1.1065 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 2,014,835,042 | 2,014,835,042 | 1.1209 | 1.1209 |
| 12月末日 | 1,806,804,753 | ― | 1.0059 | ― |
| 2019年1月末日 | 1,993,358,763 | ― | 1.0553 | ― |
| 2月末日 | 2,063,018,174 | ― | 1.0824 | ― |
| 3月末日 | 2,075,602,148 | ― | 1.0832 | ― |
| 4月末日 | 2,597,977,286 | ― | 1.1010 | ― |
| 5月末日 | 2,440,825,208 | ― | 1.0292 | ― |
| 6月末日 | 2,521,141,424 | ― | 1.0571 | ― |

### ② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

### ③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | △8.2 |

## (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 | 1,207,147,382 | 101,755,106 |
| 第2計算期間 | 1,072,657,156 | 381,496,133 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 884,513,758 | 310,396,914 |

(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（2019年6月28日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 136,528,797,240 | 99.28 |
| | 内　日本 | 136,528,797,240 | 99.28 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 987,472,928 | 0.72 |
| 純資産総額 | | 137,516,270,168 | 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) | | 1,209,780,000 | 0.88 |
| | 内　日本 | 1,209,780,000 | 0.88 |

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

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

(注3) 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（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ﾄﾖﾀ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 684,700 | 7,002.13<br>4,794,358,634 | 6,688.00<br>4,579,273,600 | 3.33 |
| 2 | ｿﾌﾄﾊﾞﾝｸｸﾞﾙｰﾌﾟ | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 502,600 | 5,432.23<br>2,730,241,635 | 5,165.00<br>2,595,929,000 | 1.89 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3 | ソニー | 日本 | 株式 | 電気機器 | 412,300 | 6,605.26<br>2,723,352,608 | 5,648.00<br>2,328,670,400 | 1.69 |
| 4 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 4,172,000 | 694.17<br>2,896,112,059 | 512.00<br>2,136,064,000 | 1.55 |
| 5 | 日本電信電話 | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 412,400 | 5,132.86<br>2,116,793,830 | 5,017.00<br>2,069,010,800 | 1.50 |
| 6 | 武田薬品 | 日本 | 株式 | 医薬品 | 536,400 | 4,556.67<br>2,444,200,308 | 3,823.00<br>2,050,657,200 | 1.49 |
| 7 | キーエンス | 日本 | 株式 | 電気機器 | 30,200 | 63,227.90<br>1,909,482,653 | 66,130.00<br>1,997,126,000 | 1.45 |
| 8 | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 427,100 | 4,506.32<br>1,924,650,475 | 3,806.00<br>1,625,542,600 | 1.18 |
| 9 | リクルートホールディングス | 日本 | 株式 | サービス業 | 420,600 | 3,643.31<br>1,532,380,234 | 3,594.00<br>1,511,636,400 | 1.10 |
| 10 | 本田技研 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 518,400 | 3,360.02<br>1,741,839,491 | 2,785.00<br>1,443,744,000 | 1.05 |
| 11 | 任天堂 | 日本 | 株式 | その他製品 | 35,200 | 39,807.41<br>1,401,221,162 | 39,490.00<br>1,390,048,000 | 1.01 |
| 12 | KDDI | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 494,300 | 3,066.57<br>1,515,807,494 | 2,743.50<br>1,356,112,050 | 0.99 |
| 13 | みずほフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 8,233,500 | 196.65<br>1,619,139,859 | 156.10<br>1,285,249,350 | 0.93 |
| 14 | 花王 | 日本 | 株式 | 化学 | 149,200 | 9,005.24<br>1,343,583,051 | 8,210.00<br>1,224,932,000 | 0.89 |
| 15 | 三菱商事 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 424,700 | 3,440.64<br>1,461,240,474 | 2,840.00<br>1,206,148,000 | 0.88 |
| 16 | 東海旅客鉄道 | 日本 | 株式 | 陸運業 | 55,000 | 23,215.72<br>1,276,864,735 | 21,580.00<br>1,186,900,000 | 0.86 |
| 17 | ダイキン工業 | 日本 | 株式 | 機械 | 83,800 | 15,440.65<br>1,293,927,266 | 14,065.00<br>1,178,647,000 | 0.86 |
| 18 | 東京海上HD | 日本 | 株式 | 保険業 | 216,600 | 5,446.76<br>1,179,768,304 | 5,399.00<br>1,169,423,400 | 0.85 |
| 19 | ファナック | 日本 | 株式 | 電気機器 | 58,400 | 21,966.60<br>1,282,849,654 | 19,930.00<br>1,163,912,000 | 0.85 |
| 20 | 東日本旅客鉄道 | 日本 | 株式 | 陸運業 | 109,300 | 10,625.98<br>1,161,419,768 | 10,080.00<br>1,101,744,000 | 0.80 |
| 21 | 日立 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 276,500 | 3,730.31<br>1,031,431,359 | 3,949.00<br>1,091,898,500 | 0.79 |
| 22 | 日本電産 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 74,000 | 16,358.09<br>1,210,498,675 | 14,725.00<br>1,089,650,000 | 0.79 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 23 | 信越化学 | 日本 | 株式 | 化学 | 106,000 | 9,825.51<br>1,041,504,206 | 10,035.00<br>1,063,710,000 | 0.77 |
| 24 | キヤノン | 日本 | 株式 | 電 気 機 器 | 330,800 | 3,520.44<br>1,164,564,730 | 3,146.00<br>1,040,696,800 | 0.76 |
| 25 | HOYA | 日本 | 株式 | 精 密 機 器 | 123,700 | 6,647.96<br>822,352,660 | 8,254.00<br>1,021,019,800 | 0.74 |
| 26 | 資 生 堂 | 日本 | 株式 | 化学 | 122,100 | 7,912.72<br>966,143,938 | 8,121.00<br>991,574,100 | 0.72 |
| 27 | 第一三共 | 日本 | 株式 | 医薬品 | 175,800 | 4,600.86<br>808,832,455 | 5,635.00<br>990,633,000 | 0.72 |
| 28 | NTTドコモ | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 381,800 | 3,014.14<br>1,150,801,071 | 2,512.50<br>959,272,500 | 0.70 |
| 29 | 村田製作所 | 日本 | 株式 | 電 気 機 器 | 193,400 | 5,930.90<br>1,147,036,173 | 4,840.00<br>936,056,000 | 0.68 |
| 30 | オリエンタルランド | 日本 | 株式 | サービス業 | 69,400 | 11,724.38<br>813,672,509 | 13,340.00<br>925,796,000 | 0.67 |

(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 | 99.28% |
| 合計 | 99.28% |

(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 | 0.11% |
| 鉱業 | 0.27% |
| 建設業 | 2.78% |
| 食料品 | 4.09% |
| 繊維製品 | 0.65% |
| パルプ・紙 | 0.28% |
| 化学 | 7.35% |
| 医薬品 | 5.45% |
| 石油・石炭製品 | 0.62% |
| ゴム製品 | 0.78% |
| ガラス・土石製品 | 0.86% |
| 鉄鋼 | 0.90% |
| 非鉄金属 | 0.77% |

| | |
|---|---|
| 金属製品 | 0.55% |
| 機械 | 5.14% |
| 電気機器 | 13.51% |
| 輸送用機器 | 7.78% |
| 精密機器 | 2.12% |
| その他製品 | 2.15% |
| 電気・ガス業 | 1.65% |
| 陸運業 | 4.69% |
| 海運業 | 0.16% |
| 空運業 | 0.54% |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.20% |
| 情報・通信業 | 8.84% |
| 卸売業 | 4.92% |
| 小売業 | 4.52% |
| 銀行業 | 5.82% |
| 証券、商品先物取引業 | 0.75% |
| 保険業 | 2.27% |
| その他金融業 | 1.12% |
| 不動産業 | 2.38% |
| サービス業 | 5.24% |
| 合計 | 99.28% |

(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。

### ② 投資不動産物件

該当事項はありません。

### ③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | 日本 | TOPIX先物 2019年9月 | 買建 | 78 | 1,198,049,120 | 1,209,780,000 | 0.88% |

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

(注2)　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

2019年6月28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 | 10,571円 |
| 純資産総額 | 25億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 2.7% |
| 3カ月間 | -2.4% |
| 6カ月間 | 5.1% |
| 1年間 | -8.5% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 5.7% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

### 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：0円

| 決算期 | 第１期 17年11月 | 第２期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 国内株式 | 2,126 | 99.3% |
| 国内株式先物 | 1 | 0.9% |
| 不動産投資信託等 | - | - |
| コール・ローン、その他 | | 0.7% |
| 合計 | 2,127 | - |

| 株式　市場・上場別構成 | 比率 |
|---|---|
| 一部(東証・名証) | 99.3% |
| 二部(東証・名証) | - |
| 新興市場他 | - |
| その他 | - |
| 合計 | 99.3% |

| 株式東証33業種別構成 | 比率 |
|---|---|
| 電気機器 | 13.5% |
| 情報・通信業 | 8.8% |
| 輸送用機器 | 7.8% |
| 化学 | 7.3% |
| 銀行業 | 5.8% |
| 医薬品 | 5.5% |
| サービス業 | 5.2% |
| 機械 | 5.1% |
| 卸売業 | 4.9% |
| その他 | 35.2% |
| 合計 | 99.3% |

| 組入上位10銘柄 | 業種名 | 比率 |
|---|---|---|
| トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.3% |
| ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 1.9% |
| ソニー | 電気機器 | 1.7% |
| 三菱UFJフィナンシャルG | 銀行業 | 1.6% |
| 日本電信電話 | 情報・通信業 | 1.5% |
| 武田薬品 | 医薬品 | 1.5% |
| キーエンス | 電気機器 | 1.5% |
| 三井住友フィナンシャルG | 銀行業 | 1.2% |
| リクルートホールディングス | サービス業 | 1.1% |
| 本田技研 | 輸送用機器 | 1.0% |
| 合計 | | 16.2% |

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

### 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。

・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、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

**【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】（2019年6月28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 | | 2,231,531,935 | 99.98 |
| | 内 日本 | 2,231,531,935 | 99.98 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 339,838 | 0.02 |
| 純資産総額 | | 2,231,871,773 | 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】（2019年6月28日現在）

### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 1,136,102,197 | 1.8227<br>2,070,881,205 | 1.9642<br>2,231,531,935 | 99.98 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 1,294,661,850 | 1,294,661,850 | 1.1363 | 1.1363 |
| 2018年6月末日 | 2,049,299,817 | ― | 1.1590 | ― |
| 7月末日 | 2,154,633,449 | ― | 1.1938 | ― |
| 8月末日 | 2,260,119,694 | ― | 1.2187 | ― |
| 9月末日 | 2,265,591,502 | ― | 1.2204 | ― |
| 10月末日 | 2,118,491,668 | ― | 1.1222 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 2,198,184,300 | 2,198,184,300 | 1.1423 | 1.1423 |
| 12月末日 | 2,015,102,499 | ― | 1.0470 | ― |
| 2019年1月末日 | 2,241,315,795 | ― | 1.1283 | ― |
| 2月末日 | 2,353,681,116 | ― | 1.1752 | ― |
| 3月末日 | 2,380,628,449 | ― | 1.1844 | ― |
| 4月末日 | 2,226,665,493 | ― | 1.2304 | ― |
| 5月末日 | 2,136,597,631 | ― | 1.1787 | ― |
| 6月末日 | 2,231,871,773 | ― | 1.2298 | ― |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 3.2 |

(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 | 1,218,074,496 | 79,711,026 |
| 第2計算期間 | 1,148,408,392 | 363,438,941 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 366,222,270 | 477,939,126 |

（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（2019年6月28日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 38,895,054,527 | 90.95 |
| | 内　香港 | 585,677,611 | 1.37 |
| | 内　シンガポール | 182,704,726 | 0.43 |
| | 内　イスラエル | 85,029,200 | 0.20 |
| | 内　ノルウェー | 105,325,362 | 0.25 |
| | 内　スウェーデン | 415,659,197 | 0.97 |
| | 内　デンマーク | 267,241,523 | 0.62 |
| | 内　イギリス | 2,429,951,986 | 5.68 |
| | 内　アイルランド | 82,463,045 | 0.19 |
| | 内　オランダ | 532,297,067 | 1.24 |
| | 内　ベルギー | 144,461,880 | 0.34 |
| | 内　フランス | 1,621,530,318 | 3.79 |
| | 内　ドイツ | 1,285,840,914 | 3.01 |
| | 内　スイス | 1,371,838,505 | 3.21 |
| | 内　ポルトガル | 22,257,610 | 0.05 |
| | 内　スペイン | 436,390,193 | 1.02 |
| | 内　イタリア | 347,928,263 | 0.81 |
| | 内　フィンランド | 155,831,421 | 0.36 |
| | 内　オーストリア | 34,898,821 | 0.08 |
| | 内　カナダ | 1,472,986,665 | 3.44 |
| | 内　アメリカ | 26,343,802,094 | 61.60 |
| | 内　オーストラリア | 934,881,731 | 2.19 |
| | 内　ニュージーランド | 36,056,395 | 0.08 |
| 投資証券 | | 1,147,694,696 | 2.68 |
| | 内　香港 | 43,908,463 | 0.10 |
| | 内　シンガポール | 22,924,334 | 0.05 |
| | 内　イギリス | 35,013,420 | 0.08 |
| | 内　フランス | 41,062,565 | 0.10 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　カナダ | 6,776,747 | 0.02 |
| | 内　アメリカ | 879,263,406 | 2.06 |
| | 内　オーストラリア | 118,745,761 | 0.28 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,722,208,212 | 6.37 |
| 純資産総額 | | 42,764,957,435 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引（買建） | | 2,557,794,424 | 5.98 |
| | 内　イギリス | 160,376,882 | 0.38 |
| | 内　ドイツ | 393,820,008 | 0.92 |
| | 内　カナダ | 128,013,270 | 0.30 |
| | 内　アメリカ | 1,800,815,193 | 4.21 |
| | 内　オーストラリア | 74,769,071 | 0.17 |
| 為替予約取引（売建） | | 38,457,856,856 | △89.93 |
| | 内　日本 | 38,457,856,856 | △89.93 |

(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（2019年6月28日現在）

### ① 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 71,709 | 11,303.72<br>810,580,015 | 14,460.02<br>1,036,914,184 | 2.42 |
| 2 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 46,135 | 16,580.36<br>764,938,414 | 21,529.97<br>993,285,378 | 2.32 |
| 3 | AMAZON.COM INC | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 4,088 | 178,918.46<br>731,419,076 | 205,262.34<br>839,112,451 | 1.96 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 4 | FACEBOOK INC-CLASS A | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 23,434 | 15,604.97<br>365,688,522 | 20,426.20<br>478,667,688 | 1.12 |
| 5 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 26,136 | 13,926.79<br>363,992,916 | 15,164.97<br>396,351,789 | 0.93 |
| 6 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 31,962 | 10,833.11<br>346,248,282 | 11,731.86<br>374,973,824 | 0.88 |
| 7 | ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 3,119 | 116,070.64<br>362,024,547 | 115,983.11<br>361,751,345 | 0.85 |
| 8 | ALPHABET INC-CL A | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 2,964 | 116,705.74<br>345,916,082 | 116,049.94<br>343,972,045 | 0.80 |
| 9 | EXXON MOBIL CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 41,856 | 7,831.80<br>327,809,592 | 8,172.63<br>342,073,928 | 0.80 |
| 10 | NESTLE SA-REG | スイス | 株式 | 生活必需品 | 29,798 | 9,059.10<br>269,946,038 | 11,106.85<br>330,961,976 | 0.77 |
| 11 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 17,152 | 14,939.04<br>256,234,865 | 18,456.88<br>316,572,435 | 0.74 |
| 12 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融 | 12,844 | 21,191.08<br>272,179,285 | 22,853.63<br>293,532,098 | 0.69 |
| 13 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 24,603 | 9,864.18<br>242,690,375 | 11,833.18<br>291,131,880 | 0.68 |
| 14 | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 株式 | 金融 | 89,256 | 2,789.06<br>248,943,794 | 3,040.75<br>271,405,709 | 0.63 |
| 15 | WALT DISNEY CO/THE | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 17,572 | 11,994.00<br>210,760,099 | 15,015.14<br>263,846,163 | 0.62 |
| 16 | CISCO SYSTEMS INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 43,266 | 4,669.46<br>202,028,978 | 6,007.13<br>259,904,776 | 0.61 |
| 17 | PFIZER INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 54,454 | 4,671.61<br>254,390,693 | 4,681.31<br>254,916,583 | 0.60 |
| 18 | AT&T INC | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 70,903 | 3,248.14<br>230,305,807 | 3,554.91<br>252,054,082 | 0.59 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 19 | MASTERCARD INC - A | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 8,884 | 21,237.86<br>188,677,614 | 28,143.96<br>250,031,021 | 0.58 |
| 20 | UNITEDHEALTH GROUP INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 9,354 | 26,257.32<br>245,611,625 | 26,552.98<br>248,376,655 | 0.58 |
| 21 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 40,197 | 6,148.98<br>247,173,677 | 6,170.97<br>248,054,783 | 0.58 |
| 22 | HOME DEPOT INC | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 11,036 | 19,395.84<br>214,053,295 | 22,314.68<br>246,264,872 | 0.58 |
| 23 | CHEVRON CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 18,541 | 12,226.29<br>226,689,401 | 13,270.02<br>246,039,569 | 0.58 |
| 24 | MERCK & CO. INC. | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 25,393 | 8,143.10<br>206,780,157 | 9,036.03<br>229,452,055 | 0.54 |
| 25 | INTEL CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 44,602 | 5,196.87<br>231,794,179 | 5,115.71<br>228,171,049 | 0.53 |
| 26 | COCA-COLA CO/THE | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 39,438 | 5,016.22<br>197,831,359 | 5,505.91<br>217,142,205 | 0.51 |
| 27 | WELLS FARGO & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 42,071 | 5,152.36<br>216,765,022 | 4,989.59<br>209,917,424 | 0.49 |
| 28 | NOVARTIS AG-REG | スイス | 株式 | ヘルスケア | 21,246 | 8,293.58<br>176,206,934 | 9,853.24<br>209,342,033 | 0.49 |
| 29 | BOEING CO/THE | アメリカ | 株式 | 資本財･サービス | 5,273 | 37,446.56<br>197,456,085 | 39,237.71<br>206,900,475 | 0.48 |
| 30 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | スイス | 株式 | ヘルスケア | 6,828 | 28,099.36<br>191,862,516 | 30,213.59<br>206,298,444 | 0.48 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 株式 | 90.95% |
| 投資証券 | 2.68% |
| 合計 | 93.63% |

(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

| 業種 | 投資比率 |
|---|---|
| エネルギー | 5.63% |
| 素材 | 4.19% |
| 資本財・サービス | 9.57% |
| 一般消費財・サービス | 9.14% |
| 生活必需品 | 8.01% |
| ヘルスケア | 12.01% |
| 金融 | 15.06% |
| 情報技術 | 15.73% |
| コミュニケーション・サービス | 7.73% |
| 公益事業 | 3.36% |
| 不動産 | 0.52% |
| 合計 | 90.95% |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | S&P500 E-MINI FUTURE 2019年9月 | 買建 | 114 | 1,782,845,845 | 1,800,815,193 | 4.21% |
| | イギリス | FT 100 2019年9月 | 買建 | 16 | 160,233,347 | 160,376,882 | 0.38% |
| | オーストラリア | SPI 200 INDEX 2019年9月 | 買建 | 6 | 73,629,322 | 74,769,071 | 0.17% |
| | カナダ | S&P/TSE 60 INDEX 2019年9月 | 買建 | 8 | 128,742,220 | 128,013,270 | 0.30% |
| | ドイツ | SMI 2019年9月 | 買建 | 8 | 87,225,899 | 86,849,044 | 0.20% |
| | | EURO STOXX 50 2019年9月 | 買建 | 73 | 304,572,059 | 306,970,964 | 0.72% |
| 為替予約取引 | 日本 | 香港ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 40,832,200 | 562,994,373 | 562,667,716 | △1.32% |
| | | イスラエル・シュケル売/円買 2019年7月 | 売建 | 1,528,600 | 45,546,318 | 46,072,004 | △0.11% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | ノルウェー・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 8,432,400 | 104,338,301 | 106,754,184 | △0.25% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 501,800 | 35,515,898 | 36,239,996 | △0.08% |
| | | スウェーデン・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 34,423,400 | 393,029,169 | 399,655,674 | △0.93% |
| | | シンガポール・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 2,390,400 | 188,155,555 | 190,347,552 | △0.45% |
| | | 英ポンド売/円買 2019年7月 | 売建 | 17,719,300 | 2,425,285,401 | 2,419,038,836 | △5.66% |
| | | ユーロ売/円買 2019年7月 | 売建 | 37,002,500 | 4,481,391,277 | 4,532,066,200 | △10.60% |
| | | 米ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 241,977,700 | 26,146,330,414 | 26,063,418,067 | △60.95% |
| | | スイス・フラン売/円買 2019年7月 | 売建 | 12,091,900 | 1,311,901,005 | 1,335,550,355 | △3.12% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 17,874,300 | 1,430,885,296 | 1,470,697,404 | △3.44% |
| | | 豪ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 13,750,200 | 1,032,789,165 | 1,037,452,590 | △2.43% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 15,715,800 | 254,942,021 | 257,896,278 | △0.60% |

(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)

2019年6月28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 | 12,298円 |
| 純資産総額 | 22億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 4.3% |
| 3カ月間 | 3.8% |
| 6カ月間 | 17.5% |
| 1年間 | 6.1% |
| 3年間 | － |
| 5年間 | － |
| 設定来 | 23.0% |

※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 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 外国株式・先物 | 1,265 | 96.9% |
| 外国リート | 62 | 2.5% |
| 外国投資証券 | 6 | 0.1% |
| | | |
| コール・ローン、その他 | | 6.4% |
| 合計 | 1,333 | － |

| 国・地域別構成 | 比率 |
|---|---|
| アメリカ | 67.9% |
| イギリス | 6.1% |
| その他 | 25.6% |
| 合計 | 99.6% |

| 通貨別構成 | 比率 |
|---|---|
| 日本円 | 94.6% |
| 米ドル | 4.1% |
| ユーロ | 0.5% |
| 英ポンド | 0.2% |
| 豪ドル | 0.2% |
| スイス・フラン | 0.1% |
| カナダ・ドル | 0.1% |
| 香港ドル | 0.1% |
| スウェーデン・クローネ | 0.0% |
| その他 | 0.1% |
| 合計 | 100.0% |

| 株式業種別構成 | 比率 |
|---|---|
| 情報技術 | 15.7% |
| 金融 | 15.1% |
| ヘルスケア | 12.0% |
| 資本財・サービス | 9.6% |
| 一般消費財・サービス | 9.1% |
| 生活必需品 | 8.0% |
| コミュニケーション・サービス | 7.7% |
| エネルギー | 5.6% |
| 素材 | 4.2% |
| 公益事業、他 | 3.9% |
| 合計 | 90.9% |

| 組入上位10銘柄 | 国・地域名 | 比率 |
|---|---|---|
| S&P500 EMINI FUT 201909 | アメリカ | 4.2% |
| MICROSOFT CORP | アメリカ | 2.4% |
| APPLE INC | アメリカ | 2.3% |
| AMAZON.COM INC | アメリカ | 2.0% |
| FACEBOOK INC-CLASS A | アメリカ | 1.1% |
| JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 0.9% |
| JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 0.9% |
| ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 0.8% |
| ALPHABET INC-CL A | アメリカ | 0.8% |
| EXXON MOBIL CORP | アメリカ | 0.8% |
| 合計 | | 16.3% |

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

**年間収益率の推移**

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)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、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 【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】 (2019年6月28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 | | 1,703,538,917 | 99.21 |
| | 内　日本 | 1,703,538,917 | 99.21 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 13,629,512 | 0.79 |
| 純資産総額 | | 1,717,168,429 | 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】（2019年6月28日現在）

### ①　【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 538,118,583 | 2.4461<br>1,316,296,571 | 2.5291<br>1,360,955,708 | 79.26 |
| 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 | 216,359,233 | 1.5633<br>338,247,032 | 1.5834<br>342,583,209 | 19.95 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 99.21% |
| 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。

### ②　【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③　【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)　【運用実績】

① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 915,626,043 | 915,626,043 | 1.1391 | 1.1391 |
| 2018年6月末日 | 1,481,185,164 | － | 1.1296 | － |
| 7月末日 | 1,582,679,663 | － | 1.1820 | － |
| 8月末日 | 1,643,546,921 | － | 1.1938 | － |
| 9月末日 | 1,687,643,830 | － | 1.2280 | － |
| 10月末日 | 1,566,030,426 | － | 1.1255 | － |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 1,637,273,973 | 1,637,273,973 | 1.1550 | 1.1550 |
| 12月末日 | 1,480,316,051 | － | 1.0441 | － |
| 2019年1月末日 | 1,630,854,913 | － | 1.1134 | － |
| 2月末日 | 1,728,123,046 | － | 1.1729 | － |
| 3月末日 | 1,724,681,285 | － | 1.1744 | － |
| 4月末日 | 1,761,496,621 | － | 1.2231 | － |
| 5月末日 | 1,650,665,014 | － | 1.1434 | － |
| 6月末日 | 1,717,168,429 | － | 1.1863 | － |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | － |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | △1.0 |

(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 | 866,066,727 | 72,233,916 |
| 第2計算期間 | 874,852,673 | 261,158,636 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 293,572,004 | 267,492,378 |

（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（2019年6月28日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 109,266,313,042 | 95.77 |
| | 内　香港 | 1,579,453,356 | 1.38 |
| | 内　シンガポール | 511,814,600 | 0.45 |
| | 内　イスラエル | 237,701,195 | 0.21 |
| | 内　ノルウェー | 280,092,477 | 0.25 |
| | 内　スウェーデン | 1,111,219,030 | 0.97 |
| | 内　デンマーク | 711,862,636 | 0.62 |
| | 内　イギリス | 6,938,164,230 | 6.08 |
| | 内　アイルランド | 225,946,989 | 0.20 |
| | 内　オランダ | 1,500,357,666 | 1.32 |
| | 内　ベルギー | 403,332,292 | 0.35 |
| | 内　フランス | 4,632,445,395 | 4.06 |
| | 内　ドイツ | 3,665,830,557 | 3.21 |
| | 内　スイス | 3,891,618,788 | 3.41 |
| | 内　ポルトガル | 60,383,865 | 0.05 |
| | 内　スペイン | 1,237,195,312 | 1.08 |
| | 内　イタリア | 963,929,770 | 0.84 |
| | 内　フィンランド | 415,090,436 | 0.36 |
| | 内　オーストリア | 88,818,601 | 0.08 |
| | 内　カナダ | 4,251,221,969 | 3.73 |
| | 内　アメリカ | 73,814,148,024 | 64.70 |
| | 内　オーストラリア | 2,644,199,230 | 2.32 |
| | 内　ニュージーランド | 101,486,624 | 0.09 |
| 投資証券 | | 3,152,156,649 | 2.76 |
| | 内　香港 | 106,155,972 | 0.09 |
| | 内　シンガポール | 53,465,838 | 0.05 |
| | 内　イギリス | 70,300,836 | 0.06 |
| | 内　フランス | 122,014,003 | 0.11 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　カナダ | 21,101,920 | 0.02 |
| | 内　アメリカ | 2,414,717,886 | 2.12 |
| | 内　オーストラリア | 364,400,194 | 0.32 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 1,668,371,795 | 1.46 |
| 純資産総額 | | 114,086,841,486 | 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） | | 1,816,611,818 | 1.59 |
| | 内　アメリカ | 1,816,611,818 | 1.59 |
| 為替予約取引（買建） | | 527,779,000 | 0.46 |
| | 内　日本 | 527,779,000 | 0.46 |

（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（2019年6月28日現在）

### ①　投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 199,600 | 11,902.06<br>2,375,657,926 | 14,460.02<br>2,886,221,689 | 2.53 |
| 2 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 129,000 | 19,311.65<br>2,491,211,684 | 21,529.97<br>2,777,366,723 | 2.43 |
| 3 | AMAZON.COM INC | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 11,430 | 180,800.26<br>2,066,547,297 | 205,262.34<br>2,346,148,560 | 2.06 |
| 4 | FACEBOOK INC-CLASS A | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 65,150 | 15,002.85<br>977,436,260 | 20,426.20<br>1,330,767,256 | 1.17 |
| 5 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 73,000 | 15,672.66<br>1,144,109,576 | 15,164.97<br>1,107,043,182 | 0.97 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 6 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 89,870 | 11,832.00<br>1,063,342,357 | 11,731.86<br>1,054,342,582 | 0.92 |
| 7 | ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 8,627 | 117,298.47<br>1,011,934,223 | 115,983.11<br>1,000,586,358 | 0.88 |
| 8 | ALPHABET INC-CL A | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 8,200 | 117,980.68<br>967,442,316 | 116,049.94<br>951,609,571 | 0.83 |
| 9 | NESTLE SA-REG | スイス | 株式 | 生活必需品 | 85,550 | 9,434.63<br>807,136,278 | 11,106.85<br>950,191,189 | 0.83 |
| 10 | EXXON MOBIL CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 116,055 | 8,490.51<br>985,371,533 | 8,172.63<br>948,475,480 | 0.83 |
| 11 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 48,050 | 15,031.74<br>722,277,373 | 18,456.88<br>886,853,166 | 0.78 |
| 12 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融 | 35,800 | 23,396.46<br>837,597,232 | 22,853.63<br>818,160,162 | 0.72 |
| 13 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 68,667 | 10,045.70<br>689,814,225 | 11,833.18<br>812,549,397 | 0.71 |
| 14 | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 株式 | 金融 | 251,101 | 3,020.81<br>758,529,732 | 3,040.75<br>763,536,847 | 0.67 |
| 15 | WALT DISNEY CO/THE | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 49,412 | 12,384.74<br>611,955,791 | 15,015.14<br>741,928,444 | 0.65 |
| 16 | CISCO SYSTEMS INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 121,050 | 5,096.95<br>616,994,078 | 6,007.13<br>727,163,898 | 0.64 |
| 17 | PFIZER INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 155,313 | 4,900.34<br>761,095,859 | 4,681.31<br>727,069,807 | 0.64 |
| 18 | AT&T INC | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 199,991 | 3,296.11<br>659,200,646 | 3,554.91<br>710,950,846 | 0.62 |
| 19 | MASTERCARD INC - A | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 25,050 | 21,245.51<br>532,201,861 | 28,143.96<br>705,006,423 | 0.62 |
| 20 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | アメリカ | 株式 | コミュニケーション･サービス | 113,504 | 6,390.00<br>725,294,528 | 6,170.97<br>700,430,630 | 0.61 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 21 | UNITEDHEALTH GROUP INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 26,326 | 30,365.73<br>799,408,992 | 26,552.98<br>699,033,978 | 0.61 |
| 22 | CHEVRON CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 52,068 | 12,800.17<br>666,483,479 | 13,270.02<br>690,943,761 | 0.61 |
| 23 | HOME DEPOT INC | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 30,950 | 18,973.19<br>587,222,868 | 22,314.68<br>690,639,526 | 0.61 |
| 24 | MERCK & CO. INC. | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 70,771 | 8,393.93<br>594,048,940 | 9,036.03<br>639,489,283 | 0.56 |
| 25 | INTEL CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 123,550 | 5,140.18<br>635,069,453 | 5,115.71<br>632,046,391 | 0.55 |
| 26 | COCA-COLA CO/THE | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 111,550 | 5,276.96<br>588,646,957 | 5,505.91<br>614,184,617 | 0.54 |
| 27 | WELLS FARGO & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 120,222 | 5,805.89<br>697,997,010 | 4,989.59<br>599,859,583 | 0.53 |
| 28 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | スイス | 株式 | ヘルスケア | 19,640 | 28,152.71<br>552,920,798 | 30,213.59<br>593,395,055 | 0.52 |
| 29 | NOVARTIS AG-REG | スイス | 株式 | ヘルスケア | 60,200 | 8,773.37<br>528,161,041 | 9,853.24<br>593,165,319 | 0.52 |
| 30 | BOEING CO/THE | アメリカ | 株式 | 資本財・サービス | 14,740 | 36,956.12<br>544,734,664 | 39,237.71<br>578,363,931 | 0.51 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 株式 | 95.77% |
| 投資証券 | 2.76% |
| 合計 | 98.54% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種 | 投資比率 |
|---|---|
| エネルギー | 5.93% |
| 素材 | 4.46% |
| 資本財・サービス | 10.06% |
| 一般消費財・サービス | 9.65% |
| 生活必需品 | 8.45% |

| | |
|---|---|
| ヘルスケア | 12.72% |
| 金融 | 15.93% |
| 情報技術 | 16.51% |
| コミュニケーション・サービス | 8.10% |
| 公益事業 | 3.43% |
| 不動産 | 0.54% |
| 合計 | 95.77% |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

### ② 投資不動産物件

該当事項はありません。

### ③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | S&P500 E-MINI FUTURE 2019年9月 | 買建 | 115 | 1,799,081,930 | 1,816,611,818 | 1.59% |
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 4,900,000 | 528,011,860 | 527,779,000 | 0.46% |

(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（2019年6月28日現在）

投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 株式 | | 6,452,516,886 | 88.22 |
| | 内　中国 | 2,145,806,244 | 29.34 |
| | 内　台湾 | 801,211,930 | 10.95 |
| | 内　タイ | 244,054,878 | 3.34 |
| | 内　シンガポール | 5,777,119 | 0.08 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 内　マレーシア | 93,783,003 | 1.28 |
| | 内　インドネシア | 127,946,342 | 1.75 |
| | 内　インド | 585,801,644 | 8.01 |
| | 内　ロシア | 656,287,632 | 8.97 |
| | 内　トルコ | 123,006,032 | 1.68 |
| | 内　メキシコ | 241,252,708 | 3.30 |
| | 内　チリ | 61,228,668 | 0.84 |
| | 内　ブラジル | 892,223,686 | 12.20 |
| | 内　南アフリカ | 474,137,000 | 6.48 |
| 投資証券 | | 731,283,242 | 10.00 |
| | 内　トルコ | 3,627,901 | 0.05 |
| | 内　アメリカ | 699,772,680 | 9.57 |
| | 内　メキシコ | 9,660,235 | 0.13 |
| | 内　南アフリカ | 18,222,426 | 0.25 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 130,265,167 | 1.78 |
| 純資産総額 | | 7,314,065,295 | 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） | | 96,761,466 | 1.32 |
| | 内　アメリカ | 96,761,466 | 1.32 |
| 為替予約取引（買建） | | 11,575,883 | 0.16 |
| | 内　日本 | 11,575,883 | 0.16 |
| 為替予約取引（売建） | | 845,740 | △0.01 |
| | 内　日本 | 845,740 | △0.01 |

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

(注2)　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（2019年6月28日現在）

### ① 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | INVESCO FTSE RAFI EMERGING M | アメリカ | 投資証券 | ― | 300,000 | 2,252.81<br>675,851,742 | 2,332.57<br>699,772,680 | 9.57 |
| 2 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 中国 | 株式 | 金融 | 3,091,000 | 96.86<br>299,412,118 | 92.11<br>284,734,265 | 3.89 |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 259,000 | 789.97<br>204,604,660 | 834.53<br>216,144,565 | 2.96 |
| 4 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 中国 | 株式 | 金融 | 2,494,000 | 80.40<br>200,558,067 | 78.32<br>195,348,037 | 2.67 |
| 5 | GAZPROM PJSC-SPON ADR | ロシア | 株式 | エネルギー | 187,960 | 477.94<br>89,859,075 | 790.10<br>148,507,328 | 2.03 |
| 6 | LUKOIL PJSC-SPON ADR | ロシア | 株式 | エネルギー | 15,880 | 7,551.01<br>119,911,518 | 9,211.73<br>146,282,326 | 2.00 |
| 7 | BANK OF CHINA LTD-H | 中国 | 株式 | 金融 | 3,013,000 | 52.08<br>156,952,974 | 45.36<br>136,697,098 | 1.87 |
| 8 | CHINA MOBILE LTD | 中国 | 株式 | コミュニケーション・サービス | 130,500 | 951.02<br>124,110,737 | 984.60<br>128,491,083 | 1.76 |
| 9 | SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR | ロシア | 株式 | 金融 | 70,450 | 1,448.05<br>102,020,514 | 1,668.58<br>117,552,109 | 1.61 |
| 10 | VALE SA | ブラジル | 株式 | 素材 | 80,190 | 1,392.05<br>111,630,724 | 1,457.42<br>116,870,750 | 1.60 |
| 11 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | ブラジル | 株式 | 金融 | 107,336 | 836.36<br>89,773,564 | 1,021.88<br>109,685,317 | 1.50 |
| 12 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 中国 | 株式 | エネルギー | 1,297,800 | 94.70<br>122,925,725 | 73.77<br>95,747,142 | 1.31 |
| 13 | BANCO BRADESCO SA-PREF | ブラジル | 株式 | 金融 | 78,160 | 680.19<br>53,166,045 | 1,068.40<br>83,506,222 | 1.14 |
| 14 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 中国 | 株式 | 金融 | 63,500 | 1,049.73<br>66,658,476 | 1,296.94<br>82,356,293 | 1.13 |
| 15 | CNOOC LTD | 中国 | 株式 | エネルギー | 396,000 | 176.51<br>69,900,421 | 185.61<br>73,502,906 | 1.00 |
| 16 | PTT PCL-NVDR | タイ | 株式 | エネルギー | 386,000 | 169.82<br>65,553,087 | 170.62<br>65,861,250 | 0.90 |
| 17 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | ブラジル | 株式 | エネルギー | 85,100 | 534.82<br>45,515,400 | 767.61<br>65,323,926 | 0.89 |
| 18 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | インド | 株式 | エネルギー | 31,860 | 1,620.18<br>51,619,299 | 2,000.41<br>63,733,238 | 0.87 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 19 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 中国 | 株式 | 一般消費財・サービス | 3,400 | 19,523.46<br>66,379,777 | 18,421.31<br>62,632,457 | 0.86 |
| 20 | TENCENT HOLDINGS LTD | 中国 | 株式 | コミュニケーション・サービス | 12,600 | 5,085.97<br>64,083,285 | 4,865.11<br>61,300,411 | 0.84 |
| 21 | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | メキシコ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 764,100 | 88.49<br>67,621,541 | 79.07<br>60,419,985 | 0.83 |
| 22 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 218,902 | 356.82<br>78,109,054 | 268.57<br>58,792,261 | 0.80 |
| 23 | BANCO DO BRASIL S.A. | ブラジル | 株式 | 金融 | 37,600 | 873.55<br>32,846,596 | 1,516.62<br>57,024,987 | 0.78 |
| 24 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | ブラジル | 株式 | エネルギー | 64,100 | 592.55<br>37,983,505 | 842.59<br>54,010,602 | 0.74 |
| 25 | STANDARD BANK GROUP LTD | 南アフリカ | 株式 | 金融 | 30,290 | 1,487.22<br>45,047,964 | 1,506.39<br>45,628,735 | 0.62 |
| 26 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 中国 | 株式 | 金融 | 1,008,000 | 50.26<br>50,669,720 | 45.09<br>45,454,046 | 0.62 |
| 27 | MTN GROUP LTD | 南アフリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 54,410 | 797.72<br>43,404,518 | 817.22<br>44,465,375 | 0.61 |
| 28 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | インド | 株式 | 金融 | 12,470 | 3,049.43<br>38,026,455 | 3,446.85<br>42,982,301 | 0.59 |
| 29 | INFOSYS LTD | インド | 株式 | 情報技術 | 36,240 | 1,068.94<br>38,738,554 | 1,146.96<br>41,565,957 | 0.57 |
| 30 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 中国 | 株式 | 金融 | 76,500 | 407.41<br>31,167,337 | 543.32<br>41,564,439 | 0.57 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 株式 | 88.22% |
| 投資証券 | 10.00% |
| 合計 | 98.22% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種 | 投資比率 |
|---|---|
| エネルギー | 15.18% |
| 素材 | 8.95% |
| 資本財・サービス | 2.98% |
| 一般消費財・サービス | 4.86% |
| 生活必需品 | 4.49% |
| ヘルスケア | 0.62% |
| 金融 | 30.25% |
| 情報技術 | 7.68% |
| コミュニケーション・サービス | 8.16% |
| 公益事業 | 2.63% |
| 不動産 | 2.42% |
| 合計 | 88.22% |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | MSCI EMGMKT 2019年9月 | 買建 | 17 | 92,533,565 | 96,761,466 | 1.32% |
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 7,767 | 845,756 | 836,883 | 0.01% |
| | | 米ドル買/円売 2019年8月 | 買建 | 100,000 | 10,726,660 | 10,739,000 | 0.15% |
| | | インドネシア・ルピア売/円買 2019年7月 | 売建 | 104,269,745 | 802,876 | 802,876 | △0.01% |
| | | マレーシア・リンギット売/円買 2019年7月 | 売建 | 1,648 | 42,880 | 42,864 | △0.00% |

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

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

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

（注4） 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FWO 外国株式インデックスEM+ （為替ヘッジなし）

2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

**基準価額・純資産の推移**

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 11,863円 |
| 純資産総額 | 17億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 3.8% |
| 3カ月間 | 1.0% |
| 6カ月間 | 13.6% |
| 1年間 | 5.0% |
| 3年間 | － |
| 5年間 | － |
| 設定来 | 18.6% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

**分配の推移（10,000口当たり、税引前）**

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

| 決算期 | 第1期 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 外国株式・先物 | 1,621 | 95.0% |
| 外国リート | 67 | 2.2% |
| 外国投資証券 | 7 | 2.0% |
| | | |
| コール・ローン、その他 | | 2.3% |
| 合計 | 1,695 | － |

| 国・地域別構成 | 比率 |
|---|---|
| アメリカ | 56.4% |
| 中国 | 5.9% |
| その他 | 37.0% |
| 合計 | 99.2% |

| 通貨別構成 | 比率 |
|---|---|
| 米ドル | 58.6% |
| ユーロ | 9.2% |
| 香港ドル | 6.6% |
| 英ポンド | 4.9% |
| カナダ・ドル | 3.0% |
| スイス・フラン | 2.7% |
| ブラジル・レアル | 2.5% |
| 台湾ドル | 2.2% |
| 豪ドル | 2.1% |
| その他 | 8.2% |
| 合計 | 100.0% |

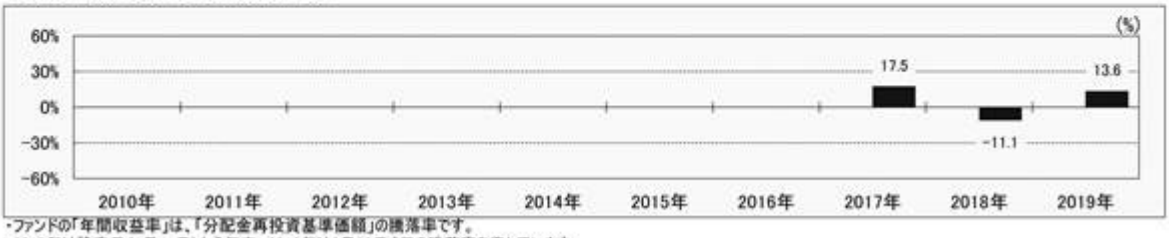
| 株式業種別構成 | 比率 |
|---|---|
| 金融 | 18.7% |
| 情報技術 | 14.6% |
| ヘルスケア | 10.2% |
| 一般消費財・サービス | 8.6% |
| 資本財・サービス | 8.6% |
| コミュニケーション・サービス | 8.0% |
| エネルギー | 7.7% |
| 生活必需品 | 7.6% |
| 素材 | 5.3% |
| 公益事業、他 | 4.2% |
| 合計 | 93.5% |

| 組入上位10銘柄 | 国・地域名 | 比率 |
|---|---|---|
| MICROSOFT CORP | アメリカ | 2.0% |
| APPLE INC | アメリカ | 1.9% |
| INVESCO FTSE RAFI EMERGING M | アメリカ | 1.9% |
| AMAZON.COM INC | アメリカ | 1.6% |
| S&P500 EMINI FUT 201909 | アメリカ | 1.3% |
| FACEBOOK INC-CLASS A | アメリカ | 0.9% |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 中国 | 0.8% |
| JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 0.8% |
| JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 0.7% |
| ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 0.7% |
| 合計 | | 12.6% |

※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。
※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、2019年は6月28日までの騰落率を表しています。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

**【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】 (2019年6月28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 | | 2,114,081,988 | 99.90 |
| | 内 日本 | 2,114,081,988 | 99.90 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 2,105,795 | 0.10 |
| 純資産総額 | | 2,116,187,783 | 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】 (2019年6月28日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 1,468,316,425 | 1.4002<br>2,056,058,928 | 1.4398<br>2,114,081,988 | 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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### ① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 1,379,006,108 | 1,379,006,108 | 1.0010 | 1.0010 |
| 2018年6月末日 | 2,059,702,920 | ― | 1.0067 | ― |
| 7月末日 | 2,125,169,402 | ― | 1.0048 | ― |
| 8月末日 | 2,158,438,460 | ― | 0.9993 | ― |
| 9月末日 | 2,161,594,618 | ― | 0.9968 | ― |
| 10月末日 | 2,140,979,990 | ― | 0.9984 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 2,161,576,187 | 2,161,576,187 | 1.0025 | 1.0025 |
| 12月末日 | 2,137,330,348 | ― | 1.0099 | ― |
| 2019年1月末日 | 2,201,947,376 | ― | 1.0138 | ― |
| 2月末日 | 2,268,428,363 | ― | 1.0158 | ― |
| 3月末日 | 2,356,881,688 | ― | 1.0229 | ― |
| 4月末日 | 2,080,123,740 | ― | 1.0195 | ― |
| 5月末日 | 2,086,043,244 | ― | 1.0260 | ― |
| 6月末日 | 2,116,187,783 | ― | 1.0322 | ― |

#### ② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

#### ③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 2.3 |

### (4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定数量 (口) | 解約数量 (口) |
|---|---|---|
| 第1計算期間 | 1,498,842,558 | 122,203,095 |

| | | |
|---|---|---|
| 第2計算期間 | 1,389,815,832 | 611,289,476 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 540,518,219 | 663,518,444 |

(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（2019年6月28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 | | 69,647,848,390 | 86.42 |
| | 内　日本 | 69,647,848,390 | 86.42 |
| 地方債証券 | | 4,263,713,900 | 5.29 |
| | 内　日本 | 4,263,713,900 | 5.29 |
| 特殊債券 | | 2,940,989,700 | 3.65 |
| | 内　日本 | 2,940,989,700 | 3.65 |
| 社債券 | | 3,121,950,600 | 3.87 |
| | 内　日本 | 3,121,950,600 | 3.87 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 614,297,064 | 0.76 |
| 純資産総額 | | 80,588,799,654 | 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（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 127　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,380,000,000 | 100.54<br>1,387,462,600 | 100.54<br>1,387,493,400 | 0.100000<br>2021/03/20 | 1.72 |
| 2 | 129　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,020,000,000 | 100.64<br>1,026,579,000 | 100.72<br>1,027,395,000 | 0.100000<br>2021/09/20 | 1.27 |
| 3 | 128　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,000,000,000 | 100.60<br>1,006,000,000 | 100.63<br>1,006,330,000 | 0.100000<br>2021/06/20 | 1.25 |
| 4 | 125　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 940,000,000 | 100.44<br>944,145,400 | 100.36<br>943,449,800 | 0.100000<br>2020/09/20 | 1.17 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5 | 130 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 930,000,000 | 100.71<br>936,611,900 | 100.80<br>937,505,100 | 0.100000<br>2021/12/20 | 1.16 |
| 6 | 131 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 920,000,000 | 100.76<br>926,992,000 | 100.90<br>928,298,400 | 0.100000<br>2022/03/20 | 1.15 |
| 7 | 135 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 880,000,000 | 100.94<br>888,342,200 | 101.29<br>891,387,200 | 0.100000<br>2023/03/20 | 1.11 |
| 8 | 343 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 830,000,000 | 101.05<br>838,789,700 | 102.55<br>851,206,500 | 0.100000<br>2026/06/20 | 1.06 |
| 9 | 342 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 830,000,000 | 101.09<br>839,105,100 | 102.46<br>850,426,300 | 0.100000<br>2026/03/20 | 1.06 |
| 10 | 334 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 800,000,000 | 103.87<br>830,992,000 | 104.33<br>834,640,000 | 0.600000<br>2024/06/20 | 1.04 |
| 11 | 349 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 800,000,000 | 100.66<br>805,300,500 | 102.85<br>822,808,000 | 0.100000<br>2027/12/20 | 1.02 |
| 12 | 346 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 800,000,000 | 100.87<br>806,968,000 | 102.79<br>822,352,000 | 0.100000<br>2027/03/20 | 1.02 |
| 13 | 335 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 780,000,000 | 103.43<br>806,816,400 | 104.02<br>811,379,400 | 0.500000<br>2024/09/20 | 1.01 |
| 14 | 340 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 770,000,000 | 103.13<br>794,170,300 | 104.17<br>802,132,100 | 0.400000<br>2025/09/20 | 1.00 |
| 15 | 126 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 790,000,000 | 100.50<br>793,960,800 | 100.46<br>793,665,600 | 0.100000<br>2020/12/20 | 0.98 |
| 16 | 344 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 101.07<br>707,493,800 | 102.64<br>718,543,000 | 0.100000<br>2026/09/20 | 0.89 |
| 17 | 312 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 102.73<br>719,173,000 | 102.08<br>714,616,000 | 1.200000<br>2020/12/20 | 0.89 |
| 18 | 136 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 100.98<br>706,874,000 | 101.42<br>709,961,000 | 0.100000<br>2023/06/20 | 0.88 |
| 19 | 333 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 680,000,000 | 103.75<br>705,516,600 | 104.10<br>707,927,600 | 0.600000<br>2024/03/20 | 0.88 |
| 20 | 339 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 680,000,000 | 103.09<br>701,012,000 | 104.00<br>707,213,600 | 0.400000<br>2025/06/20 | 0.88 |
| 21 | 350 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 670,000,000 | 100.46<br>673,094,200 | 102.79<br>688,746,600 | 0.100000<br>2028/03/20 | 0.85 |
| 22 | 132 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 680,000,000 | 100.80<br>685,477,800 | 100.98<br>686,704,800 | 0.100000<br>2022/06/20 | 0.85 |
| 23 | 138 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 650,000,000 | 101.26<br>658,236,000 | 101.62<br>660,582,000 | 0.100000<br>2023/12/20 | 0.82 |
| 24 | 345 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 630,000,000 | 101.38<br>638,721,600 | 102.74<br>647,274,600 | 0.100000<br>2026/12/20 | 0.80 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 25 | 352　10年国債 | 日本 | 国債証券 | 630,000,000 | 100.38<br>632,439,300 | 102.67<br>646,839,900 | 0.100000<br>2028/09/20 | 0.80 |
| 26 | 330　10年国債 | 日本 | 国債証券 | 612,000,000 | 104.38<br>638,854,560 | 104.48<br>639,417,600 | 0.800000<br>2023/09/20 | 0.79 |
| 27 | 139　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 620,000,000 | 101.40<br>628,721,600 | 101.71<br>630,657,800 | 0.100000<br>2024/03/20 | 0.78 |
| 28 | 134　5年国債 | 日本 | 国債証券 | 610,000,000 | 100.92<br>615,662,500 | 101.19<br>617,259,000 | 0.100000<br>2022/12/20 | 0.77 |
| 29 | 348　10年国債 | 日本 | 国債証券 | 600,000,000 | 100.70<br>604,212,000 | 102.85<br>617,106,000 | 0.100000<br>2027/09/20 | 0.77 |
| 30 | 351　10年国債 | 日本 | 国債証券 | 600,000,000 | 100.52<br>603,165,000 | 102.74<br>616,440,000 | 0.100000<br>2028/06/20 | 0.76 |

(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 | 86.42% |
| 地方債証券 | 5.29% |
| 特殊債券 | 3.65% |
| 社債券 | 3.87% |
| 合計 | 99.24% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●FWO 日本債券インデックス

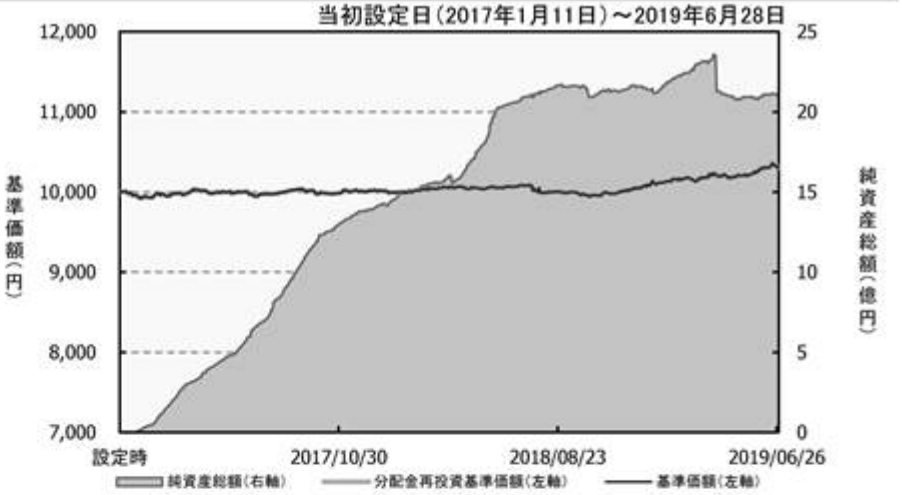
2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

**基準価額・純資産の推移**

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 10,322円 |
| 純資産総額 | 21億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 0.6% |
| 3カ月間 | 0.9% |
| 6カ月間 | 2.2% |
| 1年間 | 2.5% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 3.2% |




※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

**分配の推移（10,000口当たり、税引前）**

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

| 決算期 | 第1期 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 | 352 | 99.1% | 直接利回り(%) | 0.8 | 127　5年国債 | 0.100 | 2021/03/20 | 1.7% |
| 国内債券先物 | - | - | 最終利回り(%) | -0.1 | 129　5年国債 | 0.100 | 2021/09/20 | 1.3% |
| コール・ローン、その他 | | 0.9% | 修正デュレーション | 9.5 | 128　5年国債 | 0.100 | 2021/06/20 | 1.2% |
| 合計 | 352 | 100.0% | 残存年数 | 10.4 | 125　5年国債 | 0.100 | 2020/09/20 | 1.2% |
| 債券種別構成 | | 比率 | 格付別構成 | 比率 | 130　5年国債 | 0.100 | 2021/12/20 | 1.2% |
| 国債 | | 86.1% | AAA | 89.5% | 131　5年国債 | 0.100 | 2022/03/20 | 1.2% |
| 地方債 | | 6.5% | AA | 4.8% | 135　5年国債 | 0.100 | 2023/03/20 | 1.1% |
| 事業債 | | 4.0% | A | 3.0% | 343　10年国債 | 0.100 | 2026/06/20 | 1.1% |
| 政府保証債 | | 2.1% | BBB | 0.1% | 342　10年国債 | 0.100 | 2026/03/20 | 1.1% |
| その他 | | 0.5% | BB以下・無格付 | 2.7% | 334　10年国債 | 0.600 | 2024/06/20 | 1.0% |
| 合計 | | 99.1% | 合計 | 100.0% | 合計 | | | 12.0% |

※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2.7%保有しております。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

**年間収益率の推移**

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

・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、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 【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】（2019年6月28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 | | 3,515,776,284 | 99.90 |
| | 内　日本 | 3,515,776,284 | 99.90 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 3,428,370 | 0.10 |
| 純資産総額 | | 3,519,204,654 | 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】（2019年6月28日現在）

### ①　【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 3,490,990,254 | 0.9521<br>3,324,051,967 | 1.0071<br>3,515,776,284 | 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。

### ②　【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③　【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)　【運用実績】

### ①　【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 2,166,190,168 | 2,166,190,168 | 1.0078 | 1.0078 |
| 2018年6月末日 | 3,366,159,362 | ― | 0.9961 | ― |
| 7月末日 | 3,443,477,714 | ― | 0.9913 | ― |
| 8月末日 | 3,530,927,508 | ― | 0.9925 | ― |
| 9月末日 | 3,534,386,958 | ― | 0.9859 | ― |
| 10月末日 | 3,537,380,454 | ― | 0.9831 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 3,598,169,224 | 3,598,169,224 | 0.9860 | 0.9860 |
| 12月末日 | 3,622,379,336 | ― | 0.9993 | ― |
| 2019年1月末日 | 3,671,697,515 | ― | 1.0033 | ― |
| 2月末日 | 3,741,591,801 | ― | 1.0021 | ― |
| 3月末日 | 3,883,113,999 | ― | 1.0204 | ― |
| 4月末日 | 3,399,081,842 | ― | 1.0131 | ― |
| 5月末日 | 3,455,430,165 | ― | 1.0275 | ― |
| 6月末日 | 3,519,204,654 | ― | 1.0436 | ― |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 4.2 |

(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 | 2,296,791,192 | 148,346,007 |
| 第2計算期間 | 2,190,846,317 | 691,122,259 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 727,616,316 | 1,013,750,890 |

(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（2019年6月28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 | | 87,905,297,528 | 97.29 |
| | 内　ユーロ | 33,764,875,129 | 37.37 |
| | 内　シンガポール | 302,198,366 | 0.33 |
| | 内　マレーシア | 303,933,619 | 0.34 |
| | 内　ノルウェー | 180,017,560 | 0.20 |
| | 内　スウェーデン | 379,471,587 | 0.42 |
| | 内　デンマーク | 423,314,249 | 0.47 |
| | 内　イギリス | 5,731,776,305 | 6.34 |
| | 内　ポーランド | 457,831,145 | 0.51 |
| | 内　カナダ | 1,783,094,762 | 1.97 |
| | 内　アメリカ | 41,822,036,922 | 46.28 |
| | 内　メキシコ | 558,356,681 | 0.62 |
| | 内　南アフリカ | 436,396,407 | 0.48 |
| | 内　オーストラリア | 1,761,994,796 | 1.95 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,452,660,485 | 2.71 |
| 純資産総額 | | 90,357,958,013 | 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） | | 618,083,139 | 0.68 |
| | 内　ドイツ | 382,076,933 | 0.42 |
| | 内　アメリカ | 236,006,206 | 0.26 |
| 為替予約取引（売建） | | 88,266,995,420 | △97.69 |
| | 内　日本 | 88,266,995,420 | △97.69 |

(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)　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（2019年6月28日現在）

### ① 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 32,370,000 | 100.93<br>3,521,716,184 | 101.04<br>3,525,519,371 | 2.625000<br>2020/11/15 | 3.90 |
| 2 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 24,540,000 | 99.84<br>2,641,119,495 | 99.91<br>2,642,971,111 | 1.875000<br>2020/06/30 | 2.93 |
| 3 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 22,990,000 | 100.54<br>2,491,622,482 | 100.72<br>2,496,083,048 | 2.125000<br>2021/06/30 | 2.76 |
| 4 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 18,946,000 | 100.44<br>2,051,358,770 | 100.64<br>2,055,341,039 | 2.000000<br>2021/11/15 | 2.27 |
| 5 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 16,720,000 | 99.76<br>1,798,013,515 | 100.06<br>1,803,366,194 | 1.750000<br>2022/09/30 | 2.00 |
| 6 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 15,450,000 | 99.82<br>1,662,357,860 | 100.05<br>1,666,254,791 | 1.750000<br>2022/02/28 | 1.84 |
| 7 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 14,500,000 | 99.34<br>1,552,686,385 | 99.66<br>1,557,640,953 | 1.625000<br>2022/11/15 | 1.72 |
| 8 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 14,020,000 | 99.68<br>1,506,485,694 | 100.03<br>1,511,805,174 | 1.750000<br>2023/05/15 | 1.67 |
| 9 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 12,905,000 | 103.83<br>1,444,375,948 | 104.20<br>1,449,494,938 | 2.750000<br>2023/11/15 | 1.60 |
| 10 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 12,580,000 | 103.03<br>1,397,098,505 | 103.42<br>1,402,386,898 | 2.500000<br>2024/05/15 | 1.55 |
| 11 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 11,810,000 | 101.89<br>1,297,059,598 | 102.29<br>1,302,227,977 | 2.250000<br>2024/11/15 | 1.44 |
| 12 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 10,040,000 | 102.80<br>1,112,513,524 | 102.91<br>1,113,779,712 | 3.625000<br>2021/02/15 | 1.23 |
| 13 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 9,600,000 | 105.82<br>1,095,008,428 | 107.02<br>1,107,456,880 | 2.875000<br>2043/05/15 | 1.23 |
| 14 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 9,820,000 | 100.45<br>1,063,292,795 | 100.91<br>1,068,172,469 | 2.000000<br>2025/08/15 | 1.18 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 15 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,750,000 | 131.52<br>956,938,331 | 132.17<br>961,653,066 | 6.125000<br>2027/11/15 | 1.06 |
| 16 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 8,700,000 | 101.85<br>955,131,178 | 102.36<br>959,970,086 | 2.250000<br>2025/11/15 | 1.06 |
| 17 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 7,900,000 | 106.65<br>908,219,568 | 107.32<br>913,873,801 | 2.875000<br>2028/05/15 | 1.01 |
| 18 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 8,300,000 | 101.17<br>905,205,006 | 101.63<br>909,257,802 | 2.125000<br>2025/05/15 | 1.01 |
| 19 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,030,000 | 117.66<br>764,785,054 | 118.92<br>773,007,221 | 3.500000<br>2039/02/15 | 0.86 |
| 20 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,310,000 | 103.00<br>700,559,547 | 104.39<br>710,068,112 | 2.750000<br>2047/08/15 | 0.79 |
| 21 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,310,000 | 102.66<br>698,274,226 | 103.02<br>700,715,982 | 2.500000<br>2023/08/15 | 0.78 |
| 22 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,300,000 | 110.73<br>632,608,946 | 112.25<br>641,309,647 | 3.125000<br>2048/05/15 | 0.71 |
| 23 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,500,000 | 101.41<br>601,204,114 | 101.55<br>602,081,525 | 2.625000<br>2021/05/15 | 0.67 |
| 24 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 3,800,000 | 140.16<br>574,114,547 | 141.02<br>577,633,028 | 6.250000<br>2030/05/15 | 0.64 |
| 25 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,200,000 | 101.44<br>568,616,394 | 101.67<br>569,874,088 | 2.125000<br>2024/07/31 | 0.63 |
| 26 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,000,000 | 104.02<br>560,631,958 | 104.41<br>562,739,253 | 2.750000<br>2024/02/15 | 0.62 |
| 27 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,165,000 | 97.81<br>544,553,980 | 98.35<br>547,554,784 | 1.625000<br>2026/05/15 | 0.61 |
| 28 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 4,270,000 | 104.24<br>545,255,942 | 104.16<br>544,795,674 | 2.500000<br>2020/10/25 | 0.60 |
| 29 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,000,000 | 100.11<br>539,580,571 | 100.32<br>540,674,640 | 1.875000<br>2022/01/31 | 0.60 |
| 30 | United Kingdom Gilt | イギリス | 国債証券 | 2,243,000 | 169.98<br>520,693,801 | 168.87<br>517,293,577 | 4.250000<br>2049/12/07 | 0.57 |

(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 | 97.29% |
| 合計 | 97.29% |

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

### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### ② 投資不動産物件

該当事項はありません。

### ③ その他投資資産の主要なもの

(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 | T-NOTE(5YR) 2019年9月 | 買建 | 8 | 101,517,967 | 101,888,498 | 0.11% |
| | | T-BOND(ULTRA LONG) 2019年9月 | 買建 | 7 | 133,415,062 | 134,117,708 | 0.15% |
| | ﾄﾞｲﾂ | BUNDS 2019年9月 | 買建 | 5 | 105,875,701 | 105,721,119 | 0.12% |
| | | BOBL(5YR) 2019年9月 | 買建 | 3 | 49,274,052 | 49,376,944 | 0.05% |
| | | BTP 10YR 2019年9月 | 買建 | 4 | 64,606,126 | 65,537,050 | 0.07% |
| | | OAT 10YR 2019年9月 | 買建 | 8 | 161,600,959 | 161,441,820 | 0.18% |
| 為替予約取引 | 日本 | マレーシア・リンギット売/円買 2019年8月 | 売建 | 11,280,000 | 292,286,232 | 292,377,600 | △0.32% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 14,674,000 | 182,984,780 | 185,772,840 | △0.21% |
| | | ポーランド・ズロチ売/円買 2019年7月 | 売建 | 17,491,000 | 500,067,690 | 503,565,890 | △0.56% |
| | | スウェーデン・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 33,106,000 | 379,063,700 | 384,360,660 | △0.43% |
| | | シンガポール・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 3,916,000 | 309,912,240 | 311,752,760 | △0.35% |
| | | 米ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 391,076,000 | 42,414,755,215 | 42,111,063,680 | △46.60% |
| | | メキシコ・ペソ売/円買 2019年7月 | 売建 | 106,000,000 | 597,840,000 | 593,600,000 | △0.66% |
| | | 英ポンド売/円買 2019年7月 | 売建 | 42,389,000 | 5,792,847,454 | 5,786,098,500 | △6.40% |
| | | 南アフリカ・ランド売/円買 2019年7月 | 売建 | 59,418,000 | 434,345,580 | 450,388,440 | △0.50% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買 2019年7月 | 売建 | 26,021,000 | 424,662,720 | 427,004,610 | △0.47% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | カナダ・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 21,609,000 | 1,748,168,100 | 1,777,556,340 | △1.97% |
| | | 豪ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 23,538,000 | 1,757,111,700 | 1,775,471,340 | △1.96% |
| | | ユーロ売/円買 2019年7月 | 売建 | 274,908,000 | 33,504,609,671 | 33,667,982,760 | △37.26% |

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

(注2) 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)

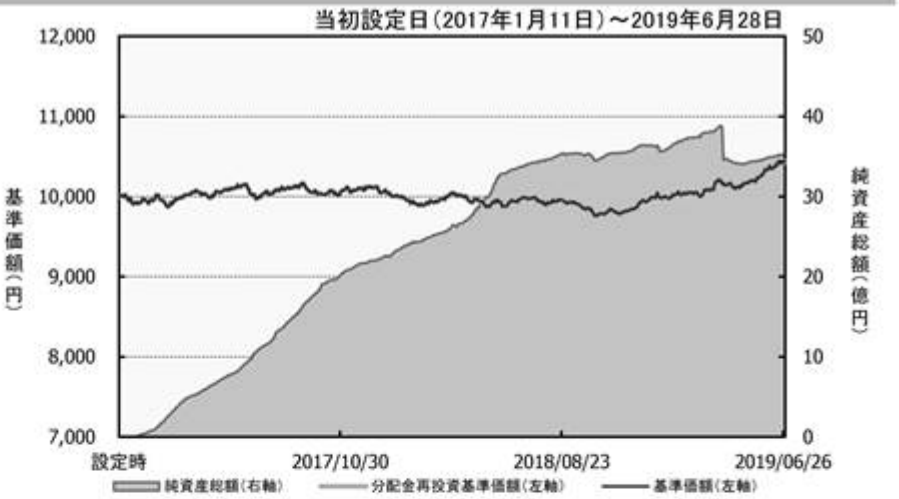
2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

**基準価額・純資産の推移**

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 10,436円 |
| 純資産総額 | 35億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 1.6% |
| 3カ月間 | 2.3% |
| 6カ月間 | 4.4% |
| 1年間 | 4.8% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 4.4% |




※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

**分配の推移（10,000口当たり、税引前）**

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

| 決算期 | 第1期 17年11月 | 第2期 18年11月 |
|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 外国債券・先物 | 431 | 97.9% |
| コール・ローン、その他 | | 2.8% |
| 合計 | 431 | - |

| 債券種別構成 | 比率 |
|---|---|
| 国債 | 97.2% |
| 合計 | 97.2% |

| 通貨別構成 | 比率 |
|---|---|
| 日本円 | 99.3% |
| ユーロ | 0.6% |
| カナダ・ドル | 0.0% |
| マレーシア・リンギット | 0.0% |
| 米ドル | 0.0% |
| 豪ドル | 0.0% |
| メキシコ・ペソ | 0.0% |
| デンマーク・クローネ | 0.0% |
| スウェーデン・クローネ | 0.0% |
| その他 | 0.0% |
| 合計 | 100.0% |

| 債券ポートフォリオ特性値 | |
|---|---|
| 直接利回り(%) | 2.5 |
| 最終利回り(%) | 1.3 |
| 修正デュレーション | 7.4 |
| 残存年数 | 9.4 |

| 格付別構成 | 比率 |
|---|---|
| AAA | 80.7% |
| AA | 7.5% |
| A | 11.3% |
| BBB | 0.5% |
| BB | - |
| 合計 | 100.0% |

| 組入上位10銘柄 | 償還日 | 比率 |
|---|---|---|
| United States Treasury Note/Bond | 2020/11/15 | 3.9% |
| United States Treasury Note/Bond | 2020/06/30 | 2.9% |
| United States Treasury Note/Bond | 2021/06/30 | 2.8% |
| United States Treasury Note/Bond | 2021/11/15 | 2.3% |
| United States Treasury Note/Bond | 2022/09/30 | 2.0% |
| United States Treasury Note/Bond | 2022/02/28 | 1.8% |
| United States Treasury Note/Bond | 2022/11/15 | 1.7% |
| United States Treasury Note/Bond | 2023/05/15 | 1.7% |
| United States Treasury Note/Bond | 2023/11/15 | 1.6% |
| United States Treasury Note/Bond | 2024/05/15 | 1.6% |
| 合計 | | 22.2% |

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。
※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。　■ベンチマーク　■ファンド

・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、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 【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】（2019年6月28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 | | 2,728,679,237 | 99.90 |
| | 内　日本 | 2,728,679,237 | 99.90 |
| コール･ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,641,689 | 0.10 |
| 純資産総額 | | 2,731,320,926 | 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】（2019年6月28日現在）

### ①　【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 775,196,706 | 2.7627<br>2,141,667,575 | 2.8067<br>2,175,744,594 | 79.66 |
| 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 | 400,938,760 | 1.3347<br>535,149,947 | 1.3791<br>552,934,643 | 20.24 |

(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。

### ②　【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③　【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)　【運用実績】

① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 1,406,787,686 | 1,406,787,686 | 1.0477 | 1.0477 |
| 2018年6月末日 | 2,197,723,591 | ― | 1.0067 | ― |
| 7月末日 | 2,284,234,779 | ― | 1.0188 | ― |
| 8月末日 | 2,315,643,924 | ― | 1.0048 | ― |
| 9月末日 | 2,387,311,562 | ― | 1.0276 | ― |
| 10月末日 | 2,373,604,682 | ― | 1.0091 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 2,442,336,372 | 2,442,336,372 | 1.0222 | 1.0222 |
| 12月末日 | 2,411,429,477 | ― | 1.0129 | ― |
| 2019年1月末日 | 2,451,470,076 | ― | 1.0131 | ― |
| 2月末日 | 2,524,816,119 | ― | 1.0288 | ― |
| 3月末日 | 2,571,083,599 | ― | 1.0360 | ― |
| 4月末日 | 2,690,695,304 | ― | 1.0344 | ― |
| 5月末日 | 2,672,930,470 | ― | 1.0223 | ― |
| 6月末日 | 2,731,320,926 | ― | 1.0420 | ― |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 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 | 1,434,988,289 | 93,204,954 |
| 第2計算期間 | 1,446,419,314 | 399,973,906 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 692,879,769 | 467,598,802 |

（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（2019年6月28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 | | 173,863,649,431 | 98.33 |
| | 内 ユーロ | 67,306,863,651 | 38.07 |
| | 内 シンガポール | 691,971,343 | 0.39 |
| | 内 マレーシア | 812,827,646 | 0.46 |
| | 内 ノルウェー | 422,431,250 | 0.24 |
| | 内 スウェーデン | 619,169,833 | 0.35 |
| | 内 デンマーク | 887,294,456 | 0.50 |
| | 内 イギリス | 11,083,093,002 | 6.27 |
| | 内 ポーランド | 1,042,043,221 | 0.59 |
| | 内 カナダ | 3,370,347,903 | 1.91 |
| | 内 アメリカ | 81,713,704,513 | 46.22 |
| | 内 メキシコ | 1,420,336,583 | 0.80 |
| | 内 南アフリカ | 986,127,716 | 0.56 |
| | 内 オーストラリア | 3,507,438,314 | 1.98 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 2,944,189,285 | 1.67 |
| 純資産総額 | | 176,807,838,716 | 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） | | 1,657,486,540 | 0.94 |
| | 内 日本 | 1,657,486,540 | 0.94 |

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

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

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

(2) 投資資産（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 7,907,000 | 99.98<br>852,164,622 | 100.83<br>859,386,628 | 2.250000<br>2021/04/30 | 0.49 |
| 2 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,400,000 | 102.66<br>708,251,520 | 109.62<br>756,254,640 | 3.125000<br>2028/11/15 | 0.43 |
| 3 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,500,000 | 99.39<br>696,384,705 | 107.32<br>751,921,482 | 2.875000<br>2028/05/15 | 0.43 |
| 4 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,600,000 | 100.58<br>715,580,406 | 105.39<br>749,759,214 | 2.625000<br>2029/02/15 | 0.42 |
| 5 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 7,029,000 | 91.63<br>694,276,204 | 98.35<br>745,162,164 | 1.625000<br>2026/05/15 | 0.42 |
| 6 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,300,000 | 97.75<br>663,845,302 | 106.25<br>721,566,847 | 2.750000<br>2028/02/15 | 0.41 |
| 7 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,000,000 | 98.64<br>637,944,336 | 107.42<br>694,734,575 | 2.875000<br>2028/08/15 | 0.39 |
| 8 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 6,287,000 | 96.78<br>655,861,348 | 100.89<br>683,707,043 | 2.000000<br>2022/11/30 | 0.39 |
| 9 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 3,084,000 | 159.73<br>603,394,706 | 179.44<br>677,873,702 | 4.500000<br>2041/04/25 | 0.38 |
| 10 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,921,000 | 96.38<br>615,133,624 | 102.29<br>652,878,226 | 2.250000<br>2024/11/15 | 0.37 |
| 11 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,900,000 | 94.14<br>598,744,562 | 102.34<br>650,861,566 | 2.250000<br>2027/08/15 | 0.37 |
| 12 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,840,000 | 95.58<br>601,701,457 | 102.36<br>644,393,713 | 2.250000<br>2025/11/15 | 0.36 |
| 13 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,700,000 | 95.35<br>585,839,404 | 103.32<br>634,850,331 | 2.375000<br>2027/05/15 | 0.36 |
| 14 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,788,000 | 95.23<br>594,153,993 | 101.63<br>634,070,380 | 2.125000<br>2025/05/15 | 0.36 |
| 15 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 4,087,000 | 118.72<br>594,351,180 | 126.38<br>632,694,315 | 2.500000<br>2030/05/25 | 0.36 |
| 16 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国債証券 | 4,420,000 | 107.50<br>582,013,257 | 115.81<br>627,012,885 | 1.500000<br>2031/05/25 | 0.35 |
| 17 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,743,000 | 94.71<br>586,340,384 | 100.97<br>625,079,780 | 2.000000<br>2025/02/15 | 0.35 |
| 18 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 5,743,000 | 94.26<br>583,536,142 | 100.91<br>624,695,977 | 2.000000<br>2025/08/15 | 0.35 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 19 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国　債<br>証券 | 4,097,000 | 121.43<br>609,409,647 | 121.21<br>608,307,210 | 4.250000<br>2023/10/25 | 0.34 |
| 20 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,550,000 | 97.88<br>585,567,773 | 101.64<br>608,045,545 | 2.125000<br>2024/03/31 | 0.34 |
| 21 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,500,000 | 93.94<br>556,948,235 | 102.31<br>606,551,576 | 2.250000<br>2027/11/15 | 0.34 |
| 22 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,500,000 | 93.00<br>551,387,349 | 100.68<br>596,917,845 | 2.000000<br>2026/11/15 | 0.34 |
| 23 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国　債<br>証券 | 2,807,000 | 162.41<br>558,423,692 | 173.13<br>595,282,207 | 5.750000<br>2032/10/25 | 0.34 |
| 24 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,340,000 | 94.56<br>544,297,548 | 102.41<br>589,493,550 | 2.250000<br>2027/02/15 | 0.33 |
| 25 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,229,000 | 99.33<br>559,885,744 | 104.41<br>588,512,710 | 2.750000<br>2024/02/15 | 0.33 |
| 26 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,600,000 | 89.91<br>542,742,483 | 97.38<br>587,821,123 | 1.500000<br>2026/08/15 | 0.33 |
| 27 | FRENCH GOVERNMENT BOND | ユーロ | 国　債<br>証券 | 3,023,000 | 148.58<br>550,191,340 | 154.78<br>573,149,150 | 5.500000<br>2029/04/25 | 0.32 |
| 28 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,162,000 | 97.23<br>541,021,624 | 102.89<br>572,536,799 | 2.375000<br>2024/08/15 | 0.32 |
| 29 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,366,000 | 91.36<br>528,467,769 | 98.47<br>569,586,306 | 1.625000<br>2026/02/15 | 0.32 |
| 30 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国　債<br>証券 | 5,021,000 | 99.46<br>538,334,333 | 104.20<br>563,960,797 | 2.750000<br>2023/11/15 | 0.32 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 国債証券 | 98.33% |
| 合計 | 98.33% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 日本 | 豪ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 233,000 | 17,541,638 | 17,584,510 | 0.01% |
| | | 南アフリカ・ランド買/円売 2019年8月 | 買建 | 1,100,000 | 8,303,779 | 8,294,000 | 0.00% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2019年8月 | 買建 | 639,000 | 52,483,127 | 52,474,680 | 0.03% |
| | | デンマーク・クローネ買/円売 2019年8月 | 買建 | 477,000 | 7,828,953 | 7,827,570 | 0.00% |
| | | ユーロ買/円売 2019年8月 | 買建 | 3,133,000 | 383,704,489 | 383,635,850 | 0.22% |
| | | ユーロ買/円売 2019年7月 | 買建 | 1,592,000 | 194,916,201 | 194,988,160 | 0.11% |
| | | 英ポンド買/円売 2019年8月 | 買建 | 481,000 | 65,599,020 | 65,589,160 | 0.04% |
| | | 英ポンド買/円売 2019年7月 | 買建 | 326,000 | 44,566,808 | 44,515,300 | 0.03% |
| | | メキシコ・ペソ買/円売 2019年8月 | 買建 | 3,611,000 | 20,129,487 | 20,077,160 | 0.01% |
| | | マレーシア・リンギット買/円売 2019年7月 | 買建 | 522,000 | 13,587,660 | 13,572,000 | 0.01% |
| | | ノルウェー・クローネ買/円売 2019年8月 | 買建 | 972,000 | 12,282,481 | 12,276,360 | 0.01% |
| | | ポーランド・ズロチ買/円売 2019年7月 | 買建 | 837,000 | 23,728,799 | 24,105,600 | 0.01% |
| | | スウェーデン・クローネ買/円売 2019年7月 | 買建 | 188,000 | 2,156,276 | 2,182,680 | 0.00% |
| | | シンガポール・ドル買/円売 2019年8月 | 買建 | 300,000 | 23,839,500 | 23,835,000 | 0.01% |
| | | 米ドル買/円売 2019年8月 | 買建 | 4,740,000 | 509,423,918 | 509,218,200 | 0.29% |
| | | 米ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 2,538,000 | 273,311,128 | 273,469,500 | 0.15% |
| | | 豪ドル買/円売 2019年8月 | 買建 | 51,000 | 3,844,074 | 3,840,810 | 0.00% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## 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（2019年6月28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 | | 12,111,903,148 | 93.52 |
| | 内 タイ | 1,096,733,593 | 8.47 |
| | 内 マレーシア | 759,416,182 | 5.86 |
| | 内 フィリピン | 31,657,500 | 0.24 |
| | 内 インドネシア | 1,297,952,802 | 10.02 |
| | 内 ポーランド | 1,106,189,561 | 8.54 |
| | 内 ロシア | 998,935,818 | 7.71 |
| | 内 ハンガリー | 512,916,354 | 3.96 |
| | 内 ルーマニア | 292,427,270 | 2.26 |
| | 内 トルコ | 475,084,241 | 3.67 |
| | 内 チェコ | 535,256,027 | 4.13 |
| | 内 メキシコ | 1,174,365,619 | 9.07 |
| | 内 コロンビア | 799,308,594 | 6.17 |
| | 内 ペルー | 445,262,257 | 3.44 |
| | 内 チリ | 438,236,651 | 3.38 |
| | 内 ブラジル | 1,039,275,781 | 8.02 |
| | 内 ウルグアイ | 23,556,675 | 0.18 |
| | 内 アルゼンチン | 41,747,416 | 0.32 |
| | 内 南アフリカ | 1,043,580,807 | 8.06 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 839,191,786 | 6.48 |
| 純資産総額 | | 12,951,094,934 | 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） | | 143,749,910 | 1.11 |
| | 内 日本 | 143,749,910 | 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（2019年6月28日現在）

### ① 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 6,410,000 | 100.65<br>181,874,539 | 109.81<br>198,435,205 | 10.000000<br>2023/01/01 | 1.53 |
| 2 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 22,050,000 | 109.85<br>184,087,096 | 112.89<br>189,192,792 | 10.500000<br>2026/12/21 | 1.46 |
| 3 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 4,990,000 | 96.51<br>135,772,209 | 112.46<br>158,199,565 | 10.000000<br>2025/01/01 | 1.22 |
| 4 | Colombian TES | コロンビア | 国債証券 | 4,335,000,000 | 104.67<br>152,918,960 | 105.70<br>154,418,062 | 7.000000<br>2022/05/04 | 1.19 |
| 5 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 5,030,000 | 102.69<br>145,620,611 | 105.50<br>149,602,971 | 10.000000<br>2021/01/01 | 1.16 |
| 6 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 21,020,000 | 91.07<br>145,497,898 | 89.35<br>142,749,594 | 8.750000<br>2048/02/28 | 1.10 |
| 7 | Colombian TES | コロンビア | 国債証券 | 3,450,000,000 | 119.27<br>138,675,432 | 121.13<br>140,842,258 | 10.000000<br>2024/07/24 | 1.09 |
| 8 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 22,950,000 | 98.24<br>126,721,109 | 100.48<br>129,603,258 | 7.750000<br>2031/05/29 | 1.00 |
| 9 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 23,230,000 | 95.58<br>124,789,960 | 99.26<br>129,587,816 | 7.500000<br>2027/06/03 | 1.00 |
| 10 | Brazil Letras do Tesouro Nacional | ブラジル | 国債証券 | 5,030,000 | 75.94<br>107,682,490 | 88.76<br>125,862,117 | —<br>2021/07/01 | 0.97 |
| 11 | Colombian TES | コロンビア | 国債証券 | 3,310,000,000 | 106.63<br>118,947,027 | 110.60<br>123,381,021 | 7.500000<br>2026/08/26 | 0.95 |
| 12 | Colombian TES | コロンビア | 国債証券 | 3,590,000,000 | 93.97<br>113,696,443 | 100.21<br>121,245,533 | 6.000000<br>2028/04/28 | 0.94 |
| 13 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 21,950,000 | 96.82<br>119,446,052 | 98.01<br>120,907,856 | 6.500000<br>2021/06/10 | 0.93 |
| 14 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 3,750,000 | 96.80<br>102,334,507 | 114.17<br>120,697,246 | 10.000000<br>2027/01/01 | 0.93 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 15 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 18,350,000 | 112.04<br>115,551,740 | 111.12<br>114,595,753 | 10.000000<br>2024/12/05 | 0.88 |
| 16 | Thailand Government Bond | タイ | 国債証券 | 30,600,000 | 105.72<br>113,234,620 | 104.55<br>111,980,547 | 3.650000<br>2021/12/17 | 0.86 |
| 17 | Indonesia Treasury Bond | インドネシア | 国債証券 | 13,150,000,000 | 102.10<br>103,391,349 | 105.86<br>107,188,543 | 8.375000<br>2024/03/15 | 0.83 |
| 18 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債証券 | 3,640,000 | 96.40<br>101,097,343 | 101.81<br>106,767,566 | 2.500000<br>2026/07/25 | 0.82 |
| 19 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 19,450,000 | 95.92<br>104,850,285 | 97.24<br>106,301,909 | 6.500000<br>2022/06/09 | 0.82 |
| 20 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債証券 | 3,500,000 | 100.79<br>101,638,078 | 102.49<br>103,354,866 | 2.500000<br>2024/04/25 | 0.80 |
| 21 | Colombian TES | コロンビア | 国債証券 | 2,700,000,000 | 107.62<br>97,930,919 | 112.56<br>102,424,713 | 7.750000<br>2030/09/18 | 0.79 |
| 22 | Thailand Government Bond | タイ | 国債証券 | 25,000,000 | 109.30<br>95,639,777 | 115.74<br>101,278,625 | 3.775000<br>2032/06/25 | 0.78 |
| 23 | Thailand Government Bond | タイ | 国債証券 | 23,050,000 | 119.13<br>96,108,240 | 124.20<br>100,198,350 | 4.875000<br>2029/06/22 | 0.77 |
| 24 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 14,500,000 | 90.29<br>99,509,362 | 90.65<br>99,905,116 | 8.500000<br>2037/01/31 | 0.77 |
| 25 | Russian Federal Bond - OFZ | ロシア | 国債証券 | 56,100,000 | 99.68<br>95,624,843 | 102.68<br>98,504,828 | 7.750000<br>2026/09/16 | 0.76 |
| 26 | Indonesia Treasury Bond | インドネシア | 国債証券 | 12,020,000,000 | 100.26<br>92,801,576 | 105.75<br>97,884,184 | 8.375000<br>2034/03/15 | 0.76 |
| 27 | Brazil Letras do Tesouro Nacional | ブラジル | 国債証券 | 4,200,000 | 68.81<br>81,477,482 | 82.62<br>97,827,531 | —<br>2022/07/01 | 0.76 |
| 28 | Brazil Letras do Tesouro Nacional | ブラジル | 国債証券 | 4,000,000 | 73.42<br>82,798,685 | 85.65<br>96,581,195 | —<br>2022/01/01 | 0.75 |
| 29 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債証券 | 3,200,000 | 97.83<br>90,191,865 | 103.35<br>95,285,041 | 2.750000<br>2028/04/25 | 0.74 |
| 30 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債証券 | 3,200,000 | 100.40<br>92,566,731 | 101.62<br>93,688,276 | 2.250000<br>2022/04/25 | 0.72 |

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|---|---|
| 国債証券 | 93.52% |
| 合計 | 93.52% |

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(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 | ルーマニア・レイ買/円売 2019年7月 | 買建 | 690,000 | 17,599,779 | 17,884,800 | 0.14% |
| | | チェコ・コルナ買/円売 2019年7月 | 買建 | 3,790,000 | 17,845,180 | 18,192,000 | 0.14% |
| | | ハンガリー・フォリント買/円売 2019年7月 | 買建 | 8,700,000 | 3,319,219 | 3,291,210 | 0.03% |
| | | 南アフリカ・ランド買/円売 2019年7月 | 買建 | 1,860,000 | 13,642,653 | 14,117,400 | 0.11% |
| | | メキシコ・ペソ買/円売 2019年7月 | 買建 | 4,710,000 | 25,963,616 | 26,423,100 | 0.20% |
| | | ポーランド・ズロチ買/円売 2019年7月 | 買建 | 420,000 | 11,990,924 | 12,096,000 | 0.09% |
| | | トルコ・リラ買/円売 2019年7月 | 買建 | 670,000 | 12,277,375 | 12,475,400 | 0.10% |
| | | インドネシア・ルピア買/円売 2019年7月 | 買建 | 5,100,000,000 | 38,851,800 | 39,270,000 | 0.30% |

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

(注2) 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）

2019年6月28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 | 10,420円 |
| 純資産総額 | 27億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 1.9% |
| 3カ月間 | 0.6% |
| 6カ月間 | 2.9% |
| 1年間 | 3.5% |
| 3年間 | － |
| 5年間 | － |
| 設定来 | 4.2% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

**分配の推移（10,000口当たり、税引前）**

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

| 決算期 | 第１期 17年11月 | 第２期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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。

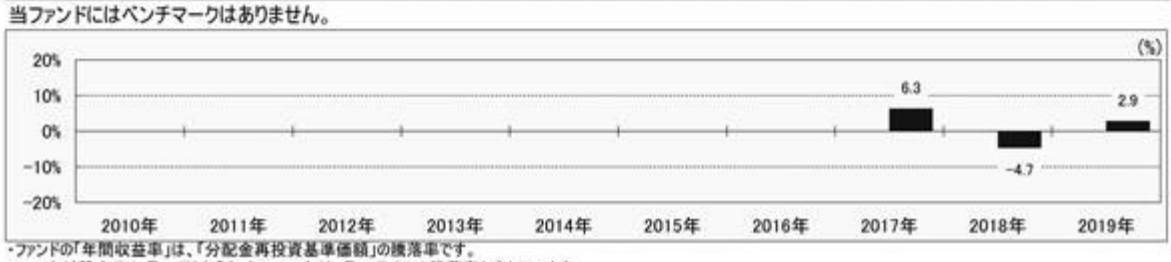
**主要な資産の状況**　　※比率は、純資産総額に対するものです。

| 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 | 921 | 97.3% | 米ドル | 37.3% | 直接利回り(%) | 3.1 | United States Treasury Note/Bond | 2021/04/30 | 0.4% |
| | | | ユーロ | 30.8% | 最終利回り(%) | 2.2 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2026/12/21 | 0.4% |
| コール・ローン、その他 | | 2.7% | 英ポンド | 5.1% | 修正デュレーション | 7.1 | United States Treasury Note/Bond | 2028/11/15 | 0.3% |
| 合計 | 921 | 100.0% | メキシコ・ペソ | 2.6% | 残存年数 | 9.2 | United States Treasury Note/Bond | 2028/05/15 | 0.3% |
| 債券種別構成 | | 比率 | ポーランド・ズロチ | 2.3% | 格付別構成 | 比率 | United States Treasury Note/Bond | 2029/02/15 | 0.3% |
| 国債 | | 97.3% | 南アフリカ・ランド | 2.2% | AAA | 64.9% | United States Treasury Note/Bond | 2026/05/15 | 0.3% |
| | | | インドネシア・ルピア | 2.1% | AA | 7.5% | United States Treasury Note/Bond | 2028/02/15 | 0.3% |
| | | | ブラジル・レアル | 2.0% | A | 17.4% | United States Treasury Note/Bond | 2028/08/15 | 0.3% |
| | | | タイ・バーツ | 1.7% | BBB | 10.1% | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 2023/01/01 | 0.3% |
| | | | その他 | 13.8% | BB以下 | 0.1% | United States Treasury Note/Bond | 2022/11/30 | 0.3% |
| 合計 | | 97.3% | 合計 | 100.0% | 合計 | 100.0% | 合計 | | 3.4% |

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

**年間収益率の推移**

当ファンドにはベンチマークはありません。




・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2017年は設定日（1月11日）から年末、2019年は6月28日までの騰落率を表しています。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 【ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

－

### (1)　【投資状況】（2019年6月28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 | | 1,096,693,427 | 99.95 |
| | 内 日本 | 1,096,693,427 | 99.95 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 543,274 | 0.05 |
| 純資産総額 | | 1,097,236,701 | 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】（2019年6月28日現在）

### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | ダイワJ－REITマザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 374,477,029 | 2.6924<br>1,008,248,802 | 2.9286<br>1,096,693,427 | 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。

### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### ① 【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 564,311,815 | 564,311,815 | 0.9372 | 0.9372 |
| 2018年6月末日 | 906,637,318 | － | 1.0129 | － |
| 7月末日 | 921,058,152 | － | 1.0180 | － |
| 8月末日 | 946,492,863 | － | 1.0145 | － |
| 9月末日 | 963,217,359 | － | 1.0306 | － |
| 10月末日 | 969,148,497 | － | 1.0147 | － |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 1,027,403,305 | 1,027,403,305 | 1.0585 | 1.0585 |
| 12月末日 | 1,003,198,295 | － | 1.0388 | － |
| 2019年1月末日 | 1,018,766,696 | － | 1.0868 | － |
| 2月末日 | 1,023,002,703 | － | 1.0921 | － |
| 3月末日 | 1,052,605,351 | － | 1.1277 | － |
| 4月末日 | 1,061,451,566 | － | 1.1192 | － |
| 5月末日 | 1,081,284,658 | － | 1.1384 | － |
| 6月末日 | 1,097,236,701 | － | 1.1552 | － |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | － |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 7.5 |

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|---|---|---|
| 第1計算期間 | 639,909,329 | 38,785,261 |
| 第2計算期間 | 587,481,644 | 218,964,687 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 189,109,235 | 209,915,452 |

（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（2019年6月28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 | | 283,269,546,670 | 98.60 |
| | 内　日本 | 283,269,546,670 | 98.60 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 4,009,132,355 | 1.40 |
| 純資産総額 | | 287,278,679,025 | 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） | | 3,842,000,000 | 1.34 |
| | 内　日本 | 3,842,000,000 | 1.34 |

(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)　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（2019年6月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 日本ビルファンド | 日本 | 投資証券 | 28,278 | 736,892.97<br>20,837,859,543 | 738,000.00<br>20,869,164,000 | 7.26 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 投資証券 | 29,201 | 643,450.61<br>18,789,401,532 | 656,000.00<br>19,155,856,000 | 6.67 |
| 3 | 野村不動産マスターF | 日本 | 投資証券 | 90,857 | 156,358.04<br>14,206,222,847 | 165,700.00<br>15,055,004,900 | 5.24 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 4 | 日本リテールファンド | 日本 | 投資証券 | 55,190 | 221,045.71<br>12,199,513,203 | 218,000.00<br>12,031,420,000 | 4.19 |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 65,563 | 172,655.82<br>11,319,833,716 | 180,600.00<br>11,840,677,800 | 4.12 |
| 6 | オリックス不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 58,183 | 189,641.33<br>11,033,901,765 | 196,600.00<br>11,438,777,800 | 3.98 |
| 7 | 日本プロロジスリート | 日本 | 投資証券 | 41,954 | 235,992.29<br>9,900,820,637 | 248,900.00<br>10,442,350,600 | 3.63 |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 39,180 | 245,608.89<br>9,622,956,525 | 260,100.00<br>10,190,718,000 | 3.55 |
| 9 | アドバンス・レジデンス | 日本 | 投資証券 | 28,459 | 308,155.22<br>8,769,789,536 | 320,500.00<br>9,121,109,500 | 3.18 |
| 10 | ＧＬＰ投資法人 | 日本 | 投資証券 | 72,359 | 117,753.47<br>8,520,523,353 | 122,800.00<br>8,885,685,200 | 3.09 |
| 11 | 日本プライムリアルティ | 日本 | 投資証券 | 18,485 | 442,135.60<br>8,172,876,650 | 467,000.00<br>8,632,495,000 | 3.00 |
| 12 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 93,995 | 87,238.83<br>8,200,014,432 | 86,800.00<br>8,158,766,000 | 2.84 |
| 13 | ＡＰＩ投資法人 | 日本 | 投資証券 | 15,341 | 469,871.39<br>7,208,297,142 | 469,000.00<br>7,194,929,000 | 2.50 |
| 14 | ケネディクス・オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 9,033 | 769,634.14<br>6,952,105,232 | 771,000.00<br>6,964,443,000 | 2.42 |
| 15 | 積水ハウス・リート投資 | 日本 | 投資証券 | 85,386 | 81,377.36<br>6,948,487,872 | 80,600.00<br>6,882,111,600 | 2.40 |
| 16 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 9,703 | 584,271.74<br>5,669,188,758 | 604,000.00<br>5,860,612,000 | 2.04 |
| 17 | インヴィンシブル投資法人 | 日本 | 投資証券 | 100,742 | 52,780.44<br>5,317,207,313 | 55,800.00<br>5,621,403,600 | 1.96 |
| 18 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 6,740 | 778,945.74<br>5,250,094,322 | 773,000.00<br>5,210,020,000 | 1.81 |
| 19 | 森ヒルズリート | 日本 | 投資証券 | 33,490 | 144,235.07<br>4,830,432,544 | 152,600.00<br>5,110,574,000 | 1.78 |
| 20 | 産業ファンド | 日本 | 投資証券 | 35,846 | 121,789.93<br>4,365,682,069 | 134,000.00<br>4,803,364,000 | 1.67 |
| 21 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 19,080 | 232,430.87<br>4,434,781,043 | 246,700.00<br>4,707,036,000 | 1.64 |
| 22 | フロンティア不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 9,933 | 464,594.13<br>4,614,813,537 | 460,000.00<br>4,569,180,000 | 1.59 |
| 23 | ヒューリックリート投資法 | 日本 | 投資証券 | 23,606 | 181,759.65<br>4,290,618,312 | 187,100.00<br>4,416,682,600 | 1.54 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 24 | ジャパンエクセレント投資法人 | 日本 | 投資証券 | 26,149 | 159,651.56<br>4,174,728,719 | 158,200.00<br>4,136,771,800 | 1.44 |
| 25 | イオンリート投資 | 日本 | 投資証券 | 29,974 | 131,381.31<br>3,938,023,554 | 138,000.00<br>4,136,412,000 | 1.44 |
| 26 | 日本リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 9,426 | 420,920.16<br>3,967,593,499 | 419,000.00<br>3,949,494,000 | 1.37 |
| 27 | プレミア投資法人 | 日本 | 投資証券 | 27,763 | 135,488.82<br>3,761,576,132 | 141,800.00<br>3,936,793,400 | 1.37 |
| 28 | コンフォリア・レジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 12,110 | 293,984.50<br>3,560,152,302 | 309,500.00<br>3,748,045,000 | 1.30 |
| 29 | 東急リアル・エステート | 日本 | 投資証券 | 19,578 | 169,197.88<br>3,312,556,128 | 187,200.00<br>3,665,001,600 | 1.28 |
| 30 | 森トラスト総合リート | 日本 | 投資証券 | 20,870 | 175,098.53<br>3,654,306,459 | 175,200.00<br>3,656,424,000 | 1.27 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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 | 98.60% |
| 合計 | 98.60% |

(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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(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 | 東証REIT指数先物 2019年9月 | 買建 | 2,000 | 3,803,816,000 | 3,842,000,000 | 1.34% |

(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)　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

2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

### 基準価額・純資産の推移

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 11,552円 |
| 純資産総額 | 10億円 |

### 基準価額の騰落率

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 1.5% |
| 3カ月間 | 2.4% |
| 6カ月間 | 11.2% |
| 1年間 | 14.0% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 15.5% |

※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 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 0円 | 0円 | | | | | | | | | | |

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

### 主要な資産の状況

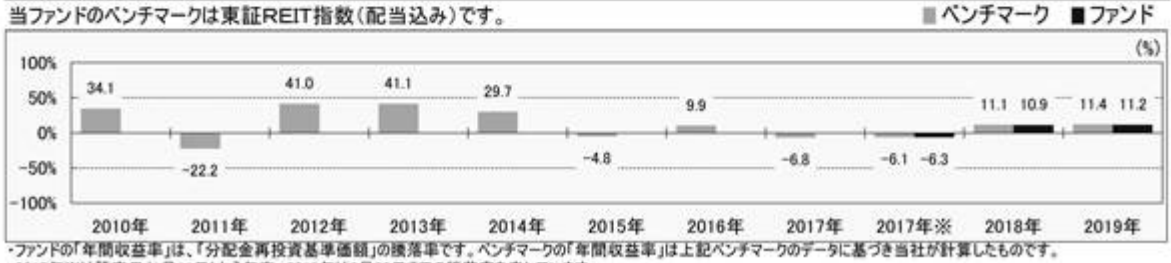
※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | リート用途別構成 | 比率 | 組入上位10銘柄 | 用途名 | 比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国内リート | 63 | 98.6% | オフィス不動産 | 32.4% | 日本ビルファンド | オフィス不動産 | 7.3% |
| 国内リート 先物 | 1 | 1.3% | 各種不動産 | 28.8% | ジャパンリアルエステイト | オフィス不動産 | 6.7% |
| | | | 工業用不動産 | 12.6% | 野村不動産マスターF | 各種不動産 | 5.2% |
| | | | 店舗用不動産 | 9.1% | 日本リテールファンド | 店舗用不動産 | 4.2% |
| | | | 住宅用不動産 | 9.0% | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 各種不動産 | 4.1% |
| | | | ホテル・リゾート不動産 | 6.3% | オリックス不動産投資 | オフィス不動産 | 4.0% |
| | | | ヘルスケア不動産 | 0.4% | 日本プロロジスリート | 工業用不動産 | 3.6% |
| | | | | | 大和ハウスリート投資法人 | 各種不動産 | 3.5% |
| | | | | | アドバンス・レジデンス | 住宅用不動産 | 3.2% |
| コール・ローン、その他 | | 1.4% | | | GLP投資法人 | 工業用不動産 | 3.1% |
| 合計 | 64 | - | 合計 | 98.6% | 合計 | | 44.9% |

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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。　■ベンチマーク　■ファンド




・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、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

**【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】（2019年6月28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 | | 793,026,811 | 99.82 |
| | 内 日本 | 793,026,811 | 99.82 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 1,456,465 | 0.18 |
| 純資産総額 | | 794,483,276 | 100.00 |

### その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | | 時価(円) | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|
| 為替予約取引（売建） | | 774,043,994 | △97.43 |
| | 内 日本 | 774,043,994 | △97.43 |

(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】（2019年6月28日現在）

### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数<br>または<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 334,427,028 | 2.3037<br>770,444,324 | 2.3713<br>793,026,811 | 99.82 |

(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 |
|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 99.82% |
| 合計 | 99.82% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### ② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 為替予約取引 | 日本 | 豪ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 711,100 | 53,403,161 | 53,638,581 | △6.75% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 184,600 | 14,778,175 | 15,185,300 | △1.91% |
| | | ユーロ売/円買 2019年7月 | 売建 | 413,900 | 50,135,143 | 50,690,333 | △6.38% |
| | | 英ポンド売/円買 2019年7月 | 売建 | 286,700 | 39,235,885 | 39,134,550 | △4.93% |
| | | 米ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 5,229,500 | 564,896,395 | 563,113,358 | △70.88% |
| | | イスラエル・シュケル売/円買 2019年7月 | 売建 | 17,600 | 524,391 | 530,464 | △0.07% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 51,300 | 3,630,182 | 3,703,910 | △0.47% |
| | | シンガポール・ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 348,200 | 27,404,362 | 27,720,224 | △3.49% |
| | | 香港ドル売/円買 2019年7月 | 売建 | 1,476,200 | 20,348,327 | 20,327,274 | △2.56% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

| | 純資産総額(分配落)(円) | 純資産総額(分配付)(円) | 1口当たりの純資産額(分配落)(円) | 1口当たりの純資産額(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末(2017年11月30日) | 451,251,233 | 451,251,233 | 1.0301 | 1.0301 |
| 2018年6月末日 | 719,023,433 | ― | 1.0358 | ― |
| 7月末日 | 718,557,283 | ― | 1.0309 | ― |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8月末日 | 761,472,516 | － | 1.0634 | － |
| 9月末日 | 734,699,166 | － | 1.0241 | － |
| 10月末日 | 743,770,318 | － | 1.0148 | － |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 767,151,864 | 767,151,864 | 1.0317 | 1.0317 |
| 12月末日 | 714,142,032 | － | 0.9633 | － |
| 2019年1月末日 | 795,758,079 | － | 1.0649 | － |
| 2月末日 | 801,504,997 | － | 1.0702 | － |
| 3月末日 | 831,168,222 | － | 1.1093 | － |
| 4月末日 | 786,519,395 | － | 1.0977 | － |
| 5月末日 | 785,577,570 | － | 1.0913 | － |
| 6月末日 | 794,483,276 | － | 1.1031 | － |

② 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | － |

③ 【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 5.8 |

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|---|---|---|
| 第1計算期間 | 464,575,492 | 36,518,861 |
| 第2計算期間 | 460,818,025 | 155,301,672 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 124,796,123 | 148,505,667 |

(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（2019年6月28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 | | 204,669,496 | 0.92 |
| | 内 アメリカ | 204,669,496 | 0.92 |
| 投資証券 | | 21,785,381,758 | 97.77 |
| | 内 ガーンジィ | 38,166,511 | 0.17 |
| | 内 マン島 | 5,951,752 | 0.03 |
| | 内 韓国 | 3,761,856 | 0.02 |
| | 内 香港 | 553,592,931 | 2.48 |
| | 内 シンガポール | 875,001,480 | 3.93 |
| | 内 イスラエル | 15,912,326 | 0.07 |
| | 内 イギリス | 1,038,961,604 | 4.66 |
| | 内 アイルランド | 56,758,749 | 0.25 |
| | 内 オランダ | 56,592,959 | 0.25 |
| | 内 ベルギー | 201,457,000 | 0.90 |
| | 内 フランス | 843,385,297 | 3.78 |
| | 内 ドイツ | 59,002,967 | 0.26 |
| | 内 スペイン | 151,297,274 | 0.68 |
| | 内 イタリア | 4,448,445 | 0.02 |
| | 内 カナダ | 425,269,842 | 1.91 |
| | 内 アメリカ | 15,742,835,519 | 70.65 |
| | 内 オーストラリア | 1,605,647,268 | 7.21 |
| | 内 ニュージーランド | 107,337,978 | 0.48 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 292,556,096 | 1.31 |
| 純資産総額 | | 22,282,607,350 | 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） | | 272,512,535 | 1.22 |
| | 内 ドイツ | 49,516,583 | 0.22 |
| | 内 アメリカ | 222,995,952 | 1.00 |
| 為替予約取引（買建） | | 138,568,450 | 0.62 |
| | 内 日本 | 138,568,450 | 0.62 |

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

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

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

## (2) 投資資産（2019年6月28日現在）

### ① 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | PROLOGIS INC | アメリカ | 投資証券 | 105,302 | 7,266.55<br>765,187,021 | 8,554.21<br>900,775,885 | 4.04 |
| 2 | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ | 投資証券 | 51,547 | 19,731.82<br>1,017,120,086 | 17,238.85<br>888,611,243 | 3.99 |
| 3 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 投資証券 | 25,100 | 22,905.91<br>574,938,483 | 25,550.54<br>641,318,594 | 2.88 |
| 4 | WELLTOWER INC | アメリカ | 投資証券 | 67,600 | 7,807.44<br>527,788,928 | 8,798.89<br>594,805,485 | 2.67 |
| 5 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ | 投資証券 | 23,300 | 20,306.12<br>473,135,043 | 21,713.21<br>505,917,970 | 2.27 |
| 6 | EQUITY RESIDENTIAL | アメリカ | 投資証券 | 62,000 | 7,593.69<br>470,811,220 | 8,150.00<br>505,300,118 | 2.27 |
| 7 | LINK REIT | 香港 | 投資証券 | 360,500 | 1,061.55<br>382,694,725 | 1,345.90<br>485,198,392 | 2.18 |
| 8 | VENTAS INC | アメリカ | 投資証券 | 61,679 | 6,752.93<br>416,514,858 | 7,482.78<br>461,530,499 | 2.07 |
| 9 | DIGITAL REALTY TRUST INC | アメリカ | 投資証券 | 34,778 | 12,247.74<br>425,955,082 | 12,676.10<br>440,849,545 | 1.98 |
| 10 | REALTY INCOME CORP | アメリカ | 投資証券 | 52,517 | 6,960.10<br>365,529,215 | 7,482.78<br>392,973,252 | 1.76 |
| 11 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | フランス | 投資証券 | 23,290 | 18,778.45<br>437,352,802 | 15,586.85<br>363,017,795 | 1.63 |
| 12 | BOSTON PROPERTIES INC | アメリカ | 投資証券 | 25,900 | 13,935.84<br>360,939,612 | 13,800.35<br>357,429,161 | 1.60 |
| 13 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | アメリカ | 投資証券 | 10,967 | 28,079.61<br>307,949,463 | 31,083.40<br>340,891,673 | 1.53 |
| 14 | GOODMAN GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 274,920 | 821.70<br>225,923,162 | 1,151.22<br>316,494,090 | 1.42 |
| 15 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | アメリカ | 投資証券 | 19,000 | 13,382.88<br>254,275,899 | 15,097.06<br>286,844,281 | 1.29 |
| 16 | HCP INC | アメリカ | 投資証券 | 79,600 | 3,119.11<br>248,285,053 | 3,427.72<br>272,846,671 | 1.22 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 17 | SCENTRE GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 906,410 | 301.50<br>273,352,270 | 299.69<br>271,646,817 | 1.22 |
| 18 | WP CAREY INC | アメリカ | 投資証券 | 28,600 | 7,463.27<br>213,452,225 | 8,776.26<br>251,001,087 | 1.13 |
| 19 | EXTRA SPACE STORAGE INC | アメリカ | 投資証券 | 21,200 | 10,224.31<br>216,756,420 | 11,383.70<br>241,334,480 | 1.08 |
| 20 | HOST HOTELS & RESORTS INC | アメリカ | 投資証券 | 123,300 | 2,065.36<br>254,665,084 | 1,941.29<br>239,362,031 | 1.07 |
| 21 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | アメリカ | 投資証券 | 19,028 | 11,037.91<br>210,030,449 | 12,538.13<br>238,575,591 | 1.07 |
| 22 | UDR INC | アメリカ | 投資証券 | 47,100 | 4,530.62<br>213,394,234 | 4,805.27<br>226,328,603 | 1.02 |
| 23 | SUN COMMUNITIES INC | アメリカ | 投資証券 | 15,100 | 11,330.77<br>171,095,024 | 13,646.21<br>206,057,831 | 0.92 |
| 24 | VANGUARD REAL ESTATE ETF | アメリカ | 投資信託受益証券 | 21,800 | 9,479.48<br>206,654,287 | 9,388.50<br>204,669,496 | 0.92 |
| 25 | REGENCY CENTERS CORP | アメリカ | 投資証券 | 27,920 | 6,769.75<br>189,011,705 | 7,211.15<br>201,335,336 | 0.90 |
| 26 | DUKE REALTY CORP | アメリカ | 投資証券 | 59,800 | 3,032.56<br>181,353,044 | 3,364.12<br>201,174,729 | 0.90 |
| 27 | VORNADO REALTY TRUST | アメリカ | 投資証券 | 28,864 | 7,554.46<br>218,054,914 | 6,864.06<br>198,124,436 | 0.89 |
| 28 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | アメリカ | 投資証券 | 15,000 | 10,619.14<br>159,287,233 | 12,900.30<br>193,504,608 | 0.87 |
| 29 | DEXUS | オーストラリア | 投資証券 | 184,470 | 835.59<br>154,145,586 | 990.42<br>182,704,401 | 0.82 |
| 30 | INVITATION HOMES INC | アメリカ | 投資証券 | 63,697 | 2,417.62<br>153,996,562 | 2,859.66<br>182,152,317 | 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 | 0.92% |
| 投資証券 | 97.77% |
| 合計 | 98.69% |

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

### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 不動産投信指数先物取引 | アメリカ | DJ US REIT IDXFTRS 2019年9月 | 買建 | 60 | 226,790,160 | 222,995,952 | 1.00% |
| | ドイツ | STOXX600 REIT IDXFTR 2019年9月 | 買建 | 50 | 51,187,652 | 49,516,583 | 0.22% |
| 為替予約取引 | 日本 | ユーロ買/円売 2019年7月 | 買建 | 150,000 | 18,346,330 | 18,372,000 | 0.08% |
| | | 英ポンド買/円売 2019年7月 | 買建 | 106,000 | 14,462,185 | 14,473,100 | 0.06% |
| | | シンガポール・ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 180,000 | 14,264,224 | 14,333,400 | 0.06% |
| | | 米ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 680,000 | 73,183,062 | 73,242,800 | 0.33% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 70,000 | 5,634,887 | 5,759,600 | 0.03% |
| | | 豪ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 145,000 | 10,944,353 | 10,943,150 | 0.05% |
| | | ニュージーランド・ドル買/円売 2019年7月 | 買建 | 20,000 | 1,419,360 | 1,444,400 | 0.01% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

－

（参考情報）運用実績

●FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2019年6月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

**基準価額・純資産の推移**

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 11,031円 |
| 純資産総額 | 7.9億円 |

**基準価額の騰落率**

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 1.1% |
| 3カ月間 | -0.6% |
| 6カ月間 | 14.5% |
| 1年間 | 6.5% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 10.3% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

**分配の推移（10,000口当たり、税引前）**

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

| 決算期 | 第1期 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 外国リート・先物 | 304 | 98.7% |
| 外国投資信託等 | 3 | 1.0% |
| コール・ローン、その他 | | 1.5% |
| 合計 | 307 | - |

| 国・地域別構成 | 比率 |
|---|---|
| アメリカ | 72.4% |
| オーストラリア | 7.2% |
| イギリス | 4.7% |
| シンガポール | 3.9% |
| その他 | 11.5% |
| 合計 | 99.7% |

| 通貨別構成 | 比率 |
|---|---|
| 日本円 | 97.6% |
| 米ドル | 1.6% |
| 豪ドル | 0.5% |
| シンガポール・ドル | 0.3% |
| 香港ドル | 0.1% |
| カナダ・ドル | 0.0% |
| ニュージーランド・ドル | 0.0% |
| 韓国ウォン | 0.0% |
| イスラエル・シュケル | 0.0% |
| その他 | -0.1% |
| 合計 | 100.0% |

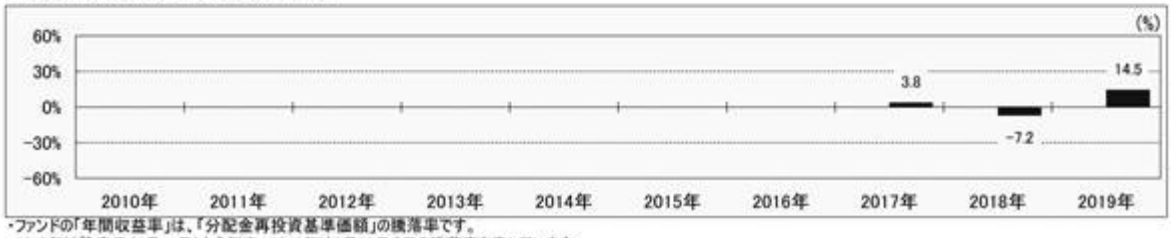
| リート用途別構成 | 比率 |
|---|---|
| 商業施設 | 21.8% |
| 住宅 | 14.5% |
| オフィス | 12.6% |
| 各種不動産 | 11.3% |
| 産業施設 | 11.3% |
| ヘルスケア | 10.1% |
| 貸倉庫 | 6.0% |
| 特殊用途施設 | 5.7% |
| ホテル/リゾート | 4.2% |
| その他 | 0.0% |
| 合計 | 97.5% |

| 組入上位10銘柄 | 用途名 | 国・地域名 | 比率 |
|---|---|---|---|
| PROLOGIS INC | 産業施設 | アメリカ | 4.0% |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 商業施設 | アメリカ | 4.0% |
| PUBLIC STORAGE | 貸倉庫 | アメリカ | 2.9% |
| WELLTOWER INC | ヘルスケア | アメリカ | 2.7% |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 住宅 | アメリカ | 2.3% |
| EQUITY RESIDENTIAL | 住宅 | アメリカ | 2.3% |
| LINK REIT | 商業施設 | 香港 | 2.2% |
| VENTAS INC | ヘルスケア | アメリカ | 2.1% |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 特殊用途施設 | アメリカ | 2.0% |
| REALTY INCOME CORP | 商業施設 | アメリカ | 1.8% |
| 合計 | | | 26.1% |

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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、2019年は6月28日までの騰落率を表しています。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 【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】 (2019年6月28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 | | 544,639,410 | 99.99 |
| | 内　日本 | 544,639,410 | 99.99 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | | 62,254 | 0.01 |
| 純資産総額 | | 544,701,664 | 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】　(2019年6月28日現在)

### ①　【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数または額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円) | 評価単価<br>時価<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 229,679,674 | 2.3077<br>530,052,334 | 2.3713<br>544,639,410 | 99.99 |

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### ②　【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### ③　【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)　【運用実績】

### ①　【純資産の推移】

| | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|---|---|---|---|---|
| 第1計算期間末<br>(2017年11月30日) | 312,291,612 | 312,291,612 | 1.0273 | 1.0273 |
| 2018年6月末日 | 511,590,719 | ― | 1.0201 | ― |
| 7月末日 | 516,414,307 | ― | 1.0238 | ― |
| 8月末日 | 546,399,188 | ― | 1.0560 | ― |
| 9月末日 | 538,352,478 | ― | 1.0420 | ― |
| 10月末日 | 541,431,270 | ― | 1.0262 | ― |
| 第2計算期間末<br>(2018年11月30日) | 561,256,874 | 561,256,874 | 1.0501 | 1.0501 |
| 12月末日 | 509,704,837 | ― | 0.9568 | ― |
| 2019年1月末日 | 562,799,972 | ― | 1.0460 | ― |
| 2月末日 | 576,459,575 | ― | 1.0705 | ― |
| 3月末日 | 594,490,421 | ― | 1.1096 | ― |
| 4月末日 | 555,104,099 | ― | 1.1058 | ― |
| 5月末日 | 542,130,864 | ― | 1.0747 | ― |
| 6月末日 | 544,701,664 | ― | 1.0774 | ― |

**②　【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | ― |

**③　【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 |
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 2.3 |

**(4)　【設定及び解約の実績】**

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|---|---|---|
| 第1計算期間 | 323,203,250 | 29,221,075 |
| 第2計算期間 | 333,551,014 | 103,078,923 |

| | | |
|---|---|---|
| 2018年12月1日～<br>2019年5月31日 | 86,550,668 | 116,540,753 |

（注）　当初設定数量は10,000,000口です。

**（参考）マザーファンド**

**ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド**

前記「ダイワ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）」の記載と同じ。

**（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)

2019年6月28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 | 10,774円 |
| 純資産総額 | 5.4億円 |

### 基準価額の騰落率

| 期間 | ファンド |
|---|---|
| 1カ月間 | 0.3% |
| 3カ月間 | -2.9% |
| 6カ月間 | 12.6% |
| 1年間 | 5.6% |
| 3年間 | - |
| 5年間 | - |
| 設定来 | 7.7% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

### 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

| 決算期 | 第1期 17年11月 | 第2期 18年11月 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 分配金 | 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 |
|---|---|---|
| 外国リート・先物 | 304 | 98.9% |
| 外国投資信託等 | 3 | 1.0% |
| コール・ローン、その他 | | 1.3% |
| 合計 | 307 | - |

| 国・地域別構成 | 比率 |
|---|---|
| アメリカ | 72.6% |
| オーストラリア | 7.2% |
| イギリス | 4.7% |
| シンガポール | 3.9% |
| その他 | 11.5% |
| 合計 | 99.9% |

| 通貨別構成 | 比率 |
|---|---|
| 米ドル | 72.6% |
| 豪ドル | 7.3% |
| ユーロ | 6.3% |
| 英ポンド | 4.9% |
| シンガポール・ドル | 3.8% |
| 香港ドル | 2.7% |
| カナダ・ドル | 2.0% |
| ニュージーランド・ドル | 0.5% |
| イスラエル・シュケル | 0.1% |
| その他 | -0.0% |
| 合計 | 100.0% |

| リート用途別構成 | 比率 |
|---|---|
| 商業施設 | 21.8% |
| 住宅 | 14.6% |
| オフィス | 12.6% |
| 各種不動産 | 11.3% |
| 産業施設 | 11.3% |
| ヘルスケア | 10.1% |
| 貸倉庫 | 6.0% |
| 特殊用途施設 | 5.7% |
| ホテル/リゾート | 4.2% |
| その他 | 0.0% |
| 合計 | 97.6% |

| 組入上位10銘柄 | 用途名 | 国・地域名 | 比率 |
|---|---|---|---|
| PROLOGIS INC | 産業施設 | アメリカ | 4.0% |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 商業施設 | アメリカ | 4.0% |
| PUBLIC STORAGE | 貸倉庫 | アメリカ | 2.9% |
| WELLTOWER INC | ヘルスケア | アメリカ | 2.7% |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 住宅 | アメリカ | 2.3% |
| EQUITY RESIDENTIAL | 住宅 | アメリカ | 2.3% |
| LINK REIT | 商業施設 | 香港 | 2.2% |
| VENTAS INC | ヘルスケア | アメリカ | 2.1% |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 特殊用途施設 | アメリカ | 2.0% |
| REALTY INCOME CORP | 商業施設 | アメリカ | 1.8% |
| 合計 | | | 26.1% |

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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＆P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2019年は6月28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。

**最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。**

## 第２　【管理及び運営】

### １　【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### ２　【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

ただし、後掲の別表Ａに掲げる各ファンドについて、後掲の別表Ａに掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を請求受付日とする一部解約の実行の請求の受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、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　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 ＴＯＰＩＸインデックス<br>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）<br>FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）<br>FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス<br>FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | 5営業日目 |
| FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） | 6営業日目 |

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

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

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

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

［別表Ａ］

| ファンド名 | 該当日 |
|---|---|
| FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） | ニューヨーク証券取引所の休業日 |
| FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） | ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、シカゴ商品取引所における米国債先物取引の休業日 |
| FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） | ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日 |
| FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | ニューヨーク証券取引所または<br>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<br>FWO 日本債券インデックス<br>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）<br>FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）<br>FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）<br>FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）<br>FWO 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | 申込受付日の翌営業日の基準価額 |

## ３　【資産管理等の概要】

### (1) 【資産の評価】

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

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

*「FWO Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」は除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）
・委託会社のホームページ
　アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年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】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、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。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

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

② 信託約款の変更等

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④　運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤　公告

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

⑥　関係法人との契約の更改

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

## 4　【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　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。

② 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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1　【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | － | 1,337,664 |
| コール・ローン | 2,625,624 | 2,601,446 |
| 親投資信託受益証券 | 1,308,406,920 | 2,014,707,269 |
| 流動資産合計 | 1,311,032,544 | 2,018,646,379 |
| 資産合計 | 1,311,032,544 | 2,018,646,379 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,645,368 | 1,531,637 |
| 未払受託者報酬 | 83,393 | 212,032 |
| 未払委託者報酬 | 792,482 | 2,014,714 |
| その他未払費用 | 20,785 | 52,954 |
| 流動負債合計 | 2,542,028 | 3,811,337 |
| 負債合計 | 2,542,028 | 3,811,337 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 1,106,392,276 | ※1 1,797,553,299 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 202,098,240 | 217,281,743 |
| （分配準備積立金） | 137,802,709 | 106,343,778 |
| 元本等合計 | 1,308,490,516 | 2,014,835,042 |
| 純資産合計 | 1,308,490,516 | 2,014,835,042 |
| 負債純資産合計 | 1,311,032,544 | 2,018,646,379 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | ― | 1 |
| 有価証券売買等損益 | 146,189,440 | △ 100,981,651 |
| 営業収益合計 | 146,189,440 | △ 100,981,650 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 437 | 2,334 |
| 受託者報酬 | 111,497 | 377,289 |
| 委託者報酬 | 1,059,815 | 3,585,033 |
| その他費用 | 27,760 | 94,483 |
| 営業費用合計 | 1,199,509 | 4,059,139 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 144,989,931 | △ 105,040,789 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 144,989,931 | △ 105,040,789 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 144,989,931 | △ 105,040,789 |
| 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（△） | 7,187,649 | △ 4,286,978 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 202,098,240 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 68,002,360 | 185,831,267 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 68,002,360 | 185,831,267 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 3,706,402 | 69,893,953 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 3,706,402 | 69,893,953 |
| 分配金 | ※1 ― | ※1 ― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 202,098,240 | 217,281,743 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 1,106,392,276円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,207,147,382円 | 1,072,657,156円 |
| 期中一部解約元本額 | 101,755,106円 | 381,496,133円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 1,106,392,276口 | 1,797,553,299口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（137,802,709円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,296,078円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は202,098,787円（1万口当たり1,826.65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（117,542,288円）及び分配準備積立金（106,343,778円）より分配対象額は223,886,066円（1万口当たり1,245.50円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 145,681,833 | △100,242,073 |
| 合計 | 145,681,833 | △100,242,073 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.1827円 | 1.1209円 |

| | | |
|---|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (11,827円) | (11,209円) |

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | トピックス・インデックス・マザーファンド | 1,905,520,921 | 2,014,707,269 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 2,014,707,269 | |
| 合計 | | | 2,014,707,269 | |

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

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 5,748,360,758 |
| コール・ローン | 5,276,595,266 | 11,179,224,344 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 株式 | ※2※3 | 141,293,259,400 | 140,729,270,900 |
| 派生商品評価勘定 | | 81,277,080 | 26,461,940 |
| 未収入金 | | ― | 76,903,429 |
| 未収配当金 | | 779,613,672 | 875,753,046 |
| 未収利息 | | 327,444 | 1,251,373 |
| 前払金 | | ― | 21,520,000 |
| その他未収収益 | ※4 | 9,771,083 | 30,930,674 |
| 流動資産合計 | | 147,440,843,945 | 158,689,676,464 |
| 資産合計 | | 147,440,843,945 | 158,689,676,464 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,080 | 7,672,420 |
| 前受金 | | 69,750,000 | ― |
| 未払金 | | 452,160 | 1,030,901,154 |
| 未払解約金 | | 254,453,100 | 23,803,900 |
| 受入担保金 | | 3,958,464,457 | 15,009,839,092 |
| その他未払費用 | | ― | 174,575 |
| 流動負債合計 | | 4,283,120,797 | 16,072,391,141 |
| 負債合計 | | 4,283,120,797 | 16,072,391,141 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※1 | 128,627,233,302 | 134,890,694,102 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | | 14,530,489,846 | 7,726,591,221 |
| 元本等合計 | | 143,157,723,148 | 142,617,285,323 |
| 純資産合計 | | 143,157,723,148 | 142,617,285,323 |
| 負債純資産合計 | | 147,440,843,945 | 158,689,676,464 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)新株予約権証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3.　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 136,586,140,187円 | 128,627,233,302円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,108,210,927円 | 18,705,077,077円 |
| 期中一部解約元本額 | 22,067,117,812円 | 12,441,616,277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 | 4,364,412,056円 | 4,208,196,163円 |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ | 11,109,078,226円 | 8,873,990,627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 | 63,469,755円 | 50,893,960円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 80,019,243円 | 65,059,832円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 1,411,218,462円 | 1,060,778,978円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 70,073,352円 | 59,055,392円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 1,949,560,771円 | 1,449,339,094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） | －円 | 4,513,952円 |
| Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス | 28,367,467円 | 39,579,272円 |
| 為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド | 25,160,362円 | 19,750,054円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 571,628円 | 687,039円 |
| ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス | 294,793,376円 | 766,287,386円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 624,779,967円 | 1,279,701,333円 |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | －円 | 18,821,903円 |
| ＤＣダイワ日本株式インデックス | 60,695,276,446円 | 65,506,653,858円 |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 2,195,311,787円 | 2,604,113,138円 |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 2,320,693,161円 | 2,907,019,868円 |
| ダイワ・ライフ・バランス７０ | 2,181,670,247円 | 2,813,203,474円 |
| 年金ダイワ日本株式インデックス | 4,033,420,970円 | 4,626,136,087円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 17,249,227円 | 15,110,700円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 51,964,735円 | 52,614,491円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 13,124,314円 | 16,862,669円 |
| ダイワつみたてインデックス日本株式 | －円 | 9,822,989円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ | 364,602円 | 350,718円 |

| | | |
|---|---|---|
| ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ | 362,318円 | 359,201円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型） | 690,983円 | 712,052円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ | 6,930,943円 | 4,149,572円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ | 19,322,872円 | 4,912,940円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型） | 15,921,448円 | 9,756,807円 |
| ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 359,581,980円 | 184,587,297円 |
| ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 168,953,117円 | 162,072,230円 |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 11,001,597,589円 | 9,658,927,568円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 227,225,197円 | 11,433,435円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 239,347,643円 | 14,487,998円 |
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 895,003,489円 | 823,275,779円 |
| ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 144,200,065円 | 129,734,372円 |
| ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用） | 242,040,229円 | 221,128,598円 |
| ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド | 70,307,122円 | 140,301,263円 |
| ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス | 5,865,224,891円 | 8,504,620,250円 |
| ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 4,249,531円 | 292,440,998円 |
| ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス | 1,175,567,763円 | 1,905,520,921円 |
| ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ | 1,188,177,701円 | 1,400,114,800円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 176,027,159円 | 181,369,214円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 628,315,358円 | 649,148,174円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 505,576,948円 | 544,757,466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） | 14,162,028,802円 | 13,598,340,190円 |

| | | |
|---|---|---|
| 計 | 128,627,233,302円 | 134,890,694,102円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 128,627,233,302口 | 134,890,694,102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。<br>株式　3,819,839,950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。<br>株式　14,441,000,290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。<br>株式　704,400,000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。<br>株式　680,300,000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8,686,485円が含まれております。 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分28,279,195円が含まれております。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>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 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 株式 | 9,624,573,051 | △9,360,479,994 |
| 合計 | 9,624,573,051 | △9,360,479,994 |

（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（平成29年9月20日から平成29年11月30日まで、及び平成30年9月20日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30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 | (円) | (円) | (円) | うち | (円) | (円) |

| | | 1年超 | | | | 1年超 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引<br><br>株価指数<br>先物取引<br><br>買　建 | 1,715,670,000 | － | 1,797,000,000 | 81,330,000 | 1,849,310,000 | － | 1,868,160,000 | 18,850,000 |
| 合計 | 1,715,670,000 | － | 1,797,000,000 | 81,330,000 | 1,849,310,000 | － | 1,868,160,000 | 18,850,000 |

（注）　1．　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.1130円<br>(11,130円) | 1.0573円<br>(10,573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 | 2,600 | 3,225.00 | 8,385,000 | |
| 日本水産 | 81,100 | 686.00 | 55,634,600 | |
| マルハニチロ | 11,700 | 4,105.00 | 48,028,500 | |
| ホウスイ | 500 | 911.00 | 455,500 | |
| カネコ種苗 | 2,200 | 1,437.00 | 3,161,400 | |
| サカタのタネ | 9,900 | 3,895.00 | 38,560,500 | |
| ホクト | 6,700 | 2,019.00 | 13,527,300 | |
| ホクリヨウ | 1,000 | 752.00 | 752,000 | |
| ヒノキヤグループ | 1,700 | 2,113.00 | 3,592,100 | |
| ショーボンドＨＤ | 6,300 | 8,700.00 | 54,810,000 | 貸付株式数　1,600株<br>(1,600株) |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ミライト・ホールディングス | 20,500 | 1,664.00 | 34,112,000 | 貸付株式数 | 5,500株<br>(5,500株) |
| タマホーム | 5,200 | 1,111.00 | 5,777,200 | 貸付株式数 | 1,800株<br>(1,800株) |
| サンヨーホームズ | 1,400 | 875.00 | 1,225,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| 日本アクア | 2,000 | 390.00 | 780,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| ファーストコーポレーション | 2,300 | 1,066.00 | 2,451,800 | 貸付株式数 | 900株 |
| ベステラ | 1,500 | 1,565.00 | 2,347,500 | | |
| スペースバリューＨＤ | 9,800 | 1,046.00 | 10,250,800 | | |
| 住石ホールディングス | 16,400 | 115.00 | 1,886,000 | | |
| 日鉄鉱業 | 1,800 | 5,560.00 | 10,008,000 | | |
| 三井松島ＨＬＤＧＳ | 3,300 | 1,612.00 | 5,319,600 | | |
| 国際石油開発帝石 | 324,500 | 1,205.00 | 391,022,500 | | |
| 石油資源開発 | 11,600 | 2,354.00 | 27,306,400 | | |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 3,900 | 1,636.00 | 6,380,400 | | |
| ダイセキ環境ソリューション | 1,500 | 865.00 | 1,297,500 | | |
| 第一カッター興業 | 900 | 2,140.00 | 1,926,000 | | |
| 安藤・間 | 51,500 | 686.00 | 35,329,000 | | |
| 東急建設 | 23,600 | 1,145.00 | 27,022,000 | | |
| コムシスホールディングス | 28,700 | 2,930.00 | 84,091,000 | | |
| ミサワホーム | 6,800 | 831.00 | 5,650,800 | | |
| ビーアールホールディングス | 6,500 | 397.00 | 2,580,500 | | |
| 高松コンストラクションＧＰ | 5,100 | 2,899.00 | 14,784,900 | | |
| 東建コーポレーション | 2,500 | 7,780.00 | 19,450,000 | | |
| ソネック | 800 | 778.00 | 622,400 | | |
| ヤマウラ | 3,000 | 902.00 | 2,706,000 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| 大成建設 | 66,500 | 4,990.00 | 331,835,000 | | |
| 大　林　組 | 200,300 | 1,132.00 | 226,739,600 | | |
| 清水建設 | 204,400 | 970.00 | 198,268,000 | | |
| 飛島建設 | 5,600 | 1,560.00 | 8,736,000 | | |
| 長谷工コーポレーシヨン | 83,700 | 1,374.00 | 115,003,800 | | |
| 松井建設 | 7,300 | 853.00 | 6,226,900 | | |
| 錢　高　組 | 800 | 5,500.00 | 4,400,000 | | |
| 鹿島建設 | 156,400 | 1,571.00 | 245,704,400 | | |
| 不動テトラ | 5,000 | 1,952.00 | 9,760,000 | | |
| 大末建設 | 2,300 | 1,190.00 | 2,737,000 | | |
| 鉄建建設 | 4,000 | 3,020.00 | 12,080,000 | | |
| 西松建設 | 14,400 | 2,618.00 | 37,699,200 | | |
| 三井住友建設 | 48,000 | 705.00 | 33,840,000 | | |
| 大豊建設 | 4,600 | 3,775.00 | 17,365,000 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 前田建設 | 47,600 | 1,192.00 | 56,739,200 | |
| 佐田建設 | 4,000 | 433.00 | 1,732,000 | |
| ナカノフドー建設 | 4,900 | 625.00 | 3,062,500 | 貸付株式数 1,000株 |
| 奥　村　組 | 11,000 | 3,785.00 | 41,635,000 | |
| 東鉄工業 | 8,000 | 3,340.00 | 26,720,000 | |
| イチケン | 1,200 | 2,165.00 | 2,598,000 | 貸付株式数 100株 |
| 富士ピー・エス | 2,000 | 517.00 | 1,034,000 | |
| 淺沼組 | 2,400 | 3,475.00 | 8,340,000 | |
| 戸田建設 | 77,800 | 764.00 | 59,439,200 | |
| 熊　谷　組 | 9,600 | 3,595.00 | 34,512,000 | |
| 青木あすなろ建設 | 3,600 | 1,028.00 | 3,700,800 | |
| 北野建設 | 1,400 | 4,075.00 | 5,705,000 | |
| 植　木　組 | 800 | 2,453.00 | 1,962,400 | |
| 矢作建設 | 9,100 | 764.00 | 6,952,400 | |
| ピーエス三菱 | 7,000 | 711.00 | 4,977,000 | |
| 日本ハウスＨＬＤＧＳ | 12,600 | 504.00 | 6,350,400 | 貸付株式数 3,100株 |
| 大東建託 | 23,900 | 14,830.00 | 354,437,000 | |
| 新日本建設 | 8,200 | 1,210.00 | 9,922,000 | |
| ＮＩＰＰＯ | 17,700 | 1,935.00 | 34,249,500 | |
| 東亜道路 | 1,200 | 3,250.00 | 3,900,000 | 貸付株式数 800株 |
| 前田道路 | 21,100 | 2,230.00 | 47,053,000 | |
| 日本道路 | 1,800 | 6,170.00 | 11,106,000 | |
| 東亜建設 | 5,800 | 1,576.00 | 9,140,800 | |
| 若築建設 | 3,400 | 1,723.00 | 5,858,200 | 貸付株式数 1,000株 |
| 東洋建設 | 24,200 | 423.00 | 10,236,600 | |
| 五洋建設 | 79,300 | 716.00 | 56,778,800 | |
| 世紀東急 | 9,400 | 674.00 | 6,335,600 | |
| 福　田　組 | 2,200 | 5,410.00 | 11,902,000 | 貸付株式数 600株 |
| 日本ドライケミカル | 1,500 | 1,318.00 | 1,977,000 | |
| 住友林業 | 47,300 | 1,675.00 | 79,227,500 | |
| 日本基礎技術 | 6,600 | 346.00 | 2,283,600 | |
| 巴コーポレーション | 8,300 | 451.00 | 3,743,300 | 貸付株式数 4,600株 |
| 大和ハウス | 185,100 | 3,575.00 | 661,732,500 | |
| ライト工業 | 12,900 | 1,545.00 | 19,930,500 | |
| 積水ハウス | 205,200 | 1,711.00 | 351,097,200 | |
| 日特建設 | 5,600 | 700.00 | 3,920,000 | |
| 北陸電気工事 | 3,100 | 1,000.00 | 3,100,000 | |
| ユアテック | 10,700 | 936.00 | 10,015,200 | 貸付株式数 500株 |
| 四電工 | 1,000 | 2,738.00 | 2,738,000 | |
| 中電工 | 8,600 | 2,524.00 | 21,706,400 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 関　電　工 | 30,500 | 1,178.00 | 35,929,000 | 貸付株式数 | 6,800株 |
| きんでん | 44,600 | 1,966.00 | 87,683,600 | | |
| 東京エネシス | 6,700 | 965.00 | 6,465,500 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| トーエネック | 1,900 | 3,140.00 | 5,966,000 | | |
| 住友電設 | 4,600 | 2,079.00 | 9,563,400 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 日本電設工業 | 11,500 | 2,482.00 | 28,543,000 | | |
| 協和エクシオ | 26,100 | 2,860.00 | 74,646,000 | | |
| 新日本空調 | 5,700 | 2,063.00 | 11,759,100 | | |
| 日本工営 | 3,800 | 2,731.00 | 10,377,800 | | |
| 九電工 | 13,200 | 4,415.00 | 58,278,000 | | |
| 三機工業 | 15,100 | 1,221.00 | 18,437,100 | | |
| 日　揮 | 57,500 | 1,658.00 | 95,335,000 | | |
| 中外炉工業 | 1,900 | 2,468.00 | 4,689,200 | | |
| ヤマト | 5,900 | 636.00 | 3,752,400 | | |
| 太平電業 | 4,400 | 2,790.00 | 12,276,000 | | |
| 高砂熱学 | 16,900 | 2,037.00 | 34,425,300 | | |
| 三晃金属 | 800 | 3,010.00 | 2,408,000 | | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 6,500 | 2,528.00 | 16,432,000 | | |
| 朝日工業社 | 1,400 | 3,330.00 | 4,662,000 | | |
| 明星工業 | 12,000 | 845.00 | 10,140,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 大　氣　社 | 9,100 | 3,190.00 | 29,029,000 | 貸付株式数 | 2,100株<br>(2,100株) |
| ダイダン | 4,400 | 2,553.00 | 11,233,200 | | |
| 日比谷総合設備 | 6,300 | 1,926.00 | 12,133,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 東芝プラントシステム | 14,500 | 2,483.00 | 36,003,500 | 貸付株式数 | 3,700株<br>(3,700株) |
| 日本製粉 | 19,700 | 1,937.00 | 38,158,900 | | |
| 日清製粉Ｇ本社 | 67,700 | 2,385.00 | 161,464,500 | | |
| 日東富士製粉 | 400 | 5,620.00 | 2,248,000 | | |
| 昭和産業 | 5,400 | 2,837.00 | 15,319,800 | 貸付株式数 | 700株 |
| 鳥越製粉 | 5,300 | 948.00 | 5,024,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 中部飼料 | 7,200 | 1,405.00 | 10,116,000 | | |
| フィード・ワン | 39,500 | 210.00 | 8,295,000 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| 東洋精糖 | 900 | 1,173.00 | 1,055,700 | | |
| 日本甜菜糖 | 3,400 | 1,967.00 | 6,687,800 | | |
| 三井製糖 | 4,700 | 3,020.00 | 14,194,000 | | |
| 塩水港精糖 | 6,500 | 251.00 | 1,631,500 | | |
| 日新製糖 | 2,900 | 2,385.00 | 6,916,500 | | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 19,800 | 897.00 | 17,760,600 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ジェイエイシーリクルートメント | 4,600 | 2,315.00 | 10,649,000 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| 日本M＆Aセンター | 42,500 | 2,647.00 | 112,497,500 | | |
| メンバーズ | 1,900 | 1,030.00 | 1,957,000 | | |
| 中広 | 500 | 621.00 | 310,500 | | |
| タケエイ | 5,800 | 866.00 | 5,022,800 | | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 700 | 1,186.00 | 830,200 | 貸付株式数 | 200株 |
| トラスト・テック | 2,700 | 3,260.00 | 8,802,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| コシダカホールディングス | 15,300 | 1,535.00 | 23,485,500 | | |
| アルトナー | 1,000 | 781.00 | 781,000 | | |
| パソナグループ | 5,400 | 1,397.00 | 7,543,800 | 貸付株式数 | 500株<br>(500株) |
| ＣＤＳ | 1,400 | 1,329.00 | 1,860,600 | 貸付株式数 | 700株 |
| リンクアンドモチベーション | 10,500 | 1,041.00 | 10,930,500 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| ＧＣＡ | 5,700 | 802.00 | 4,571,400 | | |
| エス・エム・エス | 20,900 | 1,870.00 | 39,083,000 | | |
| パーソルホールディングス | 56,900 | 2,126.00 | 120,969,400 | | |
| リニカル | 3,200 | 1,616.00 | 5,171,200 | | |
| クックパッド | 17,800 | 413.00 | 7,351,400 | 貸付株式数 | 8,200株 |
| エスクリ | 1,600 | 669.00 | 1,070,400 | | |
| アイ・ケイ・ケイ | 2,800 | 724.00 | 2,027,200 | | |
| 森永製菓 | 15,000 | 4,990.00 | 74,850,000 | | |
| 中　村　屋 | 1,600 | 4,515.00 | 7,224,000 | | |
| 江崎グリコ | 18,000 | 5,530.00 | 99,540,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 名糖産業 | 2,900 | 1,475.00 | 4,277,500 | | |
| 井村屋グループ | 2,600 | 3,115.00 | 8,099,000 | | |
| 不　二　家 | 3,200 | 2,514.00 | 8,044,800 | | |
| 山崎製パン | 49,000 | 2,383.00 | 116,767,000 | 貸付株式数 | 5,200株 |
| 第一屋製パン | 1,100 | 1,144.00 | 1,258,400 | 貸付株式数 | 400株 |
| モロゾフ | 1,000 | 5,470.00 | 5,470,000 | | |
| 亀田製菓 | 3,700 | 5,360.00 | 19,832,000 | | |
| 寿スピリッツ | 6,300 | 4,850.00 | 30,555,000 | | |
| カルビー | 27,200 | 3,760.00 | 102,272,000 | 貸付株式数 | 10,300株 |
| 森永乳業 | 11,900 | 3,325.00 | 39,567,500 | | |
| 六甲バター | 4,300 | 2,383.00 | 10,246,900 | | |
| ヤクルト | 44,300 | 8,550.00 | 378,765,000 | | |
| 明治ホールディングス | 42,400 | 8,930.00 | 378,632,000 | | |
| 雪印メグミルク | 14,400 | 3,160.00 | 45,504,000 | | |
| プリマハム | 8,300 | 2,156.00 | 17,894,800 | | |
| 日本ハム | 25,800 | 4,210.00 | 108,618,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 林兼産業 | 1,800 | 672.00 | 1,209,600 | | |
| 丸大食品 | 6,300 | 2,021.00 | 12,732,300 | | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 5,300 | 4,905.00 | 25,996,500 | | |
| 伊藤ハム米久ＨＬＤＧＳ | 38,100 | 755.00 | 28,765,500 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| 学情 | 2,300 | 1,536.00 | 3,532,800 | | |
| スタジオアリス | 2,900 | 2,598.00 | 7,534,200 | | |
| シミックホールディングス | 3,200 | 2,177.00 | 6,966,400 | | |
| システナ | 20,900 | 1,461.00 | 30,534,900 | | |
| ＮＪＳ | 1,200 | 1,719.00 | 2,062,800 | | |
| デジタルアーツ | 3,100 | 6,490.00 | 20,119,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 新日鉄住金ＳＯＬ | 8,800 | 3,245.00 | 28,556,000 | | |
| 綜合警備保障 | 22,700 | 5,340.00 | 121,218,000 | | |
| キューブシステム | 3,100 | 771.00 | 2,390,100 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| いちご | 74,000 | 389.00 | 28,786,000 | | |
| エイジア | 1,200 | 1,404.00 | 1,684,800 | 貸付株式数 | 400株 |
| 日本駐車場開発 | 75,600 | 160.00 | 12,096,000 | | |
| コア | 2,400 | 1,401.00 | 3,362,400 | | |
| カカクコム | 42,900 | 2,284.00 | 97,983,600 | | |
| アイロムグループ | 2,200 | 2,193.00 | 4,824,600 | | |
| セントケア・ホールディング | 3,100 | 585.00 | 1,813,500 | | |
| サイネックス | 900 | 763.00 | 686,700 | | |
| ルネサンス | 3,100 | 2,372.00 | 7,353,200 | | |
| ディップ | 9,100 | 2,550.00 | 23,205,000 | | |
| ＳＢＳホールディングス | 6,100 | 1,369.00 | 8,350,900 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| オプトホールディング | 3,500 | 2,117.00 | 7,409,500 | 貸付株式数 | 1,500株<br>(1,500株) |
| 新日本科学 | 7,900 | 711.00 | 5,616,900 | | |
| ツクイ | 13,300 | 1,021.00 | 13,579,300 | 貸付株式数 | 400株 |
| キャリアデザインセンター | 1,400 | 1,302.00 | 1,822,800 | | |
| エムスリー | 120,100 | 1,834.00 | 220,263,400 | | |
| ツカダ・グローバルＨＯＬＤ | 3,800 | 628.00 | 2,386,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ブラス | 500 | 632.00 | 316,000 | | |
| アウトソーシング | 30,000 | 1,423.00 | 42,690,000 | | |
| ウェルネット | 5,700 | 1,145.00 | 6,526,500 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| ワールドホールディングス | 1,600 | 2,736.00 | 4,377,600 | 貸付株式数 | 100株 |
| ディー・エヌ・エー | 30,800 | 2,106.00 | 64,864,800 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| 博報堂ＤＹＨＬＤＧＳ | 79,400 | 1,738.00 | 137,997,200 | | |
| ぐるなび | 8,100 | 842.00 | 6,820,200 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| エスアールジータカミヤ | 6,100 | 695.00 | 4,239,500 | | |
| ジャパンベストレスキューＳ | 4,400 | 1,624.00 | 7,145,600 | 貸付株式数 | 1,700株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ファンコミュニケーションズ | 15,600 | 705.00 | 10,998,000 | 貸付株式数 | 6,300株 |
| ライク | 2,200 | 1,662.00 | 3,656,400 | 貸付株式数 | 800株 |
| ビジネス・ブレークスルー | 2,300 | 377.00 | 867,100 | | |
| ＷＤＢホールディングス | 2,600 | 2,878.00 | 7,482,800 | | |
| ティア | 2,600 | 690.00 | 1,794,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ＣＤＧ | 500 | 1,461.00 | 730,500 | | |
| バリューコマース | 3,900 | 1,486.00 | 5,795,400 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| インフォマート | 31,300 | 1,394.00 | 43,632,200 | 貸付株式数 | 12,300株 |
| サッポロホールディングス | 21,900 | 2,585.00 | 56,611,500 | 貸付株式数 | 8,600株 |
| アサヒグループホールディン | 125,300 | 4,754.00 | 595,676,200 | | |
| キリンＨＤ | 270,900 | 2,665.00 | 721,948,500 | | |
| 宝ホールディングス | 45,000 | 1,447.00 | 65,115,000 | | |
| オエノンホールディングス | 16,800 | 386.00 | 6,484,800 | 貸付株式数 | 4,500株 |
| 養　命　酒 | 1,900 | 2,423.00 | 4,603,700 | | |
| コカ・コーラボトラーズＪＨＤ | 45,900 | 3,250.00 | 149,175,000 | | |
| サントリー食品インター | 40,000 | 4,760.00 | 190,400,000 | | |
| ダイドーグループＨＤ | 3,400 | 6,180.00 | 21,012,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 伊　藤　園 | 19,900 | 5,210.00 | 103,679,000 | | |
| キーコーヒー | 5,900 | 2,149.00 | 12,679,100 | | |
| ユニカフェ | 1,800 | 1,268.00 | 2,282,400 | | |
| ジャパンフーズ | 800 | 1,233.00 | 986,400 | | |
| 日清オイリオグループ | 7,700 | 3,520.00 | 27,104,000 | | |
| 不二製油グループ | 14,600 | 3,630.00 | 52,998,000 | | |
| かどや製油 | 600 | 5,840.00 | 3,504,000 | | |
| Ｊ－オイルミルズ | 3,100 | 4,050.00 | 12,555,000 | | |
| ローソン | 14,800 | 7,430.00 | 109,964,000 | | |
| サンエー | 4,400 | 4,765.00 | 20,966,000 | | |
| カワチ薬品 | 4,500 | 2,209.00 | 9,940,500 | | |
| エービーシー・マート | 9,200 | 6,380.00 | 58,696,000 | | |
| ハードオフコーポレーション | 2,300 | 915.00 | 2,104,500 | | |
| 高千穂交易 | 2,200 | 1,079.00 | 2,373,800 | | |
| アスクル | 5,100 | 2,965.00 | 15,121,500 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ゲオホールディングス | 8,900 | 1,911.00 | 17,007,900 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| アダストリア | 8,100 | 1,859.00 | 15,057,900 | 貸付株式数 | 800株<br>(100株) |
| ジーフット | 3,900 | 752.00 | 2,932,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| シー・ヴイ・エス・ベイエリア | 700 | 744.00 | 520,800 | | |
| 伊藤忠食品 | 1,400 | 5,320.00 | 7,448,000 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| くらコーポレーション | 3,400 | 7,140.00 | 24,276,000 | |
| キャンドゥ | 2,700 | 1,684.00 | 4,546,800 | |
| エレマテック | 2,700 | 2,261.00 | 6,104,700 | |
| パルグループＨＬＤＧＳ | 3,000 | 3,080.00 | 9,240,000 | |
| ＪＡＬＵＸ | 1,700 | 2,862.00 | 4,865,400 | 貸付株式数 200株 |
| エディオン | 24,900 | 1,248.00 | 31,075,200 | 貸付株式数 9,000株 |
| あらた | 3,200 | 4,930.00 | 15,776,000 | |
| サーラコーポレーション | 11,800 | 661.00 | 7,799,800 | |
| ワッツ | 1,900 | 815.00 | 1,548,500 | 貸付株式数 100株 |
| トーメンデバイス | 800 | 2,461.00 | 1,968,800 | |
| ハローズ | 2,200 | 2,598.00 | 5,715,600 | |
| ＪＰホールディングス | 16,100 | 309.00 | 4,974,900 | 貸付株式数 6,400株 (2,000株) |
| あみやき亭 | 1,300 | 4,100.00 | 5,330,000 | |
| 東京エレクトロンデバイス | 2,100 | 1,911.00 | 4,013,100 | |
| ひらまつ | 11,600 | 369.00 | 4,280,400 | 貸付株式数 5,900株 |
| フィールズ | 5,100 | 916.00 | 4,671,600 | 貸付株式数 1,200株 |
| 双日 | 324,700 | 402.00 | 130,529,400 | |
| アルフレッサホールディングス | 65,200 | 3,020.00 | 196,904,000 | |
| 大黒天物産 | 1,400 | 4,485.00 | 6,279,000 | 貸付株式数 400株 |
| ハニーズホールディングス | 5,600 | 909.00 | 5,090,400 | |
| ファーマライズＨＤ | 1,400 | 603.00 | 844,200 | 貸付株式数 500株 (500株) |
| キッコーマン | 39,500 | 6,620.00 | 261,490,000 | |
| 味　の　素 | 135,500 | 1,962.50 | 265,918,750 | 貸付株式数 20,600株 |
| キユーピー | 33,300 | 2,756.00 | 91,774,800 | |
| ハウス食品Ｇ本社 | 22,900 | 4,025.00 | 92,172,500 | |
| カ　ゴ　メ | 23,900 | 3,315.00 | 79,228,500 | |
| 焼津水産化工 | 2,900 | 1,092.00 | 3,166,800 | 貸付株式数 1,000株 |
| アリアケジャパン | 5,500 | 9,810.00 | 53,955,000 | |
| ピエトロ | 700 | 1,643.00 | 1,150,100 | |
| エバラ食品工業 | 1,400 | 2,228.00 | 3,119,200 | |
| ニチレイ | 31,100 | 3,205.00 | 99,675,500 | |
| 横浜冷凍 | 15,200 | 948.00 | 14,409,600 | |
| 東洋水産 | 30,700 | 3,890.00 | 119,423,000 | |
| イートアンド | 2,000 | 1,771.00 | 3,542,000 | |
| 大冷 | 700 | 1,825.00 | 1,277,500 | |
| ヨシムラ・フード・ＨＬＤＧＳ | 1,600 | 671.00 | 1,073,600 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 日清食品ＨＤ | 25,400 | 7,330.00 | 186,182,000 | | |
| 永谷園ホールディングス | 3,100 | 2,787.00 | 8,639,700 | | |
| 一正蒲鉾 | 2,300 | 1,096.00 | 2,520,800 | 貸付株式数 | 800株 |
| フジッコ | 6,400 | 2,494.00 | 15,961,600 | | |
| ロックフィールド | 6,400 | 1,687.00 | 10,796,800 | | |
| 日本たばこ産業 | 345,600 | 2,823.50 | 975,801,600 | | |
| ケンコーマヨネーズ | 3,300 | 2,300.00 | 7,590,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| わらべや日洋ＨＤ | 3,900 | 1,957.00 | 7,632,300 | 貸付株式数 | 600株 |
| なとり | 3,300 | 1,875.00 | 6,187,500 | | |
| イフジ産業 | 1,000 | 713.00 | 713,000 | | |
| ピックルスコーポレーション | 1,400 | 2,256.00 | 3,158,400 | | |
| 北の達人コーポ | 23,500 | 525.00 | 12,337,500 | 貸付株式数 | 7,900株 |
| ユーグレナ | 24,500 | 698.00 | 17,101,000 | 貸付株式数 | 9,400株<br>(5,800株) |
| 片倉工業 | 7,200 | 1,218.00 | 8,769,600 | | |
| グ　ン　ゼ | 4,200 | 4,455.00 | 18,711,000 | | |
| ヒューリック | 124,000 | 1,038.00 | 128,712,000 | | |
| 神　栄 | 700 | 1,161.00 | 812,700 | | |
| ラサ商事 | 3,200 | 973.00 | 3,113,600 | | |
| アルペン | 4,500 | 1,947.00 | 8,761,500 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| ハブ | 1,900 | 955.00 | 1,814,500 | | |
| ラクーンホールディングス | 3,400 | 705.00 | 2,397,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| クオールホールディングス | 8,600 | 2,030.00 | 17,458,000 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| アルコニックス | 6,200 | 1,305.00 | 8,091,000 | 貸付株式数 | 1,700株<br>(1,700株) |
| 神戸物産 | 8,900 | 3,480.00 | 30,972,000 | | |
| ソリトンシステムズ | 3,300 | 906.00 | 2,989,800 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| ジンズ | 4,000 | 7,020.00 | 28,080,000 | | |
| ビックカメラ | 31,400 | 1,596.00 | 50,114,400 | 貸付株式数 | 8,900株<br>(8,900株) |
| ＤＣＭホールディングス | 31,600 | 1,126.00 | 35,581,600 | 貸付株式数 | 12,500株<br>(9,100株) |
| ペッパーフードサービス | 4,600 | 4,100.00 | 18,860,000 | 貸付株式数 | 1,800株<br>(300株) |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 37,200 | 3,075.00 | 114,390,000 | 貸付株式数 | 14,700株 |
| 東京一番フーズ | 1,400 | 633.00 | 886,200 | 貸付株式数 | 500株<br>(500株) |
| ＤＤホールディングス | 1,300 | 2,466.00 | 3,205,800 | 貸付株式数 | 500株 |
| あい　ホールディングス | 9,400 | 2,263.00 | 21,272,200 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| ディーブイエックス | 2,200 | 1,220.00 | 2,684,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| きちり | 1,500 | 825.00 | 1,237,500 | 貸付株式数 | 600株 |
| アークランドサービスＨＤ | 4,200 | 2,514.00 | 10,558,800 | | |
| Ｊ．　フロント　リテイリング | 75,200 | 1,550.00 | 116,560,000 | 貸付株式数 | 26,800株 |
| ドトール・日レスＨＤ | 10,200 | 2,215.00 | 22,593,000 | | |
| マツモトキヨシＨＬＤＧＳ | 24,300 | 4,215.00 | 102,424,500 | | |
| ブロンコビリー | 3,100 | 2,981.00 | 9,241,100 | 貸付株式数 | 1,400株<br>(900株) |
| ＺＯＺＯ | 63,400 | 2,525.00 | 160,085,000 | 貸付株式数 | 22,500株 |
| トレジャー・ファクトリー | 1,700 | 745.00 | 1,266,500 | | |
| 物語コーポレーション | 1,700 | 11,070.00 | 18,819,000 | | |
| ココカラファイン | 6,600 | 6,480.00 | 42,768,000 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| 三越伊勢丹ＨＤ | 110,000 | 1,313.00 | 144,430,000 | 貸付株式数 | 43,400株 |
| 東洋紡 | 24,700 | 1,643.00 | 40,582,100 | | |
| ユニチカ | 17,000 | 548.00 | 9,316,000 | | |
| 富士紡ホールディングス | 3,000 | 3,110.00 | 9,330,000 | | |
| 日清紡ホールディングス | 32,900 | 1,033.00 | 33,985,700 | | |
| 倉敷紡績 | 5,500 | 2,900.00 | 15,950,000 | | |
| ダイワボウＨＤ | 5,400 | 6,360.00 | 34,344,000 | | |
| シキボウ | 3,200 | 1,164.00 | 3,724,800 | | |
| 日東紡績 | 8,800 | 2,174.00 | 19,131,200 | | |
| トヨタ紡織 | 20,800 | 1,749.00 | 36,379,200 | | |
| マクニカ・富士エレＨＬＤＧＳ | 16,200 | 1,752.00 | 28,382,400 | 貸付株式数 | 4,300株 |
| Ｈａｍｅｅ | 1,500 | 1,831.00 | 2,746,500 | 貸付株式数 | 100株 |
| ラクト・ジャパン | 1,300 | 7,960.00 | 10,348,000 | | |
| ウエルシアＨＤ | 15,600 | 5,750.00 | 89,700,000 | | |
| クリエイトＳＤＨ | 8,700 | 3,095.00 | 26,926,500 | | |
| バイタルＫＳＫＨＤ | 11,000 | 1,212.00 | 13,332,000 | 貸付株式数 | 4,400株 |
| 八洲電機 | 6,000 | 835.00 | 5,010,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| メディアスホールディングス | 3,100 | 827.00 | 2,563,700 | | |
| ＵＫＣホールディングス | 3,800 | 2,436.00 | 9,256,800 | 貸付株式数 | 1,600株<br>(1,600株) |
| ジューテックＨＤ | 1,300 | 1,065.00 | 1,384,500 | | |
| 丸善ＣＨＩ　ＨＤ | 6,600 | 346.00 | 2,283,600 | | |
| 大光 | 1,400 | 683.00 | 956,200 | 貸付株式数 | 500株 |
| ＯＣＨＩホールディングス | 1,800 | 1,267.00 | 2,280,600 | | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 30,900 | 1,004.00 | 31,023,600 | | |
| 黒谷 | 1,000 | 513.00 | 513,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| ミサワ | 1,000 | 495.00 | 495,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ティーライフ | 800 | 980.00 | 784,000 | | |
| Ｃｏｍｉｎｉｘ | 900 | 841.00 | 756,900 | | |
| エー・ピーカンパニー | 900 | 540.00 | 486,000 | | |
| 三洋貿易 | 3,000 | 2,023.00 | 6,069,000 | | |
| チムニー | 1,700 | 2,751.00 | 4,676,700 | 貸付株式数 | 600株 |
| シュッピン | 4,000 | 1,095.00 | 4,380,000 | | |
| ビューティガレージ | 800 | 1,798.00 | 1,438,400 | | |
| ウイン・パートナーズ | 3,700 | 1,162.00 | 4,299,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ネクステージ | 9,000 | 1,199.00 | 10,791,000 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| ジョイフル本田 | 17,200 | 1,731.00 | 29,773,200 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| 鳥貴族 | 1,900 | 2,242.00 | 4,259,800 | 貸付株式数 | 900株 |
| キリン堂ホールディングス | 2,300 | 1,615.00 | 3,714,500 | | |
| ホットランド | 3,000 | 1,483.00 | 4,449,000 | 貸付株式数 | 1,400株<br>(1,300株) |
| すかいらーくＨＤ | 54,600 | 1,860.00 | 101,556,000 | 貸付株式数 | 21,100株<br>(2,800株) |
| 綿半ホールディングス | 2,200 | 2,717.00 | 5,977,400 | 貸付株式数 | 700株 |
| 日本毛織 | 19,700 | 919.00 | 18,104,300 | | |
| ダイトウボウ | 12,700 | 101.00 | 1,282,700 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| トーア紡コーポレーション | 2,600 | 544.00 | 1,414,400 | | |
| ダイドーリミテッド | 6,900 | 366.00 | 2,525,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ヨシックス | 1,000 | 3,325.00 | 3,325,000 | | |
| ユナイテッド・スーパーマーケ | 17,200 | 1,319.00 | 22,686,800 | | |
| 三栄建築設計 | 2,600 | 1,575.00 | 4,095,000 | | |
| 野村不動産ＨＬＤＧＳ | 40,300 | 2,242.00 | 90,352,600 | | |
| 三重交通グループＨＤ | 12,500 | 614.00 | 7,675,000 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| サムティ | 8,300 | 1,516.00 | 12,582,800 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| エー・ディー・ワークス | 96,100 | 41.00 | 3,940,100 | | |
| 日本商業開発 | 4,200 | 1,732.00 | 7,274,400 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| プレサンスコーポレーション | 9,600 | 1,416.00 | 13,593,600 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| ユニゾホールディングス | 9,100 | 2,312.00 | 21,039,200 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| 日本管理センター | 4,100 | 1,019.00 | 4,177,900 | | |
| サンセイランディック | 1,900 | 1,017.00 | 1,932,300 | | |
| エストラスト | 1,300 | 797.00 | 1,036,100 | | |
| フージャースＨＤ | 13,500 | 656.00 | 8,856,000 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| オープンハウス | 9,600 | 4,040.00 | 38,784,000 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| 東急不動産ＨＤ | 160,200 | 637.00 | 102,047,400 | | |
| 飯田ＧＨＤ | 49,600 | 2,003.00 | 99,348,800 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| イーグランド | 1,100 | 740.00 | 814,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 帝国繊維 | 6,600 | 2,454.00 | 16,196,400 | | |
| 日本コークス工業 | 49,400 | 106.00 | 5,236,400 | | |
| ゴルフダイジェスト・オン | 2,300 | 806.00 | 1,853,800 | 貸付株式数 | 900株 |
| ミタチ産業 | 1,400 | 787.00 | 1,101,800 | 貸付株式数 | 500株 |
| ＢＥＥＮＯＳ | 1,400 | 1,639.00 | 2,294,600 | | |
| あさひ | 4,800 | 1,461.00 | 7,012,800 | | |
| 日本調剤 | 2,100 | 3,670.00 | 7,707,000 | 貸付株式数 | 400株<br>(100株) |
| コスモス薬品 | 3,000 | 23,030.00 | 69,090,000 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| シップヘルスケアＨＤ | 12,200 | 4,270.00 | 52,094,000 | | |
| トーエル | 2,800 | 813.00 | 2,276,400 | | |
| 一六堂 | 1,200 | 513.00 | 615,600 | | |
| ソフトクリエイトＨＤ | 2,500 | 1,739.00 | 4,347,500 | | |
| オンリー | 1,000 | 1,080.00 | 1,080,000 | | |
| セブン＆アイ・ＨＬＤＧＳ | 246,300 | 4,943.00 | 1,217,460,900 | | |
| 薬王堂 | 2,500 | 3,400.00 | 8,500,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| クリエイト・レストランツ・ホール | 15,700 | 1,325.00 | 20,802,500 | 貸付株式数 | 6,200株 |
| 明治電機工業 | 1,800 | 2,126.00 | 3,826,800 | | |
| ツルハホールディングス | 12,700 | 11,200.00 | 142,240,000 | 貸付株式数 | 3,300株<br>(3,300株) |
| デリカフーズＨＬＤＧＳ | 1,000 | 1,452.00 | 1,452,000 | | |
| スターティアホールディングス | 1,100 | 723.00 | 795,300 | | |
| サンマルクホールディングス | 4,600 | 2,774.00 | 12,760,400 | 貸付株式数 | 400株 |
| フェリシモ | 1,300 | 1,212.00 | 1,575,600 | 貸付株式数 | 500株 |
| トリドールホールディングス | 7,200 | 2,212.00 | 15,926,400 | 貸付株式数 | 2,800株<br>(800株) |
| 帝　人 | 47,400 | 1,960.00 | 92,904,000 | | |
| 東　レ | 453,200 | 890.30 | 403,483,960 | | |
| ク　ラ　レ | 98,300 | 1,764.00 | 173,401,200 | | |
| 旭　化　成 | 415,300 | 1,243.00 | 516,217,900 | 貸付株式数 | 37,900株 |
| サカイ　オーベックス | 1,400 | 2,467.00 | 3,453,800 | | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 5,200 | 696.00 | 3,619,200 | 貸付株式数 | 2,100株<br>(2,100株) |
| 稲葉製作所 | 3,200 | 1,357.00 | 4,342,400 | | |
| 宮地エンジニアリングＧ | 1,800 | 2,148.00 | 3,866,400 | | |
| トーカロ | 15,000 | 990.00 | 14,850,000 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| アルファＣＯ | 2,000 | 1,395.00 | 2,790,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| ＳＵＭＣＯ | 65,200 | 1,740.00 | 113,448,000 | 貸付株式数 | 25,500株 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 川田テクノロジーズ | 1,300 | 8,530.00 | 11,089,000 | |
| ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ | 1,200 | 5,040.00 | 6,048,000 | 貸付株式数　400株 |
| ビーロット | 1,000 | 1,369.00 | 1,369,000 | 貸付株式数　300株 |
| ファーストブラザーズ | 1,600 | 1,360.00 | 2,176,000 | 貸付株式数　600株 |
| ハウスドゥ | 2,300 | 1,248.00 | 2,870,400 | 貸付株式数　800株 |
| シーアールイー | 2,600 | 1,009.00 | 2,623,400 | |
| プロパティエージェント | 800 | 1,033.00 | 826,400 | 貸付株式数　200株 |
| ケイアイスター不動産 | 1,800 | 1,881.00 | 3,385,800 | |
| アグレ都市デザイン | 1,000 | 635.00 | 635,000 | |
| ジェイ・エス・ビー | 200 | 4,495.00 | 899,000 | |
| テンポイノベーション | 500 | 1,536.00 | 768,000 | |
| 住江織物 | 1,600 | 2,730.00 | 4,368,000 | 貸付株式数　500株 |
| 日本フエルト | 2,900 | 480.00 | 1,392,000 | |
| イチカワ | 800 | 1,508.00 | 1,206,400 | |
| エコナックホールディングス | 10,400 | 116.00 | 1,206,400 | |
| 日東製網 | 600 | 1,512.00 | 907,200 | |
| 芦森工業 | 1,200 | 1,719.00 | 2,062,800 | |
| アツギ | 4,800 | 1,071.00 | 5,140,800 | |
| ウイルプラスＨＬＤＧＳ | 500 | 968.00 | 484,000 | |
| ジャパンミート | 2,200 | 1,988.00 | 4,373,600 | |
| コメダホールディングス | 13,500 | 2,370.00 | 31,995,000 | |
| サツドラホールディングス | 1,000 | 1,964.00 | 1,964,000 | |
| デファクトスタンダード | 400 | 623.00 | 249,200 | |
| ダイユー・リックＨＬＤＧＳ | 3,100 | 1,191.00 | 3,692,100 | |
| バロックジャパン | 4,700 | 1,073.00 | 5,043,100 | |
| クスリのアオキＨＬＤＧＳ | 4,700 | 8,400.00 | 39,480,000 | 貸付株式数　400株 |
| ダイニック | 2,200 | 807.00 | 1,775,400 | |
| 共和レザー | 3,400 | 888.00 | 3,019,200 | 貸付株式数　1,300株 |
| 力の源ＨＤ | 1,600 | 966.00 | 1,545,600 | |
| スシローグローバルＨＬＤＧＳ | 6,400 | 6,220.00 | 39,808,000 | |
| ＬＩＸＩＬビバ | 4,900 | 1,779.00 | 8,717,100 | 貸付株式数　1,000株 |
| セーレン | 14,400 | 1,898.00 | 27,331,200 | |
| ソトー | 2,200 | 988.00 | 2,173,600 | |
| 東海染工 | 700 | 1,123.00 | 786,100 | |
| 小松マテーレ | 9,600 | 905.00 | 8,688,000 | |
| ワコールホールディングス | 17,000 | 3,095.00 | 52,615,000 | |
| ホギメディカル | 7,200 | 3,425.00 | 24,660,000 | |
| レナウン | 16,300 | 117.00 | 1,907,100 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| クラウディアＨＬＤＧＳ | 1,400 | 495.00 | 693,000 | | |
| ＴＳＩホールディングス | 21,400 | 753.00 | 16,114,200 | 貸付株式数 | 100株 |
| マツオカコーポレーション | 1,800 | 3,245.00 | 5,841,000 | | |
| ワールド | 6,000 | 1,975.00 | 11,850,000 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| ＴＩＳ | 19,500 | 5,240.00 | 102,180,000 | | |
| ネオス | 2,100 | 1,335.00 | 2,803,500 | | |
| 電算システム | 2,200 | 2,273.00 | 5,000,600 | | |
| グリー | 31,400 | 496.00 | 15,574,400 | | |
| コーエーテクモＨＤ | 12,000 | 1,884.00 | 22,608,000 | | |
| 三菱総合研究所 | 2,300 | 3,860.00 | 8,878,000 | | |
| ボルテージ | 1,200 | 680.00 | 816,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| 電算 | 700 | 2,127.00 | 1,488,900 | | |
| ＡＧＳ | 3,300 | 786.00 | 2,593,800 | | |
| ファインデックス | 4,900 | 722.00 | 3,537,800 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 1,300 | 1,959.00 | 2,546,700 | | |
| ブレインパッド | 1,300 | 7,370.00 | 9,581,000 | | |
| ＫＬａｂ | 10,400 | 1,188.00 | 12,355,200 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| ポールトゥウィン・ピットクル | 3,900 | 2,625.00 | 10,237,500 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| イーブックイニシアティブ | 900 | 1,757.00 | 1,581,300 | 貸付株式数 | 300株 |
| ネクソン | 148,900 | 1,342.00 | 199,823,800 | | |
| アイスタイル | 14,900 | 1,163.00 | 17,328,700 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| エムアップ | 2,000 | 2,203.00 | 4,406,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| エイチーム | 3,600 | 1,695.00 | 6,102,000 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| テクノスジャパン | 4,900 | 1,022.00 | 5,007,800 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ｅｎｉｓｈ | 2,000 | 578.00 | 1,156,000 | | |
| コロプラ | 16,600 | 855.00 | 14,193,000 | 貸付株式数 | 4,500株<br>(4,500株) |
| オルトプラス | 3,600 | 422.00 | 1,519,200 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| ブロードリーフ | 28,900 | 635.00 | 18,351,500 | 貸付株式数 | 11,400株 |
| クロス・マーケティングＧ | 1,700 | 432.00 | 734,400 | | |
| デジタルハーツＨＬＤＧＳ | 2,600 | 1,670.00 | 4,342,000 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| メディアドゥＨＬＤＧＳ | 1,800 | 2,771.00 | 4,987,800 | 貸付株式数 | 900株 |
| じげん | 6,300 | 669.00 | 4,214,700 | | |
| ブイキューブ | 3,100 | 524.00 | 1,624,400 | | |
| サイバーリンクス | 900 | 1,043.00 | 938,700 | 貸付株式数 | 300株 |
| ディー・エル・イー | 3,800 | 309.00 | 1,174,200 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| フィックスターズ | 5,600 | 1,353.00 | 7,576,800 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ | 3,100 | 1,264.00 | 3,918,400 | | |
| オプティム | 1,300 | 4,775.00 | 6,207,500 | 貸付株式数 | 500株 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| セレス | 1,900 | 2,134.00 | 4,054,600 | |
| 特種東海製紙 | 3,700 | 4,625.00 | 17,112,500 | |
| ベリサーブ | 600 | 5,530.00 | 3,318,000 | |
| ティーガイア | 5,900 | 2,422.00 | 14,289,800 | |
| セック | 900 | 4,390.00 | 3,951,000 | |
| 日本アジアグループ | 6,400 | 368.00 | 2,355,200 | |
| 豆蔵ホールディングス | 4,000 | 1,072.00 | 4,288,000 | 貸付株式数 1,700株 |
| テクマトリックス | 4,100 | 1,890.00 | 7,749,000 | |
| プロシップ | 800 | 2,490.00 | 1,992,000 | |
| ガンホー・オンライン・エンター | 141,300 | 252.00 | 35,607,600 | 貸付株式数 54,900株 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 9,700 | 6,990.00 | 67,803,000 | 貸付株式数 3,800株 |
| ザッパラス | 2,800 | 400.00 | 1,120,000 | |
| システムリサーチ | 800 | 3,605.00 | 2,884,000 | |
| インターネットイニシアティブ | 9,600 | 2,792.00 | 26,803,200 | |
| さくらインターネット | 7,000 | 592.00 | 4,144,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| ヴィンクス | 2,000 | 1,836.00 | 3,672,000 | 貸付株式数 700株 |
| GMOクラウド | 1,300 | 4,010.00 | 5,213,000 | |
| ＳＲＡホールディングス | 3,100 | 3,040.00 | 9,424,000 | |
| ＭＩＮＯＲＩソリューションズ | 1,100 | 1,625.00 | 1,787,500 | |
| システムインテグレータ | 1,600 | 1,003.00 | 1,604,800 | 貸付株式数 600株 |
| 朝日ネット | 4,800 | 546.00 | 2,620,800 | |
| ｅＢＡＳＥ | 1,700 | 1,729.00 | 2,939,300 | |
| アバント | 1,600 | 1,377.00 | 2,203,200 | |
| アドソル日進 | 2,000 | 1,962.00 | 3,924,000 | |
| フリービット | 4,000 | 988.00 | 3,952,000 | |
| コムチュア | 3,300 | 3,325.00 | 10,972,500 | |
| サイバーコム | 1,000 | 1,719.00 | 1,719,000 | |
| アステリア | 2,900 | 904.00 | 2,621,600 | |
| 王子ホールディングス | 263,000 | 664.00 | 174,632,000 | |
| 日本製紙 | 28,000 | 2,110.00 | 59,080,000 | 貸付株式数 600株 |
| 三菱製紙 | 9,400 | 586.00 | 5,508,400 | 貸付株式数 4,300株 |
| 北越コーポレーション | 38,500 | 575.00 | 22,137,500 | 貸付株式数 1,000株 |
| 中越パルプ | 2,600 | 1,599.00 | 4,157,400 | |
| 巴川製紙 | 1,900 | 1,140.00 | 2,166,000 | |
| 大王製紙 | 28,500 | 1,394.00 | 39,729,000 | 貸付株式数 9,200株 (6,200株) |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 阿波製紙 | 1,500 | 588.00 | 882,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| マークラインズ | 2,000 | 1,524.00 | 3,048,000 | | |
| メディカル・データ・ビジ | 5,200 | 1,026.00 | 5,335,200 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ｇｕｍｉ | 6,700 | 742.00 | 4,971,400 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| ショーケース・ティービー | 1,200 | 941.00 | 1,129,200 | 貸付株式数 | 400株 |
| モバイルファクトリー | 1,600 | 1,354.00 | 2,166,400 | 貸付株式数 | 600株 |
| デジタル・インフォメーション | 2,600 | 1,613.00 | 4,193,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ＰＣＩホールディングス | 1,000 | 2,794.00 | 2,794,000 | | |
| パイプドＨＤ | 900 | 1,035.00 | 931,500 | | |
| アイビーシー | 900 | 1,365.00 | 1,228,500 | 貸付株式数 | 300株 |
| ネオジャパン | 1,100 | 906.00 | 996,600 | 貸付株式数 | 400株 |
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 400 | 2,331.00 | 932,400 | 貸付株式数 | 100株 |
| ランドコンピュータ | 700 | 1,021.00 | 714,700 | | |
| オープンドア | 2,900 | 3,325.00 | 9,642,500 | | |
| マイネット | 1,800 | 1,848.00 | 3,326,400 | | |
| アカツキ | 2,100 | 5,540.00 | 11,634,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| ベネフィットジャパン | 300 | 923.00 | 276,900 | | |
| ＵＢＩＣＯＭホールディングス | 1,100 | 1,149.00 | 1,263,900 | 貸付株式数 | 400株 |
| ＬＩＮＥ | 17,800 | 4,080.00 | 72,624,000 | 貸付株式数 | 7,000株<br>(2,100株) |
| カナミックネットワーク | 900 | 1,970.00 | 1,773,000 | | |
| ノムラシステムコーポレーション | 500 | 1,014.00 | 507,000 | | |
| レンゴー | 60,400 | 963.00 | 58,165,200 | | |
| トーモク | 3,500 | 1,885.00 | 6,597,500 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| ザ・パック | 4,400 | 3,230.00 | 14,212,000 | | |
| チェンジ | 400 | 7,420.00 | 2,968,000 | 貸付株式数 | 100株 |
| シンクロ・フード | 2,400 | 636.00 | 1,526,400 | 貸付株式数 | 900株 |
| オークネット | 3,000 | 1,120.00 | 3,360,000 | | |
| ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 6,400 | 1,050.00 | 6,720,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| マクロミル | 7,300 | 1,781.00 | 13,001,300 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ビーグリー | 1,100 | 1,010.00 | 1,111,000 | | |
| オロ | 600 | 3,805.00 | 2,283,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| 昭和電工 | 38,800 | 4,550.00 | 176,540,000 | | |
| 住友化学 | 459,000 | 616.00 | 282,744,000 | | |
| 住友精化 | 2,900 | 4,820.00 | 13,978,000 | | |
| 日産化学 | 35,900 | 6,160.00 | 221,144,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ラサ工業 | 2,100 | 1,663.00 | 3,492,300 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| クレハ | 5,400 | 7,950.00 | 42,930,000 | | |
| 多木化学 | 900 | 9,670.00 | 8,703,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| テイカ | 4,800 | 2,040.00 | 9,792,000 | | |
| 石原産業 | 11,200 | 1,247.00 | 13,966,400 | | |
| 片倉コープアグリ | 2,200 | 1,197.00 | 2,633,400 | | |
| 日東エフシー | 4,600 | 782.00 | 3,597,200 | | |
| 日本曹達 | 9,200 | 2,708.00 | 24,913,600 | | |
| 東ソー | 90,000 | 1,600.00 | 144,000,000 | | |
| トクヤマ | 16,800 | 3,110.00 | 52,248,000 | 貸付株式数 | 3,500株 |
| セントラル硝子 | 12,700 | 2,798.00 | 35,534,600 | | |
| 東亜合成 | 36,600 | 1,242.00 | 45,457,200 | | |
| 大阪ソーダ | 6,400 | 2,657.00 | 17,004,800 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| 関東電化 | 13,900 | 944.00 | 13,121,600 | | |
| デンカ | 22,900 | 3,660.00 | 83,814,000 | | |
| イビデン | 36,600 | 1,579.00 | 57,791,400 | 貸付株式数 | 14,400株 |
| 信越化学 | 102,900 | 10,135.00 | 1,042,891,500 | 貸付株式数 | 40,600株 |
| 日本カーバイド | 2,000 | 1,937.00 | 3,874,000 | | |
| 堺　化　学 | 3,900 | 2,778.00 | 10,834,200 | | |
| 第一稀元素化学工 | 4,800 | 1,046.00 | 5,020,800 | | |
| エア・ウォーター | 47,500 | 1,837.00 | 87,257,500 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 大陽日酸 | 48,200 | 1,912.00 | 92,158,400 | | |
| 日本化学工業 | 2,000 | 2,748.00 | 5,496,000 | | |
| 東邦アセチレン | 1,000 | 1,436.00 | 1,436,000 | | |
| 日本パーカライジング | 31,700 | 1,487.00 | 47,137,900 | | |
| 高圧ガス | 9,600 | 887.00 | 8,515,200 | | |
| チタン工業 | 800 | 2,571.00 | 2,056,800 | | |
| 四国化成 | 9,900 | 1,246.00 | 12,335,400 | | |
| 戸田工業 | 1,300 | 2,455.00 | 3,191,500 | | |
| ステラ　ケミファ | 3,400 | 3,215.00 | 10,931,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| 保土谷化学 | 2,000 | 2,589.00 | 5,178,000 | | |
| 日本触媒 | 9,800 | 7,570.00 | 74,186,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 大日精化 | 4,900 | 3,320.00 | 16,268,000 | | |
| カネカ | 15,500 | 4,250.00 | 65,875,000 | | |
| 協和発酵キリン | 74,600 | 2,327.00 | 173,594,200 | | |
| 三菱瓦斯化学 | 59,700 | 1,864.00 | 111,280,800 | | |
| 三井化学 | 52,800 | 2,881.00 | 152,116,800 | | |
| ＪＳＲ | 58,300 | 1,817.00 | 105,931,100 | | |
| 東京応化工業 | 10,000 | 3,615.00 | 36,150,000 | | |
| 大阪有機化学 | 5,400 | 1,395.00 | 7,533,000 | 貸付株式数 | 1,700株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 三菱ケミカルＨＬＤＧＳ | 389,200 | 928.60 | 361,411,120 | 貸付株式数 | 161,600株 |
| ＫＨネオケム | 8,900 | 3,045.00 | 27,100,500 | | |
| ダイセル | 90,400 | 1,270.00 | 114,808,000 | | |
| 住友ベークライト | 10,000 | 4,120.00 | 41,200,000 | | |
| 積水化学 | 127,500 | 1,842.00 | 234,855,000 | | |
| 日本ゼオン | 52,600 | 1,154.00 | 60,700,400 | | |
| アイカ工業 | 17,500 | 3,825.00 | 66,937,500 | | |
| 宇部興産 | 29,300 | 2,587.00 | 75,799,100 | | |
| 積水樹脂 | 9,700 | 2,236.00 | 21,689,200 | | |
| タキロンシーアイ | 12,600 | 639.00 | 8,051,400 | | |
| 旭有機材 | 4,000 | 1,851.00 | 7,404,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| 日立化成 | 26,800 | 1,796.00 | 48,132,800 | | |
| ニチバン | 3,000 | 2,262.00 | 6,786,000 | | |
| リケンテクノス | 16,300 | 512.00 | 8,345,600 | 貸付株式数 | 6,400株 |
| 大倉工業 | 2,900 | 2,153.00 | 6,243,700 | | |
| 積水化成品 | 8,700 | 1,081.00 | 9,404,700 | | |
| 群栄化学 | 1,700 | 3,150.00 | 5,355,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| タイガース　ポリマー | 2,800 | 690.00 | 1,932,000 | | |
| ミライアル | 1,600 | 972.00 | 1,555,200 | | |
| ダイキアクシス | 2,000 | 1,181.00 | 2,362,000 | | |
| ダイキョーニシカワ | 12,200 | 1,148.00 | 14,005,600 | | |
| 竹本容器 | 1,000 | 2,783.00 | 2,783,000 | | |
| 森六ホールディングス | 3,200 | 3,015.00 | 9,648,000 | | |
| 日本化薬 | 37,000 | 1,495.00 | 55,315,000 | | |
| カーリットホールディングス | 6,300 | 922.00 | 5,808,600 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| ＥＰＳホールディングス | 8,500 | 2,185.00 | 18,572,500 | | |
| ソルクシーズ | 2,400 | 829.00 | 1,989,600 | | |
| レッグス | 1,500 | 1,105.00 | 1,657,500 | | |
| プレステージ・インター | 10,700 | 1,441.00 | 15,418,700 | | |
| フェイス | 2,300 | 1,193.00 | 2,743,900 | | |
| ハイマックス | 700 | 1,811.00 | 1,267,700 | | |
| アミューズ | 3,400 | 2,737.00 | 9,305,800 | | |
| 野村総合研究所 | 37,300 | 4,985.00 | 185,940,500 | | |
| ドリームインキュベータ | 1,700 | 1,895.00 | 3,221,500 | 貸付株式数 | 800株 |
| サイバネットシステム | 4,800 | 676.00 | 3,244,800 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| クイック | 3,500 | 1,517.00 | 5,309,500 | | |
| ＴＡＣ | 3,100 | 266.00 | 824,600 | | |
| ＣＥホールディングス | 1,500 | 762.00 | 1,143,000 | | |
| ケネディクス | 53,800 | 535.00 | 28,783,000 | | |
| 日本システム技術 | 900 | 1,998.00 | 1,798,200 | 貸付株式数 | 300株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 電通 | 69,500 | 5,060.00 | 351,670,000 | 貸付株式数 | 400株<br>(400株) |
| インテージホールディングス | 7,400 | 1,019.00 | 7,540,600 | | |
| テイクアンドギヴニーズ | 2,200 | 1,929.00 | 4,243,800 | | |
| 東邦システムサイエンス | 1,800 | 905.00 | 1,629,000 | | |
| ぴあ | 1,600 | 5,110.00 | 8,176,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| イオンファンタジー | 1,800 | 3,170.00 | 5,706,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| ソースネクスト | 22,700 | 736.00 | 16,707,200 | | |
| シーティーエス | 6,400 | 757.00 | 4,844,800 | | |
| ネクシィーズグループ | 1,700 | 1,803.00 | 3,065,100 | | |
| メディカルシステムネットワーク | 6,200 | 460.00 | 2,852,000 | | |
| 日本精化 | 4,900 | 1,108.00 | 5,429,200 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| 扶桑化学工業 | 5,900 | 2,374.00 | 14,006,600 | | |
| トリケミカル | 1,300 | 4,490.00 | 5,837,000 | | |
| ＦＩＧ | 5,100 | 405.00 | 2,065,500 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ＡＤＥＫＡ | 28,600 | 1,799.00 | 51,451,400 | | |
| 日油 | 22,500 | 3,750.00 | 84,375,000 | | |
| ミヨシ油脂 | 2,800 | 1,278.00 | 3,578,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 新日本理化 | 11,300 | 189.00 | 2,135,700 | | |
| ハリマ化成グループ | 5,000 | 1,168.00 | 5,840,000 | | |
| 花　王 | 144,800 | 8,358.00 | 1,210,238,400 | | |
| 第一工業製薬 | 2,200 | 2,753.00 | 6,056,600 | 貸付株式数 | 800株 |
| 石原ケミカル | 1,600 | 2,137.00 | 3,419,200 | | |
| 日華化学 | 2,100 | 1,227.00 | 2,576,700 | | |
| ニイタカ | 900 | 1,737.00 | 1,563,300 | 貸付株式数 | 300株 |
| 三洋化成 | 4,000 | 5,620.00 | 22,480,000 | | |
| 武田薬品 | 235,400 | 4,255.00 | 1,001,627,000 | 貸付株式数 | 93,200株<br>(800株) |
| アステラス製薬 | 549,800 | 1,744.50 | 959,126,100 | 貸付株式数 | 217,600株 |
| 大日本住友製薬 | 44,300 | 3,700.00 | 163,910,000 | | |
| 塩野義製薬 | 78,000 | 7,508.00 | 585,624,000 | | |
| 田辺三菱製薬 | 62,000 | 1,743.00 | 108,066,000 | | |
| わかもと製薬 | 7,100 | 298.00 | 2,115,800 | | |
| あすか製薬 | 7,200 | 1,230.00 | 8,856,000 | | |
| 日本新薬 | 15,600 | 7,760.00 | 121,056,000 | | |
| ビオフエルミン製薬 | 1,000 | 2,758.00 | 2,758,000 | | |
| 中外製薬 | 62,200 | 7,770.00 | 483,294,000 | | |
| 科研製薬 | 10,700 | 5,810.00 | 62,167,000 | 貸付株式数 | 2,800株<br>(2,800株) |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| エーザイ | 71,400 | 10,415.00 | 743,631,000 | |
| 理研ビタミン | 2,800 | 3,870.00 | 10,836,000 | |
| ロート製薬 | 30,600 | 3,585.00 | 109,701,000 | |
| 小野薬品 | 140,700 | 2,745.50 | 386,291,850 | |
| 久光製薬 | 17,600 | 7,250.00 | 127,600,000 | |
| 有機合成薬品 | 6,700 | 249.00 | 1,668,300 | |
| 持田製薬 | 4,500 | 10,310.00 | 46,395,000 | |
| 参天製薬 | 112,900 | 1,943.00 | 219,364,700 | |
| 扶桑薬品 | 2,100 | 2,842.00 | 5,968,200 | |
| 日本ケミファ | 800 | 4,135.00 | 3,308,000 | |
| ツムラ | 18,400 | 3,515.00 | 64,676,000 | |
| 日医工 | 14,500 | 1,744.00 | 25,288,000 | |
| テ　ル　モ | 84,400 | 6,685.00 | 564,214,000 | |
| みらかホールディングス | 15,800 | 2,625.00 | 41,475,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 10,500 | 3,510.00 | 36,855,000 | |
| 生化学工業 | 11,500 | 1,560.00 | 17,940,000 | |
| 栄研化学 | 10,400 | 2,605.00 | 27,092,000 | 貸付株式数　3,800株 |
| 日水製薬 | 2,500 | 1,218.00 | 3,045,000 | 貸付株式数　200株 |
| 鳥居薬品 | 3,200 | 2,630.00 | 8,416,000 | 貸付株式数　300株 |
| ＪＣＲファーマ | 4,200 | 5,810.00 | 24,402,000 | |
| 東和薬品 | 2,800 | 8,440.00 | 23,632,000 | 貸付株式数　1,100株 |
| 富士製薬工業 | 4,000 | 1,923.00 | 7,692,000 | |
| 沢井製薬 | 12,100 | 6,000.00 | 72,600,000 | |
| ゼリア新薬工業 | 11,700 | 2,104.00 | 24,616,800 | |
| 第一三共 | 170,700 | 4,167.00 | 711,306,900 | |
| キョーリン製薬ＨＤ | 15,100 | 2,728.00 | 41,192,800 | |
| 大幸薬品 | 2,700 | 2,010.00 | 5,427,000 | 貸付株式数　1,000株 |
| ダイト | 3,400 | 3,420.00 | 11,628,000 | |
| 大塚ホールディングス | 113,700 | 5,535.00 | 629,329,500 | |
| 大正製薬ＨＤ | 13,400 | 13,120.00 | 175,808,000 | |
| ペプチドリーム | 27,400 | 4,650.00 | 127,410,000 | 貸付株式数　10,800株 |
| 大日本塗料 | 7,000 | 1,121.00 | 7,847,000 | 貸付株式数　2,000株 |
| 日本ペイントＨＯＬＤ | 48,200 | 4,025.00 | 194,005,000 | 貸付株式数　19,000株 |
| 関西ペイント | 65,600 | 2,127.00 | 139,531,200 | 貸付株式数　25,900株 |
| 神東塗料 | 7,900 | 184.00 | 1,453,600 | 貸付株式数　1,000株 |
| 中国塗料 | 19,200 | 1,042.00 | 20,006,400 | 貸付株式数　2,000株 |
| 日本特殊塗料 | 4,300 | 1,772.00 | 7,619,600 | |
| 藤倉化成 | 8,700 | 634.00 | 5,515,800 | |
| 太陽ホールディングス | 4,900 | 3,655.00 | 17,909,500 | |
| ＤＩＣ | 26,400 | 3,605.00 | 95,172,000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| サカタインクス | 12,800 | 1,353.00 | 17,318,400 | 貸付株式数 | 5,100株 |
| 東洋インキＳＣホールディン | 12,500 | 2,807.00 | 35,087,500 | | |
| Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ | 5,000 | 1,205.00 | 6,025,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| アルプス技研 | 5,000 | 2,098.00 | 10,490,000 | | |
| サニックス | 10,000 | 231.00 | 2,310,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ダイオーズ | 1,200 | 1,390.00 | 1,668,000 | | |
| 日本空調サービス | 6,300 | 761.00 | 4,794,300 | 貸付株式数 | 600株 |
| オリエンタルランド | 67,400 | 11,295.00 | 761,283,000 | | |
| フォーカスシステムズ | 3,900 | 1,114.00 | 4,344,600 | | |
| ダスキン | 15,200 | 2,617.00 | 39,778,400 | | |
| パーク２４ | 34,300 | 3,065.00 | 105,129,500 | 貸付株式数 | 9,700株 |
| 明光ネットワークジャパン | 7,200 | 1,039.00 | 7,480,800 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| ファルコホールディングス | 3,100 | 1,666.00 | 5,164,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| クレスコ | 1,800 | 3,850.00 | 6,930,000 | | |
| フジ・メディア・ＨＤ | 60,900 | 1,769.00 | 107,732,100 | | |
| 秀英予備校 | 1,500 | 496.00 | 744,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| 田谷 | 1,400 | 649.00 | 908,600 | | |
| ラウンドワン | 17,600 | 1,260.00 | 22,176,000 | | |
| リゾートトラスト | 24,200 | 1,867.00 | 45,181,400 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| オービック | 20,300 | 9,810.00 | 199,143,000 | | |
| ジャストシステム | 8,300 | 2,551.00 | 21,173,300 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| ＴＤＣソフト | 5,100 | 973.00 | 4,962,300 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ヤフー | 380,700 | 325.00 | 123,727,500 | | |
| ビー・エム・エル | 7,300 | 2,885.00 | 21,060,500 | | |
| ワタベウェディング | 1,000 | 1,095.00 | 1,095,000 | | |
| トレンドマイクロ | 31,200 | 6,510.00 | 203,112,000 | 貸付株式数 | 3,900株<br>(3,800株) |
| りらいあコミュニケーショ | 10,200 | 1,061.00 | 10,822,200 | 貸付株式数 | 3,800株<br>(3,800株) |
| インフォメーションディベロ | 1,600 | 1,445.00 | 2,312,000 | | |
| リソー教育 | 28,800 | 390.00 | 11,232,000 | | |
| 日本オラクル | 9,500 | 7,370.00 | 70,015,000 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| 早稲田アカデミー | 800 | 2,295.00 | 1,836,000 | | |
| アルファシステムズ | 1,900 | 2,666.00 | 5,065,400 | | |
| フューチャー | 8,000 | 1,753.00 | 14,024,000 | | |
| ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 4,400 | 1,074.00 | 4,725,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ソフトバンク・テクノ | 2,500 | 2,118.00 | 5,295,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| トーセ | 1,600 | 938.00 | 1,500,800 | 貸付株式数 | 600株 |
| ユー・エス・エス | 69,600 | 2,014.00 | 140,174,400 | | |
| オービックビジネスＣ | 3,000 | 9,940.00 | 29,820,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 伊藤忠テクノソリュー | 26,700 | 2,189.00 | 58,446,300 | | |
| アイティフォー | 7,000 | 855.00 | 5,985,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 東京個別指導学院 | 2,000 | 1,333.00 | 2,666,000 | | |
| 東計電算 | 900 | 3,395.00 | 3,055,500 | | |
| サイバーエージェント | 35,100 | 5,140.00 | 180,414,000 | 貸付株式数 | 9,500株 |
| 楽天 | 265,800 | 914.00 | 242,941,200 | | |
| エックスネット | 1,100 | 916.00 | 1,007,600 | | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 3,300 | 1,186.00 | 3,913,800 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| テー・オー・ダブリュー | 5,400 | 896.00 | 4,838,400 | | |
| 大塚商会 | 31,700 | 3,820.00 | 121,094,000 | | |
| サイボウズ | 6,800 | 700.00 | 4,760,000 | | |
| ソフトブレーン | 4,500 | 528.00 | 2,376,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| セントラルスポーツ | 2,100 | 3,790.00 | 7,959,000 | | |
| パラカ | 1,500 | 1,936.00 | 2,904,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 電通国際情報Ｓ | 3,600 | 3,840.00 | 13,824,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| デジタルガレージ | 11,400 | 3,105.00 | 35,397,000 | 貸付株式数 | 4,500株 |
| イーエムシステムズ | 4,700 | 1,172.00 | 5,508,400 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| ウェザーニューズ | 1,900 | 3,215.00 | 6,108,500 | 貸付株式数 | 700株<br>(700株) |
| ＣＩＪ | 4,500 | 753.00 | 3,388,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 東洋ビジネスエンジ | 600 | 2,210.00 | 1,326,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| 日本エンタープライズ | 5,700 | 230.00 | 1,311,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| WOWOW | 2,800 | 3,320.00 | 9,296,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| スカラ | 4,700 | 843.00 | 3,962,100 | | |
| フルキャストホールディングス | 5,700 | 2,311.00 | 13,172,700 | | |
| エン・ジャパン | 6,200 | 4,580.00 | 28,396,000 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| 富士フイルムＨＬＤＧＳ | 123,900 | 4,510.00 | 558,789,000 | | |
| コニカミノルタ | 130,300 | 1,022.00 | 133,166,600 | | |
| 資　生　堂 | 118,600 | 7,224.00 | 856,766,400 | 貸付株式数 | 6,500株 |
| ライオン | 83,000 | 2,239.00 | 185,837,000 | | |
| 高砂香料 | 4,100 | 3,890.00 | 15,949,000 | | |
| マンダム | 13,400 | 3,330.00 | 44,622,000 | 貸付株式数 | 2,900株<br>(2,900株) |
| ミルボン | 7,400 | 4,920.00 | 36,408,000 | | |
| ファンケル | 26,600 | 2,962.00 | 78,789,200 | | |
| コーセー | 10,100 | 16,930.00 | 170,993,000 | | |
| コタ | 2,800 | 1,566.00 | 4,384,800 | | |
| シーズ・ホールディングス | 7,400 | 5,860.00 | 43,364,000 | | |
| シーボン | 700 | 2,712.00 | 1,898,400 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ポーラ・オルビスＨＤ | 25,400 | 3,205.00 | 81,407,000 | | |
| ノエビアホールディングス | 3,800 | 5,290.00 | 20,102,000 | | |
| アジュバンコスメジャパン | 1,300 | 1,027.00 | 1,335,100 | 貸付株式数 | 500株 |
| エステー | 4,200 | 2,182.00 | 9,164,400 | | |
| アグロカネショウ | 2,400 | 2,468.00 | 5,923,200 | | |
| コ　ニ　シ | 10,600 | 1,873.00 | 19,853,800 | | |
| 長谷川香料 | 7,200 | 1,568.00 | 11,289,600 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 星光ＰＭＣ | 4,300 | 916.00 | 3,938,800 | | |
| 小林製薬 | 16,700 | 7,900.00 | 131,930,000 | 貸付株式数 | 4,300株<br>(4,300株) |
| 荒川化学工業 | 5,400 | 1,631.00 | 8,807,400 | 貸付株式数 | 200株 |
| メック | 4,100 | 1,340.00 | 5,494,000 | 貸付株式数 | 1,500株<br>(1,500株) |
| 日本高純度化学 | 2,000 | 2,387.00 | 4,774,000 | | |
| タカラバイオ | 15,600 | 2,838.00 | 44,272,800 | | |
| ＪＣＵ | 7,700 | 1,848.00 | 14,229,600 | | |
| 新田ゼラチン | 3,700 | 747.00 | 2,763,900 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ＯＡＴアグリオ | 800 | 2,239.00 | 1,791,200 | | |
| デクセリアルズ | 15,400 | 991.00 | 15,261,400 | 貸付株式数 | 300株 |
| アース製薬 | 4,500 | 5,590.00 | 25,155,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| 北興化学 | 6,500 | 558.00 | 3,627,000 | | |
| 大成ラミック | 1,900 | 3,090.00 | 5,871,000 | | |
| クミアイ化学 | 24,600 | 726.00 | 17,859,600 | | |
| 日本農薬 | 14,600 | 558.00 | 8,146,800 | | |
| 昭和シエル石油 | 55,400 | 1,759.00 | 97,448,600 | | |
| 富士興産 | 2,200 | 629.00 | 1,383,800 | | |
| ニチレキ | 7,500 | 1,144.00 | 8,580,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ユシロ化学 | 3,000 | 1,356.00 | 4,068,000 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| ビーピー・カストロール | 2,100 | 1,505.00 | 3,160,500 | 貸付株式数 | 800株 |
| 富士石油 | 14,100 | 340.00 | 4,794,000 | | |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 2,400 | 1,664.00 | 3,993,600 | | |
| 出光興産 | 46,200 | 4,130.00 | 190,806,000 | 貸付株式数 | 18,100株<br>(18,100株) |
| ＪＸＴＧホールディングス | 1,008,300 | 686.30 | 691,996,290 | | |
| コスモエネルギーＨＬＤＧＳ | 17,200 | 2,649.00 | 45,562,800 | 貸付株式数 | 6,800株<br>(4,500株) |
| 横浜ゴム | 34,600 | 2,376.00 | 82,209,600 | | |
| 東洋ゴム | 30,600 | 1,793.00 | 54,865,800 | | |
| ブリヂストン | 183,400 | 4,600.00 | 843,640,000 | | |
| 住友ゴム | 53,600 | 1,517.00 | 81,311,200 | 貸付株式数 | 3,800株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 藤倉ゴム | 4,900 | 512.00 | 2,508,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| オカモト | 4,200 | 5,970.00 | 25,074,000 | | |
| アキレス | 4,200 | 2,256.00 | 9,475,200 | | |
| フ　コ　ク | 2,500 | 931.00 | 2,327,500 | | |
| ニッタ | 6,700 | 3,910.00 | 26,197,000 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| クリエートメディック | 1,800 | 1,101.00 | 1,981,800 | | |
| 住友理工 | 11,700 | 1,112.00 | 13,010,400 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| 三ツ星ベルト | 7,800 | 2,461.00 | 19,195,800 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| バンドー化学 | 11,400 | 1,233.00 | 14,056,200 | | |
| ＡＧＣ | 59,700 | 3,855.00 | 230,143,500 | | |
| 日本板硝子 | 28,300 | 968.00 | 27,394,400 | | |
| 石塚硝子 | 800 | 2,149.00 | 1,719,200 | 貸付株式数 | 300株 |
| 有沢製作所 | 9,300 | 821.00 | 7,635,300 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| 日本山村硝子 | 2,300 | 1,782.00 | 4,098,600 | | |
| 日本電気硝子 | 25,800 | 3,050.00 | 78,690,000 | | |
| オハラ | 2,400 | 2,389.00 | 5,733,600 | 貸付株式数 | 900株 |
| 住友大阪セメント | 12,000 | 5,100.00 | 61,200,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| 太平洋セメント | 37,700 | 3,840.00 | 144,768,000 | | |
| リソルホールディングス | 600 | 4,035.00 | 2,421,000 | | |
| 日本ヒユーム | 5,900 | 960.00 | 5,664,000 | | |
| 日本コンクリート | 12,700 | 308.00 | 3,911,600 | | |
| 三谷セキサン | 2,800 | 2,841.00 | 7,954,800 | | |
| アジアパイルＨＤ | 8,300 | 694.00 | 5,760,200 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| 東海カーボン | 54,100 | 1,576.00 | 85,261,600 | 貸付株式数 | 21,400株 |
| 日本カーボン | 2,800 | 5,420.00 | 15,176,000 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| 東洋炭素 | 3,500 | 2,737.00 | 9,579,500 | | |
| ノリタケ | 3,600 | 5,630.00 | 20,268,000 | | |
| ＴＯＴＯ | 45,900 | 4,395.00 | 201,730,500 | 貸付株式数 | 18,100株 |
| 日本碍子 | 72,500 | 1,683.00 | 122,017,500 | | |
| 日本特殊陶業 | 50,400 | 2,332.00 | 117,532,800 | | |
| ダントーホールディングス | 5,600 | 127.00 | 711,200 | | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 2,000 | 6,420.00 | 12,840,000 | | |
| 品川リフラクトリーズ | 1,600 | 4,305.00 | 6,888,000 | | |
| 黒崎播磨 | 1,200 | 6,750.00 | 8,100,000 | 貸付株式数 | 400株<br>(400株) |
| ヨータイ | 5,100 | 686.00 | 3,498,600 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| イソライト | 3,000 | 547.00 | 1,641,000 | | |
| 東京窯業 | 7,500 | 466.00 | 3,495,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ニッカトー | 2,700 | 1,079.00 | 2,913,300 | | |
| フジミインコーポレーテッド | 5,300 | 2,436.00 | 12,910,800 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| クニミネ工業 | 2,000 | 983.00 | 1,966,000 | |
| エーアンドエーマテリアル | 1,100 | 1,143.00 | 1,257,300 | |
| ニチアス | 16,300 | 2,203.00 | 35,908,900 | |
| 新日鐵住金 | 263,900 | 2,076.00 | 547,856,400 | |
| 神戸製鋼所 | 108,100 | 934.00 | 100,965,400 | |
| 中山製鋼所 | 7,700 | 585.00 | 4,504,500 | |
| 合同製鐵 | 2,800 | 1,946.00 | 5,448,800 | |
| ＪＦＥホールディングス | 159,200 | 2,001.50 | 318,638,800 | |
| 日新製鋼 | 14,400 | 1,465.00 | 21,096,000 | |
| 東京製鐵 | 31,500 | 978.00 | 30,807,000 | |
| 共英製鋼 | 6,700 | 2,200.00 | 14,740,000 | 貸付株式数 2,600株 |
| 大和工業 | 12,500 | 2,968.00 | 37,100,000 | |
| 東京鐵鋼 | 2,300 | 1,371.00 | 3,153,300 | 貸付株式数 600株 |
| 大阪製鐵 | 4,000 | 2,001.00 | 8,004,000 | |
| 淀川製鋼所 | 7,900 | 2,429.00 | 19,189,100 | 貸付株式数 2,000株 |
| 丸一鋼管 | 20,900 | 3,370.00 | 70,433,000 | |
| モリ工業 | 1,700 | 2,716.00 | 4,617,200 | |
| 大同特殊鋼 | 9,600 | 4,595.00 | 44,112,000 | |
| 日本高周波 | 2,000 | 686.00 | 1,372,000 | |
| 日本冶金工 | 48,700 | 282.00 | 13,733,400 | 貸付株式数 19,900株 |
| 山陽特殊製鋼 | 7,400 | 2,580.00 | 19,092,000 | |
| 愛知製鋼 | 3,300 | 3,995.00 | 13,183,500 | |
| 日立金属 | 63,600 | 1,278.00 | 81,280,800 | 貸付株式数 3,000株 |
| 日本金属 | 1,400 | 1,397.00 | 1,955,800 | |
| 大平洋金属 | 4,000 | 3,320.00 | 13,280,000 | 貸付株式数 1,400株 |
| 新日本電工 | 35,000 | 268.00 | 9,380,000 | 貸付株式数 13,900株 |
| 栗本鉄工所 | 2,900 | 1,645.00 | 4,770,500 | |
| 虹　技 | 700 | 1,601.00 | 1,120,700 | |
| 日本鋳鉄管 | 500 | 1,274.00 | 637,000 | 貸付株式数 200株 |
| 日本製鋼所 | 17,900 | 2,074.00 | 37,124,600 | |
| 三菱製鋼 | 4,300 | 2,029.00 | 8,724,700 | |
| 日亜鋼業 | 8,400 | 337.00 | 2,830,800 | |
| 日本精線 | 800 | 3,510.00 | 2,808,000 | 貸付株式数 200株 |
| エンビプロＨＤ | 1,200 | 582.00 | 698,400 | |
| 大紀アルミニウム | 9,600 | 651.00 | 6,249,600 | 貸付株式数 4,600株 |
| 日本軽金属ＨＤ | 159,700 | 254.00 | 40,563,800 | |
| 三井金属 | 15,900 | 2,593.00 | 41,228,700 | |
| 東邦亜鉛 | 3,200 | 3,830.00 | 12,256,000 | |
| 三菱マテリアル | 39,000 | 3,185.00 | 124,215,000 | |
| 住友鉱山 | 80,800 | 3,305.00 | 267,044,000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ＤＯＷＡホールディングス | 13,800 | 3,740.00 | 51,612,000 | 貸付株式数 | 4,700株 |
| 古河機金 | 9,700 | 1,439.00 | 13,958,300 | 貸付株式数 | 3,900株 |
| エス・サイエンス | 26,400 | 69.00 | 1,821,600 | | |
| 大阪チタニウム | 6,900 | 2,119.00 | 14,621,100 | 貸付株式数 | 2,500株<br>(1,800株) |
| 東邦チタニウム | 10,600 | 1,395.00 | 14,787,000 | | |
| ＵＡＣＪ | 8,900 | 2,377.00 | 21,155,300 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| ＣＫサンエツ | 1,100 | 2,760.00 | 3,036,000 | | |
| 古河電工 | 17,000 | 3,315.00 | 56,355,000 | | |
| 住友電工 | 220,500 | 1,592.50 | 351,146,250 | | |
| フジクラ | 70,700 | 493.00 | 34,855,100 | | |
| 昭和電線ＨＬＤＧＳ | 6,800 | 697.00 | 4,739,600 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| 東京特殊電線 | 700 | 1,961.00 | 1,372,700 | | |
| タツタ電線 | 11,600 | 537.00 | 6,229,200 | | |
| カナレ電気 | 1,000 | 2,028.00 | 2,028,000 | | |
| 平河ヒューテック | 2,400 | 1,324.00 | 3,177,600 | | |
| リョービ | 7,200 | 3,095.00 | 22,284,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| アーレステイ | 7,200 | 730.00 | 5,256,000 | | |
| アサヒＨＤ | 11,000 | 2,351.00 | 25,861,000 | | |
| 東洋製罐グループＨＤ | 37,800 | 2,585.00 | 97,713,000 | | |
| ホッカンホールディングス | 2,900 | 1,717.00 | 4,979,300 | | |
| コロナ | 3,200 | 1,141.00 | 3,651,200 | | |
| 横河ブリッジＨＬＤＧＳ | 10,900 | 1,860.00 | 20,274,000 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| ＯＳＪＢ　ＨＤ | 29,000 | 338.00 | 9,802,000 | | |
| 駒井ハルテック | 1,100 | 2,177.00 | 2,394,700 | | |
| 高田機工 | 500 | 2,751.00 | 1,375,500 | | |
| 三和ホールディングス | 60,900 | 1,378.00 | 83,920,200 | | |
| 文化シヤッター | 17,200 | 784.00 | 13,484,800 | | |
| 三協立山 | 8,200 | 1,317.00 | 10,799,400 | | |
| アルインコ | 4,700 | 1,099.00 | 5,165,300 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 東洋シヤッター | 1,400 | 681.00 | 953,400 | | |
| ＬＩＸＩＬグループ | 87,000 | 1,471.00 | 127,977,000 | | |
| 日本フイルコン | 4,400 | 592.00 | 2,604,800 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| ノーリツ | 13,200 | 1,688.00 | 22,281,600 | | |
| 長府製作所 | 6,000 | 2,388.00 | 14,328,000 | | |
| リンナイ | 10,500 | 8,140.00 | 85,470,000 | | |
| ユニプレス | 11,500 | 2,138.00 | 24,587,000 | | |
| ダイニチ工業 | 3,100 | 745.00 | 2,309,500 | | |
| 日東精工 | 8,000 | 643.00 | 5,144,000 | | |
| 三洋工業 | 700 | 2,047.00 | 1,432,900 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 岡　部 | 11,800 | 990.00 | 11,682,000 | | |
| ジーテクト | 6,400 | 1,591.00 | 10,182,400 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| 中国工業 | 900 | 595.00 | 535,500 | | |
| 東　プ　レ | 10,900 | 2,312.00 | 25,200,800 | | |
| 高周波熱錬 | 11,300 | 1,024.00 | 11,571,200 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| 東京製綱 | 3,600 | 1,153.00 | 4,150,800 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| サンコール | 3,200 | 722.00 | 2,310,400 | | |
| モリテックスチル | 4,500 | 476.00 | 2,142,000 | | |
| パイオラックス | 9,500 | 2,780.00 | 26,410,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| エイチワン | 5,800 | 1,100.00 | 6,380,000 | | |
| 日本発条 | 58,700 | 1,010.00 | 59,287,000 | | |
| 中央発條 | 600 | 3,470.00 | 2,082,000 | | |
| アドバネクス | 700 | 1,588.00 | 1,111,600 | | |
| 三浦工業 | 25,600 | 3,025.00 | 77,440,000 | | |
| タ　ク　マ | 21,600 | 1,595.00 | 34,452,000 | | |
| テクノプロ・ホールディング | 10,700 | 5,680.00 | 60,776,000 | | |
| アトラ | 1,200 | 505.00 | 606,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| インターワークス | 1,100 | 759.00 | 834,900 | | |
| アイ・アールジャパンＨＤ | 1,800 | 1,456.00 | 2,620,800 | 貸付株式数 | 700株 |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 1,900 | 1,117.00 | 2,122,300 | | |
| ファーストロジック | 1,100 | 875.00 | 962,500 | | |
| 三機サービス | 900 | 1,862.00 | 1,675,800 | | |
| Ｇｕｎｏｓｙ | 3,500 | 3,380.00 | 11,830,000 | | |
| デザインワン・ジャパン | 1,200 | 436.00 | 523,200 | | |
| イー・ガーディアン | 2,700 | 2,675.00 | 7,222,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| リブセンス | 3,100 | 339.00 | 1,050,900 | | |
| ジャパンマテリアル | 15,600 | 1,314.00 | 20,498,400 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| ベクトル | 6,900 | 1,840.00 | 12,696,000 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| ウチヤマホールディングス | 3,000 | 488.00 | 1,464,000 | | |
| ライクキッズネクスト | 1,200 | 1,194.00 | 1,432,800 | | |
| キャリアリンク | 2,100 | 444.00 | 932,400 | | |
| ＩＢＪ | 3,800 | 809.00 | 3,074,200 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| アサンテ | 2,200 | 2,278.00 | 5,011,600 | 貸付株式数 | 800株 |
| Ｎ・フィールド | 3,600 | 1,154.00 | 4,154,400 | 貸付株式数 | 1,200株<br>(100株) |
| バリューＨＲ | 1,200 | 2,074.00 | 2,488,800 | | |
| Ｍ＆Ａキャピタルパートナー | 1,400 | 4,265.00 | 5,971,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| ライドオンエクスプレスＨＤ | 2,400 | 1,572.00 | 3,772,800 | | |
| ＥＲＩホールディングス | 1,600 | 925.00 | 1,480,000 | | |
| アビスト | 900 | 3,530.00 | 3,177,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| シグマクシス | 2,700 | 1,076.00 | 2,905,200 | | |
| ウィルグループ | 3,700 | 1,181.00 | 4,369,700 | | |
| エスクローＡＪ | 7,700 | 465.00 | 3,580,500 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 日本ビューホテル | 1,800 | 1,199.00 | 2,158,200 | | |
| リクルートホールディングス | 408,400 | 3,123.00 | 1,275,433,200 | | |
| エラン | 2,000 | 3,000.00 | 6,000,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| ツ　ガ　ミ | 13,100 | 852.00 | 11,161,200 | | |
| オークマ | 7,500 | 5,650.00 | 42,375,000 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| 東芝機械 | 6,600 | 1,984.00 | 13,094,400 | | |
| アマダホールディングス | 91,300 | 1,232.00 | 112,481,600 | | |
| アイダエンジニア | 16,200 | 909.00 | 14,725,800 | | |
| 滝澤鉄工所 | 1,700 | 1,615.00 | 2,745,500 | | |
| ＦＵＪＩ | 17,600 | 1,493.00 | 26,276,800 | | |
| 牧野フライス | 6,900 | 4,605.00 | 31,774,500 | | |
| オーエスジー | 29,000 | 2,279.00 | 66,091,000 | | |
| ダイジェット | 600 | 1,860.00 | 1,116,000 | | |
| 旭ダイヤモンド | 15,300 | 702.00 | 10,740,600 | | |
| ＤＭＧ森精機 | 37,200 | 1,590.00 | 59,148,000 | 貸付株式数 | 13,800株 |
| ソデイツク | 12,800 | 838.00 | 10,726,400 | 貸付株式数 | 5,100株 |
| ディスコ | 8,000 | 16,550.00 | 132,400,000 | | |
| 日東工器 | 3,300 | 2,510.00 | 8,283,000 | | |
| 日進工具 | 1,700 | 2,651.00 | 4,506,700 | 貸付株式数 | 100株 |
| パンチ工業 | 4,100 | 622.00 | 2,550,200 | | |
| 冨士ダイス | 2,500 | 785.00 | 1,962,500 | | |
| 土木管理総合試験 | 2,500 | 608.00 | 1,520,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| 日本郵政 | 464,000 | 1,382.00 | 641,248,000 | 貸付株式数 | 184,800株 |
| ベルシステム２４ＨＬＤＧＳ | 9,600 | 1,507.00 | 14,467,200 | | |
| 鎌倉新書 | 4,200 | 1,254.00 | 5,266,800 | | |
| 一蔵 | 700 | 713.00 | 499,100 | | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 1,300 | 1,910.00 | 2,483,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| グローバルグループ | 700 | 1,182.00 | 827,400 | | |
| エボラブルアジア | 1,600 | 2,259.00 | 3,614,400 | | |
| アトラエ | 1,100 | 2,400.00 | 2,640,000 | | |
| ストライク | 1,400 | 2,929.00 | 4,100,600 | 貸付株式数 | 500株 |
| ソラスト | 13,900 | 1,436.00 | 19,960,400 | | |
| セラク | 1,300 | 717.00 | 932,100 | | |
| インソース | 1,900 | 2,471.00 | 4,694,900 | 貸付株式数 | 700株 |
| 豊田自動織機 | 48,300 | 5,820.00 | 281,106,000 | | |
| 豊和工業 | 3,200 | 864.00 | 2,764,800 | 貸付株式数 | 900株<br>(900株) |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ＯＫＫ | 2,300 | 909.00 | 2,090,700 | | |
| 石川製作所 | 1,400 | 1,498.00 | 2,097,200 | 貸付株式数 | 400株 |
| 東洋機械金属 | 4,200 | 604.00 | 2,536,800 | | |
| 津田駒工業 | 1,200 | 2,216.00 | 2,659,200 | | |
| エンシュウ | 1,500 | 1,323.00 | 1,984,500 | 貸付株式数 | 600株 |
| 島精機製作所 | 8,100 | 3,515.00 | 28,471,500 | 貸付株式数 | 3,200株<br>(100株) |
| オプトラン | 5,800 | 2,459.00 | 14,262,200 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ＮＣホールディングス | 1,800 | 574.00 | 1,033,200 | | |
| フリュー | 4,700 | 1,025.00 | 4,817,500 | | |
| ヤマシンフィルタ | 10,300 | 905.00 | 9,321,500 | 貸付株式数 | 4,000株<br>(1,700株) |
| 日阪製作所 | 7,200 | 953.00 | 6,861,600 | | |
| やまびこ | 11,300 | 1,298.00 | 14,667,400 | | |
| 平田機工 | 2,800 | 6,040.00 | 16,912,000 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| ペガサスミシン製造 | 5,500 | 831.00 | 4,570,500 | | |
| タツモ | 1,800 | 898.00 | 1,616,400 | 貸付株式数 | 700株 |
| ナブテスコ | 32,500 | 3,140.00 | 102,050,000 | | |
| 三井海洋開発 | 6,300 | 2,825.00 | 17,797,500 | | |
| レオン自動機 | 5,800 | 1,822.00 | 10,567,600 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ＳＭＣ | 17,500 | 38,480.00 | 673,400,000 | | |
| 新川 | 4,400 | 513.00 | 2,257,200 | | |
| ホソカワミクロン | 2,000 | 5,170.00 | 10,340,000 | | |
| ユニオンツール | 2,600 | 3,630.00 | 9,438,000 | | |
| オイレス工業 | 8,300 | 1,997.00 | 16,575,100 | 貸付株式数 | 200株 |
| 日精エーエスビー | 1,700 | 4,065.00 | 6,910,500 | 貸付株式数 | 700株 |
| サトーホールディングス | 7,100 | 2,995.00 | 21,264,500 | | |
| 技研製作所 | 4,100 | 4,140.00 | 16,974,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 日本エアーテック | 1,800 | 691.00 | 1,243,800 | | |
| カ　ワ　タ | 1,200 | 1,756.00 | 2,107,200 | 貸付株式数 | 400株 |
| 日精樹脂工業 | 4,800 | 1,021.00 | 4,900,800 | | |
| オカダアイヨン | 2,000 | 1,718.00 | 3,436,000 | | |
| ワイエイシイホールディングス | 2,300 | 739.00 | 1,699,700 | 貸付株式数 | 900株 |
| 小松製作所 | 270,100 | 3,033.00 | 819,213,300 | 貸付株式数 | 106,800株<br>(102,200株) |
| 住友重機械 | 34,100 | 3,765.00 | 128,386,500 | | |
| 日立建機 | 23,900 | 3,135.00 | 74,926,500 | | |
| 日　工 | 1,600 | 2,505.00 | 4,008,000 | | |
| 巴工業 | 2,400 | 2,366.00 | 5,678,400 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 井関農機 | 5,900 | 1,847.00 | 10,897,300 | | |
| ＴＯＷＡ | 5,000 | 741.00 | 3,705,000 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| 丸山製作所 | 1,200 | 1,638.00 | 1,965,600 | | |
| 北川鉄工所 | 2,600 | 2,573.00 | 6,689,800 | | |
| シンニッタン | 9,100 | 413.00 | 3,758,300 | | |
| ローツェ | 2,600 | 1,859.00 | 4,833,400 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| タカキタ | 2,000 | 667.00 | 1,334,000 | | |
| クボタ | 320,100 | 1,937.00 | 620,033,700 | 貸付株式数 | 37,700株 |
| 荏原実業 | 1,600 | 2,005.00 | 3,208,000 | | |
| 東洋エンジニア | 7,700 | 874.00 | 6,729,800 | 貸付株式数 | 3,500株<br>(1,300株) |
| 三菱化工機 | 1,900 | 1,731.00 | 3,288,900 | 貸付株式数 | 100株 |
| 月島機械 | 11,800 | 1,330.00 | 15,694,000 | | |
| 帝国電機製作所 | 4,200 | 1,656.00 | 6,955,200 | | |
| 東京機械 | 2,400 | 441.00 | 1,058,400 | | |
| 新東工業 | 14,100 | 980.00 | 13,818,000 | | |
| 渋谷工業 | 5,300 | 4,135.00 | 21,915,500 | | |
| アイチ　コーポレーション | 10,000 | 657.00 | 6,570,000 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| 小森コーポレーション | 16,400 | 1,252.00 | 20,532,800 | | |
| 鶴見製作所 | 4,700 | 1,988.00 | 9,343,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 住友精密 | 900 | 3,515.00 | 3,163,500 | | |
| 酒井重工業 | 1,100 | 2,694.00 | 2,963,400 | | |
| 荏原製作所 | 26,400 | 2,944.00 | 77,721,600 | | |
| 石井鉄工所 | 1,100 | 1,884.00 | 2,072,400 | | |
| 酉島製作所 | 5,900 | 1,042.00 | 6,147,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 北越工業 | 6,100 | 1,262.00 | 7,698,200 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 千代田化工建 | 47,600 | 322.00 | 15,327,200 | 貸付株式数 | 19,000株 |
| ダイキン工業 | 81,200 | 12,610.00 | 1,023,932,000 | 貸付株式数 | 32,100株 |
| オルガノ | 2,100 | 3,140.00 | 6,594,000 | | |
| トーヨーカネツ | 2,200 | 2,414.00 | 5,310,800 | | |
| 栗田工業 | 32,200 | 3,045.00 | 98,049,000 | | |
| 椿本チエイン | 7,800 | 4,245.00 | 33,111,000 | | |
| 大同工業 | 2,700 | 1,076.00 | 2,905,200 | | |
| 日　機　装 | 19,400 | 1,132.00 | 21,960,800 | | |
| 木村化工機 | 4,700 | 450.00 | 2,115,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 新興プランテック | 12,100 | 1,154.00 | 13,963,400 | | |
| アネスト岩田 | 9,400 | 1,232.00 | 11,580,800 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| ダイフク | 32,800 | 5,810.00 | 190,568,000 | 貸付株式数 | 13,000株 |
| サムコ | 1,600 | 1,310.00 | 2,096,000 | | |
| 加藤製作所 | 3,000 | 3,035.00 | 9,105,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 油研工業 | 1,000 | 2,045.00 | 2,045,000 | | |
| タダノ | 28,800 | 1,361.00 | 39,196,800 | 貸付株式数 | 11,300株 |
| フジテック | 21,700 | 1,394.00 | 30,249,800 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| ＣＫＤ | 16,500 | 1,141.00 | 18,826,500 | 貸付株式数 | 6,600株 |
| キトー | 4,500 | 1,871.00 | 8,419,500 | | |
| 平和 | 16,700 | 2,418.00 | 40,380,600 | | |
| 理想科学工業 | 5,200 | 1,938.00 | 10,077,600 | | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 15,100 | 4,540.00 | 68,554,000 | | |
| 日本金銭機械 | 6,500 | 1,128.00 | 7,332,000 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| マースグループＨＬＤＧＳ | 3,700 | 2,344.00 | 8,672,800 | 貸付株式数 | 600株 |
| 福島工業 | 3,800 | 4,375.00 | 16,625,000 | | |
| オーイズミ | 2,800 | 519.00 | 1,453,200 | | |
| ダイコク電機 | 2,700 | 1,701.00 | 4,592,700 | | |
| 竹内製作所 | 9,900 | 2,285.00 | 22,621,500 | | |
| ア　マ　ノ | 17,000 | 2,448.00 | 41,616,000 | | |
| ＪＵＫＩ | 8,300 | 1,515.00 | 12,574,500 | | |
| サンデンホールディングス | 7,200 | 880.00 | 6,336,000 | | |
| 蛇の目ミシン | 5,300 | 567.00 | 3,005,100 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ブラザー工業 | 77,700 | 1,897.00 | 147,396,900 | | |
| マックス | 9,100 | 1,492.00 | 13,577,200 | | |
| モリタホールディングス | 10,400 | 2,238.00 | 23,275,200 | | |
| グローリー | 16,400 | 2,871.00 | 47,084,400 | | |
| 新晃工業 | 5,700 | 1,650.00 | 9,405,000 | | |
| 大和冷機工業 | 9,100 | 1,314.00 | 11,957,400 | | |
| セガサミーホールディングス | 59,200 | 1,602.00 | 94,838,400 | | |
| 日本ピストンリング | 2,100 | 2,086.00 | 4,380,600 | | |
| リ　ケ　ン | 2,800 | 5,660.00 | 15,848,000 | | |
| ＴＰＲ | 8,000 | 2,699.00 | 21,592,000 | | |
| ツバキ・ナカシマ | 8,900 | 1,933.00 | 17,203,700 | 貸付株式数 | 1,700株<br>(1,700株) |
| ホシザキ | 17,400 | 8,810.00 | 153,294,000 | | |
| 大豊工業 | 4,800 | 1,115.00 | 5,352,000 | | |
| 日本精工 | 122,300 | 1,067.00 | 130,494,100 | | |
| Ｎ　Ｔ　Ｎ | 128,100 | 381.00 | 48,806,100 | | |
| ジェイテクト | 57,200 | 1,444.00 | 82,596,800 | | |
| 不　二　越 | 5,500 | 4,850.00 | 26,675,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ミネベアミツミ | 110,700 | 1,842.00 | 203,909,400 | | |
| 日本トムソン | 17,600 | 628.00 | 11,052,800 | 貸付株式数 | 7,800株 |
| Ｔ　Ｈ　Ｋ | 37,000 | 2,601.00 | 96,237,000 | | |
| ユーシン精機 | 4,700 | 1,174.00 | 5,517,800 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 前澤給装工業 | 2,300 | 1,933.00 | 4,445,900 | | |
| イーグル工業 | 7,200 | 1,489.00 | 10,720,800 | 貸付株式数 | 2,300株 |
| 前澤工業 | 4,200 | 386.00 | 1,621,200 | 貸付株式数 | 1,600株 |
| 日本ピラー工業 | 6,000 | 1,538.00 | 9,228,000 | | |
| キッツ | 24,200 | 972.00 | 23,522,400 | | |
| 日　立 | 268,000 | 3,288.00 | 881,184,000 | 貸付株式数 | 106,000株 |
| 三菱電機 | 595,400 | 1,498.00 | 891,909,200 | 貸付株式数 | 235,200株 |
| 富士電機 | 38,400 | 3,565.00 | 136,896,000 | | |
| 東洋電機製造 | 2,700 | 1,534.00 | 4,141,800 | 貸付株式数 | 600株 |
| 安川電機 | 69,200 | 3,540.00 | 244,968,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| シンフォニア　テクノロジー | 8,300 | 1,689.00 | 14,018,700 | | |
| 明　電　舎 | 12,200 | 1,606.00 | 19,593,200 | | |
| オリジン電気 | 1,600 | 1,932.00 | 3,091,200 | | |
| 山洋電気 | 2,800 | 4,360.00 | 12,208,000 | | |
| デンヨー | 6,000 | 1,604.00 | 9,624,000 | | |
| アイモバイル | 1,300 | 701.00 | 911,300 | | |
| キャリアインデックス | 2,000 | 2,117.00 | 4,234,000 | | |
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 2,300 | 1,562.00 | 3,592,600 | 貸付株式数 | 900株 |
| 船場 | 900 | 967.00 | 870,300 | | |
| グレイステクノロジー | 1,500 | 2,151.00 | 3,226,500 | 貸付株式数 | 600株 |
| ジャパンエレベーターＳＨＤ | 3,400 | 2,125.00 | 7,225,000 | | |
| フルテック | 700 | 1,172.00 | 820,400 | 貸付株式数 | 200株 |
| グリーンズ | 1,200 | 1,542.00 | 1,850,400 | | |
| ツナグ・ソリューションズ | 500 | 732.00 | 366,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| 日総工産 | 1,400 | 1,965.00 | 2,751,000 | 貸付株式数 | 500株<br>(500株) |
| キュービーネットＨＬＤＧＳ | 2,900 | 2,219.00 | 6,435,100 | | |
| 三桜工業 | 7,500 | 648.00 | 4,860,000 | | |
| マキタ | 72,600 | 4,455.00 | 323,433,000 | | |
| 東芝テック | 7,400 | 3,065.00 | 22,681,000 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| 芝浦メカトロニクス | 1,000 | 4,060.00 | 4,060,000 | | |
| マブチモーター | 16,400 | 3,955.00 | 64,862,000 | 貸付株式数 | 6,500株 |
| 日本電産 | 71,800 | 15,120.00 | 1,085,616,000 | 貸付株式数 | 28,400株 |
| ユーエムシーエレクトロニクス | 3,200 | 2,491.00 | 7,971,200 | | |
| トレックス・セミコンダクター | 2,000 | 1,559.00 | 3,118,000 | | |
| 東光高岳 | 3,500 | 1,582.00 | 5,537,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ダブル・スコープ | 8,700 | 1,379.00 | 11,997,300 | 貸付株式数 | 3,600株<br>(900株) |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 宮越ホールディングス | 2,500 | 1,138.00 | 2,845,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| ダイヘン | 6,800 | 2,775.00 | 18,870,000 | | |
| ヤーマン | 8,700 | 1,871.00 | 16,277,700 | | |
| ＪＶＣケンウッド | 43,800 | 288.00 | 12,614,400 | 貸付株式数 | 12,800株 |
| ミマキエンジニアリング | 5,300 | 929.00 | 4,923,700 | | |
| 第一精工 | 2,500 | 1,384.00 | 3,460,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 日新電機 | 14,200 | 951.00 | 13,504,200 | | |
| 大崎電気 | 12,900 | 813.00 | 10,487,700 | | |
| オムロン | 63,400 | 4,990.00 | 316,366,000 | | |
| 日東工業 | 10,000 | 1,928.00 | 19,280,000 | | |
| ＩＤＥＣ | 8,000 | 2,517.00 | 20,136,000 | | |
| 不二電機工業 | 600 | 1,373.00 | 823,800 | | |
| ジーエス・ユアサ　コーポ | 21,500 | 2,623.00 | 56,394,500 | | |
| サクサホールディングス | 1,400 | 2,017.00 | 2,823,800 | | |
| メルコホールディングス | 2,500 | 3,890.00 | 9,725,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| テクノメディカ | 1,300 | 2,191.00 | 2,848,300 | | |
| 日本電気 | 77,300 | 3,520.00 | 272,096,000 | 貸付株式数 | 15,000株<br>(15,000株) |
| 富　士　通 | 57,500 | 6,987.00 | 401,752,500 | | |
| 沖　電　気 | 25,800 | 1,500.00 | 38,700,000 | | |
| 岩崎通信機 | 2,800 | 755.00 | 2,114,000 | | |
| 電気興業 | 3,100 | 2,960.00 | 9,176,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| サンケン電気 | 6,900 | 2,419.00 | 16,691,100 | | |
| ナカヨ | 1,100 | 1,529.00 | 1,681,900 | | |
| アイホン | 3,300 | 1,717.00 | 5,666,100 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| ルネサスエレクトロニクス | 62,000 | 535.00 | 33,170,000 | | |
| セイコーエプソン | 74,000 | 1,804.00 | 133,496,000 | | |
| ワコム | 43,400 | 574.00 | 24,911,600 | 貸付株式数 | 17,000株 |
| アルバック | 13,700 | 4,170.00 | 57,129,000 | | |
| アクセル | 2,400 | 586.00 | 1,406,400 | | |
| ＥＩＺＯ | 5,400 | 4,750.00 | 25,650,000 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| ジャパンディスプレイ | 139,100 | 70.00 | 9,737,000 | 貸付株式数 | 55,600株 |
| 日本信号 | 16,100 | 1,012.00 | 16,293,200 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| 京三製作所 | 14,000 | 505.00 | 7,070,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 能美防災 | 8,200 | 2,254.00 | 18,482,800 | | |
| ホーチキ | 4,100 | 1,313.00 | 5,383,300 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| 星和電機 | 3,000 | 460.00 | 1,380,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| エレコム | 5,500 | 3,005.00 | 16,527,500 | 貸付株式数 | 2,200株<br>(2,200株) |
| パナソニック | 680,500 | 1,164.50 | 792,442,250 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| シャープ | 59,100 | 1,684.00 | 99,524,400 | | |
| アンリツ | 38,500 | 1,861.00 | 71,648,500 | 貸付株式数 | 5,600株 |
| 富士通ゼネラル | 18,100 | 1,603.00 | 29,014,300 | 貸付株式数 | 7,100株 |
| ソ　ニ　ー | 399,700 | 5,937.00 | 2,373,018,900 | | |
| Ｔ　Ｄ　Ｋ | 31,200 | 8,950.00 | 279,240,000 | 貸付株式数 | 10,000株 |
| 帝国通信工業 | 2,500 | 1,219.00 | 3,047,500 | | |
| タムラ製作所 | 23,000 | 656.00 | 15,088,000 | 貸付株式数 | 9,000株 |
| アルプス電気 | 55,000 | 2,631.00 | 144,705,000 | | |
| 池上通信機 | 1,800 | 1,431.00 | 2,575,800 | 貸付株式数 | 900株 |
| パイオニア | 98,800 | 92.00 | 9,089,600 | 貸付株式数 | 40,000株 |
| 日本電波工業 | 5,400 | 491.00 | 2,651,400 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| 鈴木 | 2,800 | 716.00 | 2,004,800 | | |
| 日本トリム | 1,100 | 6,200.00 | 6,820,000 | 貸付株式数 | 400株<br>(200株) |
| ローランド　ディー．ジー． | 3,000 | 2,461.00 | 7,383,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| フオスター電機 | 7,000 | 1,547.00 | 10,829,000 | | |
| クラリオン | 7,000 | 2,490.00 | 17,430,000 | | |
| Ｓ　Ｍ　Ｋ | 1,600 | 2,552.00 | 4,083,200 | | |
| ヨコオ | 4,200 | 1,729.00 | 7,261,800 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| ティアック | 4,200 | 262.00 | 1,100,400 | 貸付株式数 | 1,600株 |
| ホシデン | 17,400 | 880.00 | 15,312,000 | | |
| ヒロセ電機 | 8,600 | 11,970.00 | 102,942,000 | | |
| 日本航空電子 | 13,600 | 1,430.00 | 19,448,000 | | |
| Ｔ　Ｏ　Ａ | 6,900 | 1,228.00 | 8,473,200 | | |
| マクセルホールディングス | 12,700 | 1,592.00 | 20,218,400 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| 古野電気 | 7,700 | 1,292.00 | 9,948,400 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| ユニデンホールディングス | 1,700 | 2,521.00 | 4,285,700 | | |
| アルパイン | 10,300 | 1,839.00 | 18,941,700 | | |
| スミダコーポレーション | 5,100 | 1,520.00 | 7,752,000 | 貸付株式数 | 1,800株<br>(1,700株) |
| アイコム | 3,200 | 2,352.00 | 7,526,400 | | |
| リオン | 2,700 | 2,032.00 | 5,486,400 | | |
| 本多通信工業 | 5,000 | 629.00 | 3,145,000 | | |
| 船井電機 | 6,100 | 747.00 | 4,556,700 | 貸付株式数 | 4,000株<br>(1,800株) |
| 横河電機 | 59,700 | 2,086.00 | 124,534,200 | | |
| 新電元工業 | 2,100 | 4,675.00 | 9,817,500 | | |
| アズビル | 38,900 | 2,450.00 | 95,305,000 | | |
| 東亜ディーケーケー | 2,900 | 958.00 | 2,778,200 | | |
| 日本光電工業 | 26,400 | 3,695.00 | 97,548,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| チ　ノ　ー | 2,000 | 1,481.00 | 2,962,000 | | |
| 共和電業 | 5,700 | 421.00 | 2,399,700 | | |
| 日本電子材料 | 2,300 | 735.00 | 1,690,500 | | |
| 堀場製作所 | 11,800 | 5,320.00 | 62,776,000 | 貸付株式数 | 3,100株<br>(3,100株) |
| アドバンテスト | 40,600 | 2,436.00 | 98,901,600 | 貸付株式数 | 16,100株 |
| 小野測器 | 2,600 | 705.00 | 1,833,000 | | |
| エスペック | 5,200 | 2,107.00 | 10,956,400 | | |
| キーエンス | 29,300 | 61,600.00 | 1,804,880,000 | | |
| 日置電機 | 3,100 | 4,240.00 | 13,144,000 | | |
| シスメックス | 46,400 | 6,049.00 | 280,673,600 | | |
| 日本マイクロニクス | 9,700 | 981.00 | 9,515,700 | 貸付株式数 | 4,300株<br>(4,300株) |
| メガチップス | 4,700 | 2,749.00 | 12,920,300 | 貸付株式数 | 2,100株<br>(2,100株) |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 3,500 | 4,860.00 | 17,010,000 | | |
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 4,900 | 607.00 | 2,974,300 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 澤藤電機 | 700 | 1,953.00 | 1,367,100 | | |
| デンソー | 131,400 | 5,247.00 | 689,455,800 | | |
| 原田工業 | 1,900 | 934.00 | 1,774,600 | 貸付株式数 | 600株 |
| コーセル | 8,200 | 1,160.00 | 9,512,000 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| イリソ電子工業 | 5,400 | 4,975.00 | 26,865,000 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| オプテックスグループ | 10,500 | 2,304.00 | 24,192,000 | 貸付株式数 | 4,200株 |
| 千代田インテグレ | 2,600 | 2,440.00 | 6,344,000 | | |
| アイ・オー・データ | 2,400 | 1,181.00 | 2,834,400 | | |
| レーザーテック | 12,300 | 3,655.00 | 44,956,500 | | |
| スタンレー電気 | 42,100 | 3,305.00 | 139,140,500 | | |
| 岩崎電気 | 3,200 | 1,524.00 | 4,876,800 | | |
| ウシオ電機 | 36,100 | 1,272.00 | 45,919,200 | | |
| 岡谷電機 | 4,300 | 439.00 | 1,887,700 | | |
| ヘリオステクノＨ | 5,500 | 786.00 | 4,323,000 | | |
| 日本セラミック | 6,100 | 2,860.00 | 17,446,000 | | |
| 遠藤照明 | 4,100 | 798.00 | 3,271,800 | | |
| 古河電池 | 5,000 | 829.00 | 4,145,000 | 貸付株式数 | 1,700株<br>(1,000株) |
| 双信電機 | 2,800 | 443.00 | 1,240,400 | | |
| 山一電機 | 4,300 | 1,535.00 | 6,600,500 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 図　研 | 3,900 | 1,766.00 | 6,887,400 | | |
| 日本電子 | 11,900 | 1,987.00 | 23,645,300 | | |
| カ　シ　オ | 52,700 | 1,583.00 | 83,424,100 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ファナック | 56,700 | 19,390.00 | 1,099,413,000 | 貸付株式数 | 22,400株 |
| 日本シイエムケイ | 15,200 | 900.00 | 13,680,000 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| エンプラス | 2,700 | 3,135.00 | 8,464,500 | 貸付株式数 | 700株<br>(700株) |
| 大真空 | 2,200 | 1,036.00 | 2,279,200 | | |
| ロ　ー　ム | 28,800 | 7,900.00 | 227,520,000 | 貸付株式数 | 10,400株 |
| 浜松ホトニクス | 42,800 | 3,950.00 | 169,060,000 | 貸付株式数 | 15,000株 |
| 三井ハイテック | 6,600 | 1,285.00 | 8,481,000 | 貸付株式数 | 2,600株<br>(500株) |
| 新光電気工業 | 20,100 | 803.00 | 16,140,300 | | |
| 京　セ　ラ | 90,900 | 6,125.00 | 556,762,500 | | |
| 協栄産業 | 700 | 1,738.00 | 1,216,600 | | |
| 太陽誘電 | 26,500 | 2,153.00 | 57,054,500 | 貸付株式数 | 10,400株 |
| 村田製作所 | 62,600 | 17,315.00 | 1,083,919,000 | 貸付株式数 | 24,700株<br>(4,800株) |
| ユーシン | 9,200 | 985.00 | 9,062,000 | 貸付株式数 | 1,400株<br>(1,400株) |
| 双葉電子工業 | 9,800 | 1,779.00 | 17,434,200 | | |
| 日東電工 | 45,000 | 6,203.00 | 279,135,000 | | |
| 北陸電気工業 | 2,100 | 1,076.00 | 2,259,600 | 貸付株式数 | 600株 |
| 東海理化電機 | 15,700 | 2,085.00 | 32,734,500 | | |
| ニチコン | 18,800 | 902.00 | 16,957,600 | | |
| 日本ケミコン | 4,200 | 2,343.00 | 9,840,600 | | |
| Ｋ　Ｏ　Ａ | 8,900 | 1,527.00 | 13,590,300 | | |
| 三井Ｅ＆ＳＨＤ | 21,300 | 1,231.00 | 26,220,300 | | |
| 日立造船 | 46,700 | 390.00 | 18,213,000 | 貸付株式数 | 18,600株 |
| 三菱重工業 | 99,800 | 4,317.00 | 430,836,600 | 貸付株式数 | 38,400株 |
| 川崎重工業 | 46,400 | 2,643.00 | 122,635,200 | | |
| ＩＨＩ | 45,800 | 3,455.00 | 158,239,000 | | |
| 名村造船所 | 17,900 | 559.00 | 10,006,100 | | |
| サノヤスホールディングス | 7,800 | 215.00 | 1,677,000 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| スプリックス | 1,600 | 1,947.00 | 3,115,200 | | |
| 日本車輌 | 2,200 | 2,646.00 | 5,821,200 | 貸付株式数 | 800株 |
| 三菱ロジスネクスト | 7,200 | 1,310.00 | 9,432,000 | | |
| 近畿車輌 | 800 | 2,395.00 | 1,916,000 | | |
| ＦＰＧ | 18,700 | 1,230.00 | 23,001,000 | 貸付株式数 | 7,400株 |
| 島根銀行 | 1,400 | 859.00 | 1,202,600 | | |
| じもとホールディングス | 39,600 | 150.00 | 5,940,000 | | |
| 全国保証 | 16,500 | 3,880.00 | 64,020,000 | 貸付株式数 | 6,500株 |
| めぶきフィナンシャルＧ | 305,700 | 343.00 | 104,855,100 | 貸付株式数 | 7,000株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 東京きらぼしＦＧ | 8,000 | 2,099.00 | 16,792,000 | | |
| 九州フィナンシャルＧ | 97,200 | 531.00 | 51,613,200 | | |
| かんぽ生命保険 | 22,000 | 2,865.00 | 63,030,000 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| ゆうちょ銀行 | 168,000 | 1,326.00 | 222,768,000 | 貸付株式数 | 65,800株 |
| 富山第一銀行 | 13,700 | 433.00 | 5,932,100 | 貸付株式数 | 4,400株 |
| コンコルディア・フィナンシャル | 375,300 | 533.00 | 200,034,900 | | |
| ジェイリース | 1,200 | 480.00 | 576,000 | | |
| 西日本フィナンシャルＨＤ | 37,800 | 1,232.00 | 46,569,600 | | |
| マーキュリアインベストメント | 2,300 | 864.00 | 1,987,200 | 貸付株式数 | 900株 |
| イントラスト | 1,700 | 430.00 | 731,000 | 貸付株式数 | 600株 |
| 日本モーゲージサービス | 800 | 1,003.00 | 802,400 | | |
| Ｃａｓａ | 1,800 | 1,170.00 | 2,106,000 | | |
| アルヒ | 5,300 | 1,797.00 | 9,524,100 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| 日産自動車 | 703,600 | 994.30 | 699,589,480 | | |
| いすゞ自動車 | 188,600 | 1,616.00 | 304,777,600 | | |
| トヨタ自動車 ※ | 664,800 | 6,803.00 | 4,522,634,400 | | |
| 日野自動車 | 74,400 | 1,160.00 | 86,304,000 | | |
| 三菱自動車工業 | 220,600 | 696.00 | 153,537,600 | | |
| エフテック | 4,100 | 1,113.00 | 4,563,300 | | |
| レシップホールディングス | 4,000 | 723.00 | 2,892,000 | | |
| ＧＭＢ | 1,100 | 1,174.00 | 1,291,400 | | |
| ファルテック | 1,000 | 969.00 | 969,000 | | |
| 武蔵精密工業 | 14,000 | 1,796.00 | 25,144,000 | | |
| 日産車体 | 11,800 | 943.00 | 11,127,400 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| 新明和工業 | 27,900 | 1,527.00 | 42,603,300 | 貸付株式数 | 300株 |
| 極東開発工業 | 11,900 | 1,646.00 | 19,587,400 | | |
| 日信工業 | 11,000 | 1,504.00 | 16,544,000 | | |
| トピー工業 | 4,900 | 2,678.00 | 13,122,200 | | |
| ティラド | 2,100 | 2,557.00 | 5,369,700 | | |
| 曙ブレーキ | 32,900 | 218.00 | 7,172,200 | 貸付株式数 | 13,300株<br>(100株) |
| タチエス | 10,100 | 1,599.00 | 16,149,900 | | |
| Ｎ　Ｏ　Ｋ | 31,900 | 1,710.00 | 54,549,000 | 貸付株式数 | 12,600株 |
| フタバ産業 | 16,500 | 612.00 | 10,098,000 | 貸付株式数 | 7,000株 |
| ＫＹＢ | 6,200 | 2,827.00 | 17,527,400 | 貸付株式数 | 1,900株<br>(1,900株) |
| 市光工業 | 8,900 | 744.00 | 6,621,600 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| 大同メタル工業 | 9,700 | 950.00 | 9,215,000 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| プレス工業 | 29,600 | 613.00 | 18,144,800 | |
| ミクニ | 7,500 | 588.00 | 4,410,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| 太平洋工業 | 12,600 | 1,703.00 | 21,457,800 | |
| ケーヒン | 13,700 | 1,964.00 | 26,906,800 | |
| 河西工業 | 7,200 | 997.00 | 7,178,400 | |
| アイシン精機 | 49,100 | 4,490.00 | 220,459,000 | 貸付株式数 19,000株 |
| マ　ツ　ダ | 186,900 | 1,210.00 | 226,149,000 | |
| 今仙電機製作所 | 5,400 | 1,060.00 | 5,724,000 | |
| 本田技研 | 503,200 | 3,202.00 | 1,611,246,400 | |
| スズキ | 109,100 | 5,655.00 | 616,960,500 | 貸付株式数 45,900株 |
| ＳＵＢＡＲＵ | 185,100 | 2,523.00 | 467,007,300 | |
| 安永 | 2,900 | 1,914.00 | 5,550,600 | 貸付株式数 1,300株 |
| ヤマハ発動機 | 84,100 | 2,335.00 | 196,373,500 | 貸付株式数 32,500株 |
| ショーワ | 14,100 | 1,518.00 | 21,403,800 | |
| 小糸製作所 | 35,800 | 6,090.00 | 218,022,000 | |
| ＴＢＫ | 7,000 | 448.00 | 3,136,000 | 貸付株式数 1,000株 |
| エクセディ | 8,000 | 2,914.00 | 23,312,000 | |
| ミツバ | 11,000 | 747.00 | 8,217,000 | |
| 豊田合成 | 19,300 | 2,185.00 | 42,170,500 | |
| 愛三工業 | 9,200 | 831.00 | 7,645,200 | |
| 盟和産業 | 1,000 | 1,082.00 | 1,082,000 | |
| 日本プラスト | 4,600 | 923.00 | 4,245,800 | |
| ヨ　ロ　ズ | 5,500 | 1,494.00 | 8,217,000 | |
| エフ・シー・シー | 10,700 | 2,951.00 | 31,575,700 | |
| 新家工業 | 1,300 | 1,827.00 | 2,375,100 | |
| シマノ | 24,000 | 16,580.00 | 397,920,000 | |
| テイ・エス　テック | 13,800 | 3,290.00 | 45,402,000 | |
| 関西みらいＦＧ | 27,700 | 915.00 | 25,345,500 | |
| ３３ＦＧ | 5,100 | 1,919.00 | 9,786,900 | |
| 第四北越フィナンシャルＧ | 10,200 | 3,700.00 | 37,740,000 | |
| ジャムコ | 3,000 | 3,205.00 | 9,615,000 | 貸付株式数 1,100株<br>(900株) |
| 小　野　建 | 5,100 | 1,678.00 | 8,557,800 | 貸付株式数 1,400株<br>(1,400株) |
| はるやまＨＬＤＧＳ | 2,700 | 896.00 | 2,419,200 | |
| ノ　ジ　マ | 10,400 | 2,605.00 | 27,092,000 | |
| 佐鳥電機 | 4,400 | 1,051.00 | 4,624,400 | 貸付株式数 1,000株 |
| カッパ・クリエイト | 8,400 | 1,500.00 | 12,600,000 | |
| エコートレーディング | 1,500 | 633.00 | 949,500 | |
| 伯東 | 3,900 | 1,339.00 | 5,222,100 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| コンドーテック | 4,400 | 1,033.00 | 4,545,200 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 中山福 | 3,400 | 551.00 | 1,873,400 | | |
| ライトオン | 5,000 | 944.00 | 4,720,000 | 貸付株式数 | 1,400株<br>(1,400株) |
| ナガイレーベン | 8,500 | 2,775.00 | 23,587,500 | | |
| ジーンズメイト | 1,800 | 483.00 | 869,400 | | |
| 三菱食品 | 6,400 | 3,065.00 | 19,616,000 | | |
| 良品計画 | 8,300 | 30,550.00 | 253,565,000 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 三城ホールディングス | 7,500 | 494.00 | 3,705,000 | | |
| 松田産業 | 4,500 | 1,492.00 | 6,714,000 | | |
| 第一興商 | 8,700 | 5,180.00 | 45,066,000 | | |
| メディパルＨＤ | 63,300 | 2,600.00 | 164,580,000 | | |
| アドヴァン | 9,000 | 1,099.00 | 9,891,000 | 貸付株式数 | 600株<br>(600株) |
| ＳＰＫ | 1,200 | 2,390.00 | 2,868,000 | | |
| 萩原電気ＨＬＤＧＳ | 2,100 | 3,205.00 | 6,730,500 | | |
| アルビス | 2,200 | 2,866.00 | 6,305,200 | 貸付株式数 | 900株 |
| アズワン | 4,200 | 8,380.00 | 35,196,000 | | |
| スズデン | 1,900 | 1,287.00 | 2,445,300 | | |
| 尾家産業 | 1,800 | 1,336.00 | 2,404,800 | | |
| シモジマ | 3,500 | 1,128.00 | 3,948,000 | | |
| ドウシシャ | 5,600 | 2,104.00 | 11,782,400 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 小津産業 | 1,200 | 1,969.00 | 2,362,800 | | |
| コナカ | 7,700 | 497.00 | 3,826,900 | | |
| 高速 | 3,400 | 1,209.00 | 4,110,600 | | |
| ハウス　ローゼ | 700 | 1,907.00 | 1,334,900 | | |
| Ｇ－７ホールディングス | 1,700 | 2,636.00 | 4,481,200 | 貸付株式数 | 600株 |
| たけびし | 2,700 | 1,478.00 | 3,990,600 | | |
| イオン北海道 | 6,000 | 812.00 | 4,872,000 | | |
| コ　ジ　マ | 8,800 | 518.00 | 4,558,400 | | |
| ヒマラヤ | 1,700 | 1,039.00 | 1,766,300 | 貸付株式数 | 600株 |
| コーナン商事 | 7,700 | 2,800.00 | 21,560,000 | | |
| ネットワンシステムズ | 20,800 | 2,347.00 | 48,817,600 | 貸付株式数 | 7,300株<br>(7,300株) |
| エコス | 2,200 | 2,087.00 | 4,591,400 | | |
| ワタミ | 7,700 | 1,422.00 | 10,949,400 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| マルシェ | 1,300 | 795.00 | 1,033,500 | | |
| リックス | 1,300 | 1,580.00 | 2,054,000 | | |
| システムソフト | 13,500 | 114.00 | 1,539,000 | 貸付株式数 | 5,400株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ドンキホーテホールディング | 38,100 | 6,890.00 | 262,509,000 | 貸付株式数 | 15,000株<br>(15,000株) |
| 丸文 | 5,100 | 847.00 | 4,319,700 | | |
| 西松屋チェーン | 12,900 | 997.00 | 12,861,300 | | |
| ゼンショーホールディングス | 27,800 | 2,826.00 | 78,562,800 | | |
| ハピネット | 4,800 | 1,615.00 | 7,752,000 | | |
| 幸楽苑ホールディングス | 3,700 | 2,241.00 | 8,291,700 | 貸付株式数 | 1,600株<br>(1,600株) |
| ハークスレイ | 1,200 | 1,094.00 | 1,312,800 | | |
| 橋本総業ＨＬＤＧＳ | 1,000 | 1,460.00 | 1,460,000 | | |
| 日本ライフライン | 18,400 | 1,798.00 | 33,083,200 | 貸付株式数 | 7,200株 |
| サイゼリヤ | 9,600 | 2,170.00 | 20,832,000 | 貸付株式数 | 3,800株 |
| タカショー | 2,800 | 478.00 | 1,338,400 | | |
| エクセル | 2,200 | 2,009.00 | 4,419,800 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| ＶＴホールディングス | 19,600 | 469.00 | 9,192,400 | | |
| マルカキカイ | 1,900 | 2,244.00 | 4,263,600 | 貸付株式数 | 700株 |
| アルゴグラフィックス | 2,500 | 4,540.00 | 11,350,000 | | |
| 魚力 | 1,600 | 1,441.00 | 2,305,600 | | |
| ＩＤＯＭ | 19,800 | 570.00 | 11,286,000 | 貸付株式数 | 7,800株 |
| 日本エム・ディ・エム | 3,400 | 1,389.00 | 4,722,600 | | |
| ポプラ | 1,400 | 610.00 | 854,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| フジ・コーポレーション | 1,200 | 1,995.00 | 2,394,000 | | |
| ユナイテッドアローズ | 6,700 | 3,825.00 | 25,627,500 | 貸付株式数 | 1,900株<br>(1,900株) |
| 進和 | 3,500 | 2,430.00 | 8,505,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| エスケイジャパン | 1,400 | 891.00 | 1,247,400 | 貸付株式数 | 500株 |
| ダイトロン | 2,700 | 1,540.00 | 4,158,000 | | |
| ハイデイ日高 | 7,600 | 2,357.00 | 17,913,200 | | |
| シークス | 7,400 | 1,808.00 | 13,379,200 | 貸付株式数 | 2,900株 |
| 京都きもの友禅 | 4,000 | 449.00 | 1,796,000 | | |
| コロワイド | 19,500 | 2,642.00 | 51,519,000 | | |
| ピーシーデポコーポ | 7,700 | 554.00 | 4,265,800 | 貸付株式数 | 700株<br>(500株) |
| 田中商事 | 1,800 | 627.00 | 1,128,600 | | |
| オーハシテクニカ | 3,200 | 1,398.00 | 4,473,600 | | |
| 壱番屋 | 4,100 | 4,765.00 | 19,536,500 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| 白銅 | 1,800 | 1,772.00 | 3,189,600 | | |
| トップカルチャー | 2,200 | 383.00 | 842,600 | 貸付株式数 | 800株 |
| ＰＬＡＮＴ | 1,400 | 1,095.00 | 1,533,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| スギホールディングス | 12,800 | 5,340.00 | 68,352,000 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 島津製作所 | 76,800 | 2,654.00 | 203,827,200 | |
| Ｊ　Ｍ　Ｓ | 5,100 | 595.00 | 3,034,500 | 貸付株式数　1,000株 |
| クボテック | 1,200 | 342.00 | 410,400 | |
| 長野計器 | 4,600 | 957.00 | 4,402,200 | |
| ブイ・テクノロジー | 1,400 | 15,930.00 | 22,302,000 | 貸付株式数　500株 |
| スター精密 | 10,200 | 1,692.00 | 17,258,400 | |
| 東京計器 | 3,700 | 1,109.00 | 4,103,300 | 貸付株式数　1,300株<br>(1,300株) |
| 愛知時計 | 800 | 4,045.00 | 3,236,000 | |
| インターアクション | 3,200 | 2,580.00 | 8,256,000 | |
| オーバル | 5,500 | 284.00 | 1,562,000 | 貸付株式数　1,000株 |
| 東京精密 | 10,800 | 3,380.00 | 36,504,000 | |
| マニー | 7,200 | 5,340.00 | 38,448,000 | |
| ニコン | 104,000 | 1,780.00 | 185,120,000 | |
| トプコン | 32,000 | 1,751.00 | 56,032,000 | |
| オリンパス | 88,900 | 3,195.00 | 284,035,500 | |
| 理研計器 | 5,200 | 2,376.00 | 12,355,200 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 10,300 | 5,680.00 | 58,504,000 | |
| キヤノン電子 | 5,500 | 2,143.00 | 11,786,500 | |
| タムロン | 5,200 | 1,828.00 | 9,505,600 | 貸付株式数　300株 |
| ＨＯＹＡ | 120,100 | 6,900.00 | 828,690,000 | 貸付株式数　47,500株 |
| シ　ー　ド | 2,500 | 1,584.00 | 3,960,000 | |
| ノーリツ鋼機 | 4,700 | 1,955.00 | 9,188,500 | |
| エー・アンド・デイ | 5,400 | 833.00 | 4,498,200 | 貸付株式数　1,000株 |
| 朝日インテック | 21,600 | 5,320.00 | 114,912,000 | |
| キヤノン | 321,000 | 3,220.00 | 1,033,620,000 | |
| リ　コ　ー | 179,600 | 1,102.00 | 197,919,200 | |
| シチズン時計 | 65,000 | 600.00 | 39,000,000 | |
| リズム時計 | 1,900 | 2,045.00 | 3,885,500 | |
| 大研医器 | 4,600 | 765.00 | 3,519,000 | |
| メニコン | 8,100 | 2,993.00 | 24,243,300 | |
| シンシア | 900 | 639.00 | 575,100 | |
| 中本パックス | 1,600 | 1,847.00 | 2,955,200 | |
| スノーピーク | 2,200 | 1,387.00 | 3,051,400 | |
| パラマウントベッドＨＤ | 6,800 | 4,795.00 | 32,606,000 | |
| トランザクション | 3,200 | 827.00 | 2,646,400 | |
| ＳＨＯ‐ＢＩ | 1,700 | 398.00 | 676,600 | |
| ニホンフラッシュ | 2,500 | 2,080.00 | 5,200,000 | |
| 前田工繊 | 6,600 | 2,606.00 | 17,199,600 | 貸付株式数　600株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 永大産業 | 7,600 | 449.00 | 3,412,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| アートネイチャー | 6,400 | 682.00 | 4,364,800 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| バンダイナムコＨＬＤＧＳ | 61,700 | 4,770.00 | 294,309,000 | | |
| アイフィスジャパン | 1,300 | 663.00 | 861,900 | 貸付株式数 | 100株 |
| 共立印刷 | 10,200 | 248.00 | 2,529,600 | | |
| ＳＨＯＥＩ | 2,900 | 4,435.00 | 12,861,500 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| フランスベッドＨＬＤＧＳ | 8,200 | 969.00 | 7,945,800 | | |
| マーベラス | 8,800 | 917.00 | 8,069,600 | 貸付株式数 | 3,800株<br>(2,800株) |
| パイロットコーポレーション | 10,400 | 5,870.00 | 61,048,000 | | |
| 萩原工業 | 3,200 | 1,710.00 | 5,472,000 | | |
| エイベックス | 9,900 | 1,545.00 | 15,295,500 | 貸付株式数 | 3,900株 |
| トッパン・フォームズ | 12,700 | 1,041.00 | 13,220,700 | | |
| フジシールインターナショナル | 13,300 | 4,090.00 | 54,397,000 | | |
| タカラトミー | 24,900 | 1,416.00 | 35,258,400 | 貸付株式数 | 9,800株 |
| 廣済堂 | 5,500 | 428.00 | 2,354,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| エステールホールディングス | 1,500 | 700.00 | 1,050,000 | | |
| アーク | 23,500 | 100.00 | 2,350,000 | | |
| レック | 6,400 | 2,058.00 | 13,171,200 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| タカノ | 2,200 | 889.00 | 1,955,800 | | |
| 三光合成 | 4,600 | 390.00 | 1,794,000 | | |
| プロネクサス | 5,000 | 1,147.00 | 5,735,000 | | |
| ホクシン | 3,700 | 160.00 | 592,000 | | |
| ウッドワン | 2,000 | 1,172.00 | 2,344,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 大建工業 | 4,500 | 2,116.00 | 9,522,000 | | |
| き　も　と | 10,000 | 219.00 | 2,190,000 | | |
| 凸版印刷 | 84,200 | 1,828.00 | 153,917,600 | | |
| 大日本印刷 | 84,000 | 2,626.00 | 220,584,000 | | |
| 図書印刷 | 5,600 | 830.00 | 4,648,000 | | |
| 共同印刷 | 1,800 | 2,651.00 | 4,771,800 | | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 12,200 | 1,781.00 | 21,728,200 | 貸付株式数 | 4,800株<br>(2,700株) |
| 光村印刷 | 500 | 2,305.00 | 1,152,500 | | |
| 藤森工業 | 5,300 | 3,240.00 | 17,172,000 | | |
| ヴィア・ホールディングス | 7,200 | 731.00 | 5,263,200 | 貸付株式数 | 3,700株 |
| 宝印刷 | 3,100 | 1,841.00 | 5,707,100 | | |
| 前澤化成工業 | 4,000 | 1,134.00 | 4,536,000 | | |
| アシックス | 59,200 | 1,636.00 | 96,851,200 | | |
| ツ　ツ　ミ | 1,900 | 2,174.00 | 4,130,600 | 貸付株式数 | 700株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ウェーブロックＨＬＤＧＳ | 1,400 | 876.00 | 1,226,400 | | |
| ジェイ　エス　ピー | 3,500 | 2,418.00 | 8,463,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ニ　チ　ハ | 8,300 | 3,105.00 | 25,771,500 | | |
| エフピコ | 4,900 | 6,930.00 | 33,957,000 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 小松ウオール工業 | 1,800 | 2,095.00 | 3,771,000 | | |
| ヤマハ | 35,500 | 4,890.00 | 173,595,000 | | |
| 河合楽器 | 1,800 | 4,030.00 | 7,254,000 | 貸付株式数 | 100株 |
| クリナップ | 5,500 | 725.00 | 3,987,500 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ピジョン | 36,000 | 4,675.00 | 168,300,000 | | |
| 天馬 | 4,100 | 2,087.00 | 8,556,700 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 兼松サステック | 400 | 1,761.00 | 704,400 | | |
| キングジム | 4,700 | 914.00 | 4,295,800 | | |
| 象印マホービン | 11,100 | 1,171.00 | 12,998,100 | 貸付株式数 | 4,400株 |
| リンテック | 14,100 | 2,570.00 | 36,237,000 | | |
| 信越ポリマー | 10,600 | 830.00 | 8,798,000 | | |
| 東　リ | 14,600 | 297.00 | 4,336,200 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| イトーキ | 10,800 | 617.00 | 6,663,600 | | |
| 任　天　堂 | 36,700 | 34,610.00 | 1,270,187,000 | | |
| 三菱鉛筆 | 9,800 | 2,177.00 | 21,334,600 | | |
| 松　風 | 2,700 | 1,233.00 | 3,329,100 | | |
| タカラスタンダード | 12,400 | 1,778.00 | 22,047,200 | | |
| コ　ク　ヨ | 28,500 | 1,749.00 | 49,846,500 | | |
| ナカバヤシ | 5,700 | 591.00 | 3,368,700 | | |
| ニ　フ　コ | 23,900 | 2,895.00 | 69,190,500 | | |
| 立川ブラインド | 2,600 | 1,217.00 | 3,164,200 | 貸付株式数 | 400株 |
| グローブライド | 2,900 | 2,889.00 | 8,378,100 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| オカムラ | 20,900 | 1,637.00 | 34,213,300 | 貸付株式数 | 8,100株 |
| バルカー | 4,800 | 2,753.00 | 13,214,400 | | |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 700 | 2,278.00 | 1,594,600 | | |
| 伊　藤　忠 | 410,600 | 2,016.00 | 827,769,600 | 貸付株式数 | 169,800株 |
| 丸　紅 | 578,600 | 847.50 | 490,363,500 | | |
| スクロール | 9,000 | 454.00 | 4,086,000 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| 高　島 | 900 | 2,032.00 | 1,828,800 | | |
| ヨンドシーホールディングス | 6,400 | 2,465.00 | 15,776,000 | | |
| 三陽商会 | 3,600 | 2,054.00 | 7,394,400 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 長瀬産業 | 32,800 | 1,697.00 | 55,661,600 | | |
| ナイガイ | 2,000 | 495.00 | 990,000 | | |
| 蝶　理 | 3,800 | 1,894.00 | 7,197,200 | | |
| 豊田通商 | 65,500 | 3,920.00 | 256,760,000 | | |
| オンワードホールディングス | 35,600 | 677.00 | 24,101,200 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 三共生興 | 10,200 | 457.00 | 4,661,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 兼　松 | 23,300 | 1,448.00 | 33,738,400 | | |
| 美　津　濃 | 5,800 | 2,582.00 | 14,975,600 | | |
| ツカモトコーポレーション | 1,000 | 1,178.00 | 1,178,000 | | |
| ユニー・ファミリーマートＨＤ | 16,400 | 16,110.00 | 264,204,000 | 貸付株式数 | 6,400株 |
| ルックホールディングス | 2,100 | 1,171.00 | 2,459,100 | | |
| 三井物産 | 483,800 | 1,774.50 | 858,503,100 | 貸付株式数 | 190,700株 |
| 日本紙パルプ | 3,300 | 4,485.00 | 14,800,500 | | |
| 東京エレクトロン | 39,800 | 15,875.00 | 631,825,000 | | |
| 日立ハイテクノロジーズ | 17,900 | 4,045.00 | 72,405,500 | | |
| カメイ | 7,600 | 1,385.00 | 10,526,000 | | |
| 東都水産 | 800 | 2,012.00 | 1,609,600 | | |
| ＯＵＧホールディングス | 900 | 2,651.00 | 2,385,900 | | |
| スターゼン | 2,100 | 4,390.00 | 9,219,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| セイコーＨＤ | 9,200 | 2,520.00 | 23,184,000 | | |
| 山　善 | 23,000 | 1,203.00 | 27,669,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 椿本興業 | 1,300 | 3,370.00 | 4,381,000 | 貸付株式数 | 500株 |
| 住友商事 | 347,000 | 1,743.50 | 604,994,500 | | |
| 日本ユニシス | 18,400 | 2,895.00 | 53,268,000 | | |
| 内田洋行 | 2,600 | 2,701.00 | 7,022,600 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| 三菱商事 | 412,300 | 3,062.00 | 1,262,462,600 | 貸付株式数 | 162,300株 |
| 第一実業 | 2,700 | 4,010.00 | 10,827,000 | | |
| キヤノンマーケティングＪＰＮ | 16,800 | 2,178.00 | 36,590,400 | | |
| 西華産業 | 3,300 | 1,647.00 | 5,435,100 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 佐藤商事 | 5,000 | 996.00 | 4,980,000 | | |
| 菱洋エレクトロ | 6,000 | 1,798.00 | 10,788,000 | | |
| 東京産業 | 6,300 | 595.00 | 3,748,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ユアサ商事 | 6,000 | 3,805.00 | 22,830,000 | | |
| 神鋼商事 | 1,300 | 2,758.00 | 3,585,400 | | |
| 小林産業 | 3,100 | 305.00 | 945,500 | | |
| 阪和興業 | 10,100 | 3,400.00 | 34,340,000 | | |
| 正栄食品 | 3,100 | 4,840.00 | 15,004,000 | | |
| カナデン | 5,800 | 1,309.00 | 7,592,200 | | |
| 菱電商事 | 4,900 | 1,600.00 | 7,840,000 | | |
| ニプロ | 41,200 | 1,543.00 | 63,571,600 | | |
| フルサト工業 | 3,100 | 1,916.00 | 5,939,600 | | |
| 岩谷産業 | 13,000 | 3,780.00 | 49,140,000 | 貸付株式数 | 5,200株 |
| すてきナイスグループ | 2,400 | 1,133.00 | 2,719,200 | 貸付株式数 | 600株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 昭光通商 | 2,300 | 803.00 | 1,846,900 | 貸付株式数 | 900株 |
| ニチモウ | 1,300 | 1,845.00 | 2,398,500 | | |
| 極東貿易 | 1,900 | 1,767.00 | 3,357,300 | | |
| イ　ワ　キ | 7,000 | 528.00 | 3,696,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 兼松エレクトロニクス | 3,200 | 3,640.00 | 11,648,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 三愛石油 | 15,600 | 1,298.00 | 20,248,800 | | |
| 稲畑産業 | 14,200 | 1,628.00 | 23,117,600 | | |
| ＧＳＩクレオス | 1,600 | 1,488.00 | 2,380,800 | | |
| 明和産業 | 6,200 | 442.00 | 2,740,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ゴールドウイン | 5,300 | 11,770.00 | 62,381,000 | 貸付株式数 | 2,000株<br>(1,400株) |
| ユニ・チヤーム | 126,500 | 3,554.00 | 449,581,000 | 貸付株式数 | 300株<br>(300株) |
| デサント | 14,300 | 2,223.00 | 31,788,900 | 貸付株式数 | 5,600株 |
| キ　ン　グ | 3,000 | 500.00 | 1,500,000 | | |
| ワ　キ　タ | 12,500 | 1,305.00 | 16,312,500 | | |
| ヤマトインターナシヨナル | 3,700 | 457.00 | 1,690,900 | | |
| 東邦ホールディングス | 17,300 | 3,015.00 | 52,159,500 | 貸付株式数 | 6,800株 |
| サンゲツ | 17,700 | 2,172.00 | 38,444,400 | | |
| ミツウロコグループ | 8,300 | 710.00 | 5,893,000 | | |
| シナネンホールディングス | 2,400 | 2,749.00 | 6,597,600 | | |
| 伊藤忠エネクス | 12,900 | 1,067.00 | 13,764,300 | | |
| サンリオ | 18,200 | 2,346.00 | 42,697,200 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| サンワ　テクノス | 3,500 | 1,247.00 | 4,364,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| リョーサン | 6,500 | 3,310.00 | 21,515,000 | 貸付株式数 | 100株 |
| 新光商事 | 5,600 | 1,757.00 | 9,839,200 | | |
| トーホー | 2,600 | 2,395.00 | 6,227,000 | 貸付株式数 | 1,200株<br>(1,200株) |
| 三信電気 | 5,000 | 2,019.00 | 10,095,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 東陽テクニカ | 6,500 | 908.00 | 5,902,000 | | |
| モスフード　サービス | 7,600 | 3,065.00 | 23,294,000 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 加賀電子 | 5,800 | 2,404.00 | 13,943,200 | | |
| 三益半導体 | 4,500 | 1,545.00 | 6,952,500 | | |
| ソーダニツカ | 6,600 | 632.00 | 4,171,200 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 立花エレテック | 4,200 | 1,769.00 | 7,429,800 | | |
| 木曽路 | 7,100 | 2,618.00 | 18,587,800 | | |
| ＳＲＳホールディングス | 6,700 | 1,032.00 | 6,914,400 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 千　趣　会 | 11,100 | 318.00 | 3,529,800 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| タカキユー | 4,800 | 197.00 | 945,600 | | |
| ケーヨー | 10,700 | 609.00 | 6,516,300 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 上新電機 | 6,900 | 2,892.00 | 19,954,800 | | |
| 日本瓦斯 | 10,700 | 4,040.00 | 43,228,000 | | |
| ロイヤルホールディングス | 10,300 | 2,859.00 | 29,447,700 | | |
| 東　天　紅 | 500 | 1,465.00 | 732,500 | 貸付株式数 | 200株 |
| いなげや | 6,700 | 1,582.00 | 10,599,400 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| 島　忠 | 13,300 | 3,065.00 | 40,764,500 | | |
| チヨダ | 6,100 | 2,049.00 | 12,498,900 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| ライフコーポレーション | 4,400 | 2,708.00 | 11,915,200 | | |
| リンガーハツト | 7,200 | 2,477.00 | 17,834,400 | 貸付株式数 | 1,700株<br>(1,700株) |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 8,100 | 544.00 | 4,406,400 | | |
| テンアライド | 5,200 | 415.00 | 2,158,000 | | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 11,700 | 1,465.00 | 17,140,500 | | |
| オークワ | 8,300 | 1,248.00 | 10,358,400 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| コメリ | 9,000 | 2,717.00 | 24,453,000 | | |
| 青山商事 | 11,300 | 2,848.00 | 32,182,400 | | |
| しまむら | 6,800 | 9,640.00 | 65,552,000 | 貸付株式数 | 2,700株 |
| はせがわ | 2,900 | 465.00 | 1,348,500 | | |
| 高　島　屋 | 45,900 | 1,650.00 | 75,735,000 | 貸付株式数 | 18,200株 |
| 松　屋 | 11,900 | 1,414.00 | 16,826,600 | | |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 30,100 | 1,947.00 | 58,604,700 | | |
| 近鉄百貨店 | 2,300 | 3,730.00 | 8,579,000 | | |
| パ　ル　コ | 5,700 | 1,310.00 | 7,467,000 | | |
| 丸井グループ | 49,800 | 2,447.00 | 121,860,600 | 貸付株式数 | 8,600株 |
| クレディセゾン | 40,900 | 1,457.00 | 59,591,300 | | |
| アクシアル　リテイリング | 4,800 | 4,035.00 | 19,368,000 | | |
| 井　筒　屋 | 3,300 | 239.00 | 788,700 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| イオン | 226,300 | 2,721.00 | 615,762,300 | 貸付株式数 | 89,400株 |
| イ　ズ　ミ | 11,900 | 6,430.00 | 76,517,000 | | |
| フオーバル | 2,600 | 1,009.00 | 2,623,400 | | |
| 平　和　堂 | 11,900 | 3,150.00 | 37,485,000 | | |
| フ　ジ | 7,000 | 2,139.00 | 14,973,000 | | |
| ヤオコー | 6,700 | 6,790.00 | 45,493,000 | | |
| ゼビオホールディングス | 7,100 | 1,473.00 | 10,458,300 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| ケーズホールディングス | 61,000 | 1,197.00 | 73,017,000 | 貸付株式数 | 13,000株<br>(13,000株) |
| ＰＡＬＴＡＣ | 10,600 | 6,080.00 | 64,448,000 | 貸付株式数 | 4,200株 |
| 三谷産業 | 7,900 | 314.00 | 2,480,600 | 貸付株式数 | 3,100株<br>(3,100株) |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ＯＬＹＭＰＩＣグループ | 3,500 | 865.00 | 3,027,500 | | |
| 日産東京販売ＨＤ | 8,500 | 347.00 | 2,949,500 | | |
| 新生銀行 | 42,900 | 1,558.00 | 66,838,200 | 貸付株式数 | 400株 |
| あおぞら銀行 | 32,700 | 3,730.00 | 121,971,000 | | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ | 4,095,000 | 624.50 | 2,557,327,500 | | |
| りそなホールディングス | 643,500 | 601.90 | 387,322,650 | | |
| 三井住友トラストＨＤ | 115,600 | 4,552.00 | 526,211,200 | | |
| 三井住友フィナンシャルＧ | 414,400 | 4,183.00 | 1,733,435,200 | | |
| 千葉銀行 | 208,400 | 745.00 | 155,258,000 | | |
| 群馬銀行 | 116,800 | 541.00 | 63,188,800 | | |
| 武蔵野銀行 | 8,700 | 3,070.00 | 26,709,000 | | |
| 千葉興業銀行 | 15,900 | 445.00 | 7,075,500 | | |
| 筑波銀行 | 24,000 | 242.00 | 5,808,000 | 貸付株式数 | 10,000株 |
| 七十七銀行 | 18,400 | 2,273.00 | 41,823,200 | | |
| 青森銀行 | 4,500 | 3,125.00 | 14,062,500 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| 秋田銀行 | 3,700 | 2,332.00 | 8,628,400 | | |
| 山形銀行 | 6,600 | 2,387.00 | 15,754,200 | 貸付株式数 | 2,600株<br>(1,600株) |
| 岩手銀行 | 4,100 | 4,140.00 | 16,974,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| 東邦銀行 | 52,600 | 376.00 | 19,777,600 | 貸付株式数 | 4,900株 |
| 東北銀行 | 3,000 | 1,345.00 | 4,035,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| みちのく銀行 | 3,800 | 1,817.00 | 6,904,600 | | |
| ふくおかフィナンシャルＧ | 47,800 | 2,589.00 | 123,754,200 | | |
| 静岡銀行 | 148,300 | 1,019.00 | 151,117,700 | | |
| 十六銀行 | 7,800 | 2,696.00 | 21,028,800 | | |
| スルガ銀行 | 59,500 | 538.00 | 32,011,000 | 貸付株式数 | 23,800株<br>(7,000株) |
| 八十二銀行 | 106,400 | 521.00 | 55,434,400 | | |
| 山梨中央銀行 | 7,300 | 1,663.00 | 12,139,900 | | |
| 大垣共立銀行 | 9,200 | 2,490.00 | 22,908,000 | | |
| 福井銀行 | 4,900 | 1,926.00 | 9,437,400 | 貸付株式数 | 1,400株<br>(1,400株) |
| 北國銀行 | 6,200 | 4,250.00 | 26,350,000 | | |
| 清水銀行 | 2,400 | 1,901.00 | 4,562,400 | 貸付株式数 | 300株<br>(300株) |
| 富山銀行 | 1,100 | 3,780.00 | 4,158,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| 滋賀銀行 | 11,700 | 2,848.00 | 33,321,600 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| 南都銀行 | 6,800 | 2,574.00 | 17,503,200 | | |
| 百五銀行 | 52,900 | 450.00 | 23,805,000 | | |
| 京都銀行 | 21,100 | 5,460.00 | 115,206,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 紀陽銀行 | 20,800 | 1,808.00 | 37,606,400 | 貸付株式数 | 8,200株 |
| ほくほくフィナンシャルG | 38,900 | 1,484.00 | 57,727,600 | | |
| 広島銀行 | 86,200 | 684.00 | 58,960,800 | 貸付株式数 | 25,000株 |
| 山陰合同銀行 | 34,900 | 895.00 | 31,235,500 | | |
| 中国銀行 | 37,600 | 1,057.00 | 39,743,200 | | |
| 鳥取銀行 | 2,000 | 1,553.00 | 3,106,000 | | |
| 伊予銀行 | 77,400 | 697.00 | 53,947,800 | | |
| 百十四銀行 | 6,200 | 2,883.00 | 17,874,600 | | |
| 四国銀行 | 8,400 | 1,399.00 | 11,751,600 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 阿波銀行 | 9,400 | 3,280.00 | 30,832,000 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| 大分銀行 | 3,600 | 3,820.00 | 13,752,000 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| 宮崎銀行 | 3,900 | 3,285.00 | 12,811,500 | | |
| 佐賀銀行 | 3,500 | 2,065.00 | 7,227,500 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| 十八銀行 | 3,700 | 2,853.00 | 10,556,100 | | |
| 沖縄銀行 | 5,300 | 3,735.00 | 19,795,500 | 貸付株式数 | 200株 |
| 琉球銀行 | 13,400 | 1,298.00 | 17,393,200 | 貸付株式数 | 4,700株 |
| セブン銀行 | 198,600 | 352.00 | 69,907,200 | 貸付株式数 | 78,100株 |
| みずほフィナンシャルG | 7,992,900 | 188.30 | 1,505,063,070 | 貸付株式数 | 1,400,000株 |
| 高知銀行 | 2,000 | 909.00 | 1,818,000 | | |
| 山口フィナンシャルG | 73,300 | 1,176.00 | 86,200,800 | | |
| アクリーティブ | 900 | 412.00 | 370,800 | | |
| 芙蓉総合リース | 6,700 | 6,880.00 | 46,096,000 | | |
| 興銀リース | 11,000 | 2,800.00 | 30,800,000 | | |
| 東京センチュリー | 11,900 | 5,420.00 | 64,498,000 | | |
| ＳＢＩホールディングス | 70,100 | 2,576.00 | 180,577,600 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| 日本証券金融 | 26,000 | 660.00 | 17,160,000 | | |
| アイフル | 89,800 | 311.00 | 27,927,800 | 貸付株式数 | 35,500株<br>(300株) |
| 日本アジア投資 | 5,000 | 255.00 | 1,275,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 長野銀行 | 2,000 | 1,651.00 | 3,302,000 | | |
| 名古屋銀行 | 4,700 | 3,670.00 | 17,249,000 | 貸付株式数 | 1,200株 |
| 北洋銀行 | 88,000 | 329.00 | 28,952,000 | | |
| 愛知銀行 | 2,100 | 4,390.00 | 9,219,000 | | |
| 中京銀行 | 2,400 | 2,355.00 | 5,652,000 | | |
| 大光銀行 | 2,000 | 2,125.00 | 4,250,000 | | |
| 愛媛銀行 | 8,100 | 1,155.00 | 9,355,500 | 貸付株式数 | 3,600株 |
| トマト銀行 | 2,300 | 1,303.00 | 2,996,900 | | |
| 京葉銀行 | 25,900 | 800.00 | 20,720,000 | | |
| 栃木銀行 | 29,900 | 295.00 | 8,820,500 | | |
| 北日本銀行 | 1,800 | 2,484.00 | 4,471,200 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 東和銀行 | 10,300 | 934.00 | 9,620,200 | | |
| 福島銀行 | 5,100 | 564.00 | 2,876,400 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| 大東銀行 | 2,900 | 837.00 | 2,427,300 | | |
| リコーリース | 4,600 | 3,695.00 | 16,997,000 | | |
| イオンフィナンシャルサービス | 37,600 | 2,200.00 | 82,720,000 | | |
| ア　コ　ム | 118,700 | 417.00 | 49,497,900 | | |
| ジャックス | 6,500 | 2,058.00 | 13,377,000 | 貸付株式数 | 2,500株 |
| オ　リ　コ | 163,600 | 176.00 | 28,793,600 | 貸付株式数 | 46,100株 |
| 日立キャピタル | 14,000 | 2,805.00 | 39,270,000 | | |
| アプラスフィナンシャル | 31,700 | 103.00 | 3,265,100 | 貸付株式数 | 16,300株 |
| オリックス | 391,800 | 1,839.50 | 720,716,100 | | |
| 三菱ＵＦＪリース | 133,000 | 619.00 | 82,327,000 | | |
| ジャフコ | 9,600 | 4,150.00 | 39,840,000 | 貸付株式数 | 2,200株<br>(2,200株) |
| 九州　リースサービス | 3,000 | 704.00 | 2,112,000 | | |
| トモニホールディングス | 45,100 | 473.00 | 21,332,300 | | |
| 大和証券Ｇ本社 | 471,900 | 626.50 | 295,645,350 | | |
| 野村ホールディングス | 1,079,200 | 511.40 | 551,902,880 | 貸付株式数 | 427,200株 |
| 岡三証券グループ | 49,900 | 558.00 | 27,844,200 | 貸付株式数 | 18,000株 |
| 丸三証券 | 17,800 | 894.00 | 15,913,200 | 貸付株式数 | 6,900株 |
| 東洋証券 | 21,300 | 205.00 | 4,366,500 | | |
| 東海東京ＨＤ | 70,100 | 555.00 | 38,905,500 | | |
| 光世証券 | 1,400 | 1,012.00 | 1,416,800 | | |
| 水戸証券 | 17,100 | 307.00 | 5,249,700 | 貸付株式数 | 400株 |
| いちよし証券 | 12,300 | 957.00 | 11,771,100 | | |
| 松井証券 | 29,000 | 1,286.00 | 37,294,000 | | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 114,500 | 4,386.00 | 502,197,000 | | |
| だいこう証券ビジ | 2,400 | 491.00 | 1,178,400 | | |
| 日本取引所グループ | 159,100 | 2,045.00 | 325,359,500 | | |
| マネックスＧ | 55,400 | 420.00 | 23,268,000 | 貸付株式数 | 21,800株<br>(5,100株) |
| カブドットコム証券 | 43,900 | 419.00 | 18,394,100 | | |
| 極東証券 | 7,800 | 1,312.00 | 10,233,600 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 岩井コスモホールディング | 6,000 | 1,411.00 | 8,466,000 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| 藍澤證券 | 11,000 | 765.00 | 8,415,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| フィデアホール | 56,200 | 155.00 | 8,711,000 | | |
| 池田泉州ＨＤ | 61,600 | 338.00 | 20,820,800 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| アニコム　ホールディングス | 4,500 | 3,765.00 | 16,942,500 | 貸付株式数 | 500株 |
| ＭＳ＆ＡＤ | 152,700 | 3,445.00 | 526,051,500 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ＳＯＮＹ　ＦＨ | 48,000 | 2,380.00 | 114,240,000 | | |
| マネーパートナーズＧＰ | 6,800 | 340.00 | 2,312,000 | | |
| 小林洋行 | 2,000 | 283.00 | 566,000 | 貸付株式数 | 800株 |
| 第一生命ＨＬＤＧＳ | 330,600 | 1,978.00 | 653,926,800 | | |
| 東京海上ＨＤ | 211,800 | 5,605.00 | 1,187,139,000 | 貸付株式数 | 84,400株 |
| アドバンテッジリスクマネ | 2,200 | 1,224.00 | 2,692,800 | 貸付株式数 | 800株 |
| イー・ギャランティ | 5,500 | 1,120.00 | 6,160,000 | 貸付株式数 | 3,300株 |
| アサックス | 2,600 | 608.00 | 1,580,800 | | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 2,500 | 1,686.00 | 4,215,000 | | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 180,800 | 1,613.00 | 291,630,400 | | |
| アドバンスクリエイト | 1,300 | 2,057.00 | 2,674,100 | | |
| 三井不動産 | 313,300 | 2,715.00 | 850,609,500 | | |
| 三菱地所 | 414,300 | 1,821.00 | 754,440,300 | | |
| 平和不動産 | 11,700 | 1,941.00 | 22,709,700 | | |
| 東京建物 | 65,300 | 1,294.00 | 84,498,200 | 貸付株式数 | 8,700株 |
| ダイビル | 18,200 | 1,242.00 | 22,604,400 | | |
| 京阪神ビルディング | 11,700 | 912.00 | 10,670,400 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 住友不動産 | 133,100 | 4,208.00 | 560,084,800 | | |
| 太平洋興発 | 2,300 | 887.00 | 2,040,100 | | |
| 大京 | 9,000 | 2,969.00 | 26,721,000 | | |
| テーオーシー | 14,300 | 851.00 | 12,169,300 | | |
| 東京楽天地 | 900 | 4,845.00 | 4,360,500 | | |
| レオパレス２１ | 73,700 | 493.00 | 36,334,100 | 貸付株式数 | 26,400株 |
| スターツコーポレーション | 8,400 | 2,654.00 | 22,293,600 | 貸付株式数 | 3,100株 |
| フジ住宅 | 8,500 | 907.00 | 7,709,500 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 空港施設 | 8,100 | 599.00 | 4,851,900 | | |
| 明和地所 | 4,200 | 627.00 | 2,633,400 | | |
| ゴールドクレスト | 4,900 | 1,764.00 | 8,643,600 | | |
| リログループ | 31,500 | 3,120.00 | 98,280,000 | 貸付株式数 | 7,900株<br>(7,900株) |
| 日本エスリード | 2,400 | 1,621.00 | 3,890,400 | | |
| 日神不動産 | 9,000 | 513.00 | 4,617,000 | | |
| 日本エスコン | 10,900 | 737.00 | 8,033,300 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| タカラレーベン | 27,900 | 343.00 | 9,569,700 | 貸付株式数 | 11,200株 |
| サンヨーハウジ　名古屋 | 4,000 | 1,044.00 | 4,176,000 | | |
| イオンモール | 30,200 | 2,041.00 | 61,638,200 | | |
| ファースト住建 | 2,600 | 1,215.00 | 3,159,000 | 貸付株式数 | 900株 |
| ランド | 258,500 | 10.00 | 2,585,000 | | |
| カチタス | 6,600 | 3,265.00 | 21,549,000 | 貸付株式数 | 3,100株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 東祥 | 3,600 | 4,230.00 | 15,228,000 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| トーセイ | 8,400 | 1,029.00 | 8,643,600 | | |
| 穴吹興産 | 900 | 3,040.00 | 2,736,000 | 貸付株式数 | 300株 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 9,500 | 1,679.00 | 15,950,500 | 貸付株式数 | 9,500株<br>(9,500株) |
| サンフロンティア不動産 | 8,400 | 1,202.00 | 10,096,800 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| インテリックス | 2,000 | 764.00 | 1,528,000 | | |
| ランドビジネス | 4,200 | 584.00 | 2,452,800 | | |
| グランディハウス | 6,100 | 404.00 | 2,464,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 東武鉄道 | 63,000 | 3,250.00 | 204,750,000 | | |
| 相鉄ホールディングス | 20,700 | 3,450.00 | 71,415,000 | | |
| 東京急行 | 162,300 | 1,976.00 | 320,704,800 | | |
| 京浜急行 | 81,800 | 1,811.00 | 148,139,800 | 貸付株式数 | 25,500株 |
| 小田急電鉄 | 95,800 | 2,545.00 | 243,811,000 | 貸付株式数 | 12,400株 |
| 京王電鉄 | 33,400 | 6,280.00 | 209,752,000 | | |
| 京成電鉄 | 44,700 | 3,680.00 | 164,496,000 | | |
| 富士急行 | 8,200 | 3,220.00 | 26,404,000 | 貸付株式数 | 3,000株<br>(2,200株) |
| 新京成電鉄 | 1,500 | 2,122.00 | 3,183,000 | | |
| 東日本旅客鉄道 | 106,100 | 10,320.00 | 1,094,952,000 | 貸付株式数 | 41,900株 |
| 西日本旅客鉄道 | 53,500 | 7,909.00 | 423,131,500 | | |
| 東海旅客鉄道 | 53,400 | 23,325.00 | 1,245,555,000 | 貸付株式数 | 21,100株 |
| 西武ホールディングス | 76,100 | 2,098.00 | 159,657,800 | | |
| 鴻池運輸 | 9,400 | 1,783.00 | 16,760,200 | | |
| 西日本鉄道 | 16,700 | 2,958.00 | 49,398,600 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| ハマキョウレックス | 4,600 | 4,205.00 | 19,343,000 | | |
| サカイ引越センター | 3,100 | 6,430.00 | 19,933,000 | 貸付株式数 | 1,200株<br>(800株) |
| 近鉄グループＨＬＤＧＳ | 56,600 | 4,730.00 | 267,718,000 | | |
| 阪急阪神ＨＬＤＧＳ | 75,500 | 3,850.00 | 290,675,000 | | |
| 南海電鉄 | 25,300 | 3,035.00 | 76,785,500 | | |
| 京阪ホールディングス | 25,400 | 4,740.00 | 120,396,000 | | |
| 神戸電鉄 | 1,400 | 4,000.00 | 5,600,000 | | |
| 名古屋鉄道 | 45,400 | 2,845.00 | 129,163,000 | | |
| 山陽電鉄 | 4,300 | 2,363.00 | 10,160,900 | | |
| トランコム | 1,600 | 6,520.00 | 10,432,000 | 貸付株式数 | 200株 |
| 日本通運 | 22,200 | 6,840.00 | 151,848,000 | | |
| ヤマトホールディングス | 99,100 | 2,998.50 | 297,151,350 | | |
| 山　九 | 15,700 | 5,320.00 | 83,524,000 | | |
| 日　新 | 4,800 | 1,956.00 | 9,388,800 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 丸　運 | 3,200 | 319.00 | 1,020,800 | |
| 丸全昭和運輸 | 4,500 | 3,115.00 | 14,017,500 | |
| センコーグループＨＬＤＧＳ | 31,000 | 884.00 | 27,404,000 | 貸付株式数　1,100株 |
| トナミホールディングス | 1,400 | 6,520.00 | 9,128,000 | 貸付株式数　500株 |
| ニッコンホールディングス | 21,400 | 2,907.00 | 62,209,800 | |
| 日石輸送 | 700 | 2,887.00 | 2,020,900 | |
| 福山通運 | 7,300 | 4,980.00 | 36,354,000 | |
| セイノーホールディングス | 42,300 | 1,685.00 | 71,275,500 | |
| エスライン | 1,600 | 1,164.00 | 1,862,400 | |
| 神奈川中央交通 | 1,400 | 3,905.00 | 5,467,000 | |
| 日立物流 | 12,500 | 3,070.00 | 38,375,000 | |
| 丸和運輸機関 | 3,000 | 3,355.00 | 10,065,000 | 貸付株式数　800株<br>(800株) |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 5,700 | 1,300.00 | 7,410,000 | |
| 日本郵船 | 47,400 | 1,927.00 | 91,339,800 | |
| 商船三井 | 33,600 | 2,669.00 | 89,678,400 | |
| 川崎汽船 | 17,400 | 1,631.00 | 28,379,400 | 貸付株式数　6,900株 |
| ＮＳユナイテッド海運 | 3,200 | 3,060.00 | 9,792,000 | |
| 明治海運 | 5,900 | 379.00 | 2,236,100 | 貸付株式数　1,000株 |
| 飯野海運 | 27,500 | 451.00 | 12,402,500 | |
| 共栄タンカー | 400 | 1,829.00 | 731,600 | |
| 九州旅客鉄道 | 47,300 | 3,750.00 | 177,375,000 | |
| ＳＧホールディングス | 53,400 | 2,779.00 | 148,398,600 | |
| 日本航空 | 103,300 | 4,094.00 | 422,910,200 | |
| ＡＮＡホールディングス | 103,100 | 4,051.00 | 417,658,100 | |
| パスコ | 1,100 | 1,069.00 | 1,175,900 | |
| 西本ＷＩＳＭＥＴＴＡＣ　ＨＤ | 1,300 | 5,180.00 | 6,734,000 | |
| ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ | 400 | 1,259.00 | 503,600 | |
| ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ | 2,300 | 3,705.00 | 8,521,500 | 貸付株式数　300株 |
| 国際紙パルプ商事 | 10,600 | 320.00 | 3,392,000 | 貸付株式数　1,000株 |
| 総合メディカルＨＤ | 5,100 | 2,665.00 | 13,591,500 | |
| ブックオフＧＨＤ | 3,000 | 783.00 | 2,349,000 | |
| 三菱倉庫 | 19,800 | 2,804.00 | 55,519,200 | 貸付株式数　6,000株 |
| 三井倉庫ＨＯＬＤ | 6,900 | 2,005.00 | 13,834,500 | |
| 住友倉庫 | 21,500 | 1,457.00 | 31,325,500 | |
| 渋沢倉庫 | 3,100 | 1,662.00 | 5,152,200 | |
| ヤマタネ | 2,900 | 1,959.00 | 5,681,100 | 貸付株式数　1,200株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 東陽倉庫 | 9,900 | 314.00 | 3,108,600 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 乾汽船 | 5,200 | 1,027.00 | 5,340,400 | | |
| 日本トランスシティ | 12,600 | 492.00 | 6,199,200 | 貸付株式数 | 6,000株 |
| ケイヒン | 1,000 | 1,430.00 | 1,430,000 | | |
| 中央倉庫 | 3,300 | 1,080.00 | 3,564,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 川西倉庫 | 1,100 | 1,663.00 | 1,829,300 | 貸付株式数 | 400株 |
| 安田倉庫 | 4,600 | 875.00 | 4,025,000 | | |
| 東洋埠頭 | 1,600 | 1,559.00 | 2,494,400 | | |
| 宇徳 | 4,700 | 538.00 | 2,528,600 | | |
| 上　組 | 34,800 | 2,549.00 | 88,705,200 | | |
| サンリツ | 1,400 | 662.00 | 926,800 | | |
| キムラユニティー | 1,500 | 1,116.00 | 1,674,000 | | |
| キユーソー流通システム | 1,400 | 2,509.00 | 3,512,600 | 貸付株式数 | 500株<br>(200株) |
| 近鉄エクスプレス | 10,600 | 1,913.00 | 20,277,800 | | |
| 東海運 | 3,300 | 350.00 | 1,155,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| エーアイテイー | 3,600 | 1,019.00 | 3,668,400 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 内外トランスライン | 1,700 | 1,648.00 | 2,801,600 | 貸付株式数 | 800株 |
| 日本コンセプト | 1,500 | 1,144.00 | 1,716,000 | | |
| 東京放送ＨＤ | 39,000 | 2,126.00 | 82,914,000 | 貸付株式数 | 15,300株 |
| 日本テレビＨＬＤＳ | 53,600 | 1,777.00 | 95,247,200 | | |
| 朝日放送グループＨＤ | 6,100 | 785.00 | 4,788,500 | | |
| テレビ朝日ＨＤ | 16,200 | 2,285.00 | 37,017,000 | 貸付株式数 | 3,100株<br>(100株) |
| スカパーＪＳＡＴＨＤ | 44,700 | 547.00 | 24,450,900 | | |
| テレビ東京ＨＤ | 4,800 | 2,750.00 | 13,200,000 | 貸付株式数 | 2,000株<br>(1,500株) |
| 日本ＢＳ放送 | 1,900 | 1,238.00 | 2,352,200 | 貸付株式数 | 700株 |
| ビジョン | 1,800 | 4,775.00 | 8,595,000 | 貸付株式数 | 700株 |
| ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＬＤＧＳ | 2,300 | 1,207.00 | 2,776,100 | 貸付株式数 | 800株<br>(500株) |
| ワイヤレスゲート | 2,500 | 564.00 | 1,410,000 | 貸付株式数 | 1,300株<br>(1,000株) |
| コネクシオ | 4,100 | 1,477.00 | 6,055,700 | | |
| 日本通信 | 50,500 | 139.00 | 7,019,500 | 貸付株式数 | 22,900株<br>(1,000株) |
| クロップス | 1,000 | 744.00 | 744,000 | | |
| 日本電信電話 | 400,300 | 4,680.00 | 1,873,404,000 | | |
| ＫＤＤＩ | 515,800 | 2,664.00 | 1,374,091,200 | 貸付株式数 | 204,000株 |
| 光通信 | 6,900 | 18,110.00 | 124,959,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| ＮＴＴドコモ | 420,400 | 2,628.50 | 1,105,021,400 | 貸付株式数 | 166,200株 |
| エムティーアイ | 6,900 | 601.00 | 4,146,900 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| ＧＭＯインターネット | 21,300 | 1,490.00 | 31,737,000 | | |
| アイドママーケティングコミュ | 1,300 | 536.00 | 696,800 | | |
| カドカワ | 17,200 | 1,411.00 | 24,269,200 | 貸付株式数 | 6,800株 |
| 学研ホールディングス | 2,000 | 4,395.00 | 8,790,000 | | |
| ゼンリン | 11,700 | 2,817.00 | 32,958,900 | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 昭文社 | 2,700 | 547.00 | 1,476,900 | | |
| インプレスホールディングス | 4,900 | 165.00 | 808,500 | | |
| 東京電力ＨＤ | 476,600 | 689.00 | 328,377,400 | | |
| 中部電力 | 182,400 | 1,702.00 | 310,444,800 | 貸付株式数 | 11,500株 |
| 関西電力 | 243,300 | 1,704.00 | 414,583,200 | | |
| 中国電力 | 82,100 | 1,434.00 | 117,731,400 | 貸付株式数 | 32,600株 |
| 北陸電力 | 58,300 | 1,011.00 | 58,941,300 | 貸付株式数 | 400株 |
| 東北電力 | 139,400 | 1,484.00 | 206,869,600 | | |
| 四国電力 | 53,400 | 1,365.00 | 72,891,000 | | |
| 九州電力 | 122,600 | 1,333.00 | 163,425,800 | 貸付株式数 | 48,600株 |
| 北海道電力 | 55,600 | 778.00 | 43,256,800 | | |
| 沖縄電力 | 11,000 | 2,258.00 | 24,838,000 | 貸付株式数 | 100株 |
| 電源開発 | 47,300 | 2,922.00 | 138,210,600 | | |
| エフオン | 3,600 | 1,022.00 | 3,679,200 | | |
| イーレックス | 10,300 | 693.00 | 7,137,900 | 貸付株式数 | 4,100株 |
| レノバ | 6,200 | 1,166.00 | 7,229,200 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 東京瓦斯 | 116,900 | 2,924.50 | 341,874,050 | | |
| 大阪瓦斯 | 115,500 | 2,069.00 | 238,969,500 | | |
| 東邦瓦斯 | 29,600 | 4,590.00 | 135,864,000 | | |
| 北海道瓦斯 | 3,100 | 1,504.00 | 4,662,400 | | |
| 広島ガス | 11,900 | 361.00 | 4,295,900 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| 西部瓦斯 | 6,700 | 2,498.00 | 16,736,600 | 貸付株式数 | 2,800株 |
| 静岡ガス | 18,100 | 977.00 | 17,683,700 | | |
| メタウォーター | 2,800 | 3,185.00 | 8,918,000 | 貸付株式数 | 1,300株 |
| アイネット | 3,300 | 1,669.00 | 5,507,700 | | |
| 松　竹 | 3,900 | 11,890.00 | 46,371,000 | 貸付株式数 | 1,400株 |
| 東　宝 | 38,600 | 3,950.00 | 152,470,000 | | |
| エイチ・アイ・エス | 10,100 | 3,825.00 | 38,632,500 | 貸付株式数 | 2,600株<br>(1,300株) |
| 東　映 | 2,500 | 13,800.00 | 34,500,000 | | |
| ラックランド | 1,100 | 2,955.00 | 3,250,500 | 貸付株式数 | 400株 |
| ＮＴＴデータ | 155,700 | 1,320.00 | 205,524,000 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 共立メンテナンス | 8,700 | 5,700.00 | 49,590,000 | 貸付株式数 | 3,400株<br>(1,300株) |
| イチネンホールディングス | 5,900 | 1,456.00 | 8,590,400 | 貸付株式数 | 900株 |
| 建設技術研究所 | 3,900 | 1,468.00 | 5,725,200 | | |
| スペース | 3,600 | 1,243.00 | 4,474,800 | | |
| 長　大 | 2,200 | 802.00 | 1,764,400 | | |
| アインホールディングス | 7,900 | 8,750.00 | 69,125,000 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| 燦ホールディングス | 1,200 | 2,576.00 | 3,091,200 | | |
| ピー・シー・エー | 700 | 2,214.00 | 1,549,800 | | |
| スバル興業 | 400 | 5,580.00 | 2,232,000 | | |
| 東京テアトル | 2,400 | 1,350.00 | 3,240,000 | | |
| タナベ経営 | 1,100 | 1,611.00 | 1,772,100 | | |
| ビジネスＢ太田昭和 | 1,000 | 2,068.00 | 2,068,000 | 貸付株式数 | 400株 |
| ナ　ガ　ワ | 1,700 | 6,350.00 | 10,795,000 | | |
| よみうりランド | 1,200 | 4,225.00 | 5,070,000 | | |
| 東京都競馬 | 3,700 | 3,405.00 | 12,598,500 | | |
| 常磐興産 | 2,200 | 1,757.00 | 3,865,400 | | |
| カナモト | 8,500 | 3,340.00 | 28,390,000 | 貸付株式数 | 3,100株<br>(3,100株) |
| 東京ドーム | 21,100 | 1,039.00 | 21,922,900 | | |
| ＤＴＳ | 6,500 | 4,090.00 | 26,585,000 | | |
| スクウェア・エニックス・ＨＤ | 27,200 | 3,700.00 | 100,640,000 | | |
| シーイーシー | 6,300 | 2,455.00 | 15,466,500 | | |
| カプコン | 25,100 | 2,222.00 | 55,772,200 | | |
| 西尾レントオール | 5,800 | 4,145.00 | 24,041,000 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| アイ・エス・ビー | 1,100 | 2,374.00 | 2,611,400 | | |
| アゴーラ・ホスピタリティーＧ | 33,400 | 30.00 | 1,002,000 | 貸付株式数 | 6,500株 |
| 日本空港ビルデング | 18,900 | 4,410.00 | 83,349,000 | | |
| トランス・コスモス | 6,300 | 2,624.00 | 16,531,200 | | |
| 乃村工藝社 | 13,400 | 3,045.00 | 40,803,000 | | |
| ジャステック | 3,300 | 1,065.00 | 3,514,500 | 貸付株式数 | 400株 |
| ＳＣＳＫ | 15,400 | 4,505.00 | 69,377,000 | | |
| 藤田観光 | 2,200 | 3,170.00 | 6,974,000 | | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 3,000 | 1,288.00 | 3,864,000 | | |
| 日本管財 | 6,200 | 2,089.00 | 12,951,800 | | |
| トーカイ | 5,500 | 2,793.00 | 15,361,500 | 貸付株式数 | 300株 |
| 白　洋　舎 | 700 | 3,000.00 | 2,100,000 | 貸付株式数 | 200株 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| セコム | 60,500 | 9,606.00 | 581,163,000 | | |
| 日本システムウエア | 1,900 | 2,474.00 | 4,700,600 | | |
| セントラル警備保障 | 2,800 | 6,340.00 | 17,752,000 | | |
| アイネス | 7,300 | 1,269.00 | 9,263,700 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 丹青社 | 10,700 | 1,290.00 | 13,803,000 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| メイテツク | 7,200 | 5,120.00 | 36,864,000 | | |
| ＴＫＣ | 4,900 | 4,080.00 | 19,992,000 | | |
| 富士ソフト | 8,700 | 5,140.00 | 44,718,000 | | |
| 応用地質 | 6,100 | 1,338.00 | 8,161,800 | 貸付株式数 | 1,100株 |
| 船井総研ホールディン | 11,800 | 2,095.00 | 24,721,000 | 貸付株式数 | 4,600株 |
| ＮＳＤ | 9,500 | 2,392.00 | 22,724,000 | | |
| 進学会ホールディングス | 2,800 | 629.00 | 1,761,200 | | |
| 丸紅建材リース | 500 | 2,095.00 | 1,047,500 | | |
| オ　オ　バ | 4,400 | 732.00 | 3,220,800 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| コナミホールディングス | 23,900 | 5,080.00 | 121,412,000 | | |
| いであ | 1,100 | 1,121.00 | 1,233,100 | | |
| 学　究　社 | 1,900 | 1,649.00 | 3,133,100 | | |
| ベネッセホールディングス | 20,800 | 3,370.00 | 70,096,000 | | |
| イオンディライト | 7,000 | 3,995.00 | 27,965,000 | | |
| ナック | 3,800 | 1,097.00 | 4,168,600 | | |
| 福井コンピュータＨＬＤＳ | 1,900 | 1,755.00 | 3,334,500 | | |
| ニチイ学館 | 8,100 | 1,145.00 | 9,274,500 | 貸付株式数 | 100株 |
| ダイセキ | 9,600 | 2,628.00 | 25,228,800 | | |
| ステップ | 2,100 | 1,505.00 | 3,160,500 | 貸付株式数 | 800株 |
| 日鉄住金物産 | 4,100 | 5,120.00 | 20,992,000 | 貸付株式数 | 1,000株 |
| 泉州電業 | 1,900 | 2,669.00 | 5,071,100 | | |
| 元気寿司 | 1,600 | 5,010.00 | 8,016,000 | | |
| トラスコ中山 | 12,200 | 3,225.00 | 39,345,000 | 貸付株式数 | 4,400株 |
| ヤマダ電機 | 179,000 | 549.00 | 98,271,000 | 貸付株式数 | 74,500株<br>(400株) |
| オートバックスセブン | 23,300 | 1,736.00 | 40,448,800 | | |
| モリト | 4,100 | 813.00 | 3,333,300 | | |
| アークランドサカモト | 9,900 | 1,552.00 | 15,364,800 | | |
| ニトリホールディングス | 25,400 | 15,205.00 | 386,207,000 | | |
| グルメ杵屋 | 4,100 | 1,195.00 | 4,899,500 | | |
| 愛　眼 | 4,700 | 334.00 | 1,569,800 | 貸付株式数 | 1,800株 |
| ケーユーホールディングス | 3,000 | 904.00 | 2,712,000 | | |
| 吉野家ホールディングス | 20,500 | 1,949.00 | 39,954,500 | 貸付株式数 | 8,100株 |
| 加藤産業 | 9,100 | 3,515.00 | 31,986,500 | | |
| 北恵 | 900 | 996.00 | 896,400 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イノテック | 4,000 | 1,172.00 | 4,688,000 | 貸付株式数 2,000株 |
| イエローハット | 5,500 | 2,983.00 | 16,406,500 | |
| 松屋フーズＨＬＤＧＳ | 2,800 | 3,895.00 | 10,906,000 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 4,600 | 1,771.00 | 8,146,600 | |
| ＪＫホールディングス | 5,200 | 615.00 | 3,198,000 | |
| サガミホールディングス | 7,700 | 1,382.00 | 10,641,400 | 貸付株式数 700株 |
| 日　伝 | 4,700 | 1,828.00 | 8,591,600 | |
| 関西スーパーマーケット | 4,400 | 1,100.00 | 4,840,000 | |
| ミロク情報サービス | 5,800 | 2,450.00 | 14,210,000 | |
| 北沢産業 | 4,400 | 250.00 | 1,100,000 | |
| 杉本商事 | 3,100 | 1,800.00 | 5,580,000 | |
| 因幡電機産業 | 8,600 | 4,715.00 | 40,549,000 | |
| 王将フードサービス | 4,300 | 7,930.00 | 34,099,000 | |
| プレナス | 6,600 | 1,985.00 | 13,101,000 | 貸付株式数 2,600株<br>(2,500株) |
| ミニストップ | 4,300 | 2,072.00 | 8,909,600 | |
| アークス | 11,000 | 2,844.00 | 31,284,000 | |
| バローホールディングス | 12,700 | 2,928.00 | 37,185,600 | |
| バイテックホールディングス | 2,700 | 2,432.00 | 6,566,400 | |
| 東　テ　ク | 1,900 | 2,810.00 | 5,339,000 | |
| ミスミグループ本社 | 73,600 | 2,572.00 | 189,299,200 | 貸付株式数 26,500株<br>(26,500株) |
| 藤　　久 | 500 | 795.00 | 397,500 | |
| アルテック | 4,400 | 275.00 | 1,210,000 | |
| ベ　ル　ク | 2,900 | 6,030.00 | 17,487,000 | |
| 大　庄 | 3,100 | 1,718.00 | 5,325,800 | |
| タキヒヨー | 1,700 | 1,967.00 | 3,343,900 | |
| ファーストリテイリング | 7,900 | 59,040.00 | 466,416,000 | 貸付株式数 100株 |
| ソフトバンクグループ | 244,600 | 9,526.00 | 2,330,059,600 | |
| 蔵王産業 | 900 | 1,415.00 | 1,273,500 | |
| スズケン | 26,800 | 6,110.00 | 163,748,000 | |
| サンドラッグ | 22,100 | 3,830.00 | 84,643,000 | |
| サックスバーホールディング | 4,900 | 1,124.00 | 5,507,600 | 貸付株式数 2,800株<br>(2,800株) |
| ジェコス | 4,000 | 1,154.00 | 4,616,000 | |
| ヤマザワ | 1,200 | 1,788.00 | 2,145,600 | 貸付株式数 400株 |
| や　ま　や | 1,000 | 2,540.00 | 2,540,000 | |
| ルネサスイーストン | 5,200 | 449.00 | 2,334,800 | 貸付株式数 1,000株 |
| ベルーナ | 14,400 | 1,279.00 | 18,417,600 | |
| 合計 | | | 140,729,270,900 | |

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

| | |
|---|---|
| トヨタ自動車 | 100,000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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。**

## 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 1,781,446 |
| コール・ローン | 2,124,643 | 3,464,498 |
| 親投資信託受益証券 | 1,294,352,493 | 2,197,794,321 |
| 流動資産合計 | 1,296,477,136 | 2,203,040,265 |
| 資産合計 | 1,296,477,136 | 2,203,040,265 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 527,637 | 1,228,009 |
| 未払受託者報酬 | 83,043 | 234,030 |
| 未払委託者報酬 | 1,183,907 | 3,335,461 |
| その他未払費用 | 20,699 | 58,465 |
| 流動負債合計 | 1,815,286 | 4,855,965 |
| 負債合計 | 1,815,286 | 4,855,965 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 1,139,363,470 | ※1 1,924,332,921 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 155,298,380 | 273,851,379 |
| （分配準備積立金） | 73,113,232 | 58,139,791 |
| 元本等合計 | 1,294,661,850 | 2,198,184,300 |
| 純資産合計 | 1,294,661,850 | 2,198,184,300 |
| 負債純資産合計 | 1,296,477,136 | 2,203,040,265 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 78,013,260 | △ 2,453,172 |
| 営業収益合計 | 78,013,260 | △ 2,453,172 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 441 | 3,022 |
| 受託者報酬 | 110,770 | 403,526 |
| 委託者報酬 | 1,579,473 | 5,751,395 |
| その他費用 | 27,575 | 101,109 |
| 営業費用合計 | 1,718,259 | 6,259,052 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 76,295,001 | △ 8,712,224 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 76,295,001 | △ 8,712,224 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 76,295,001 | △ 8,712,224 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 3,182,202 | 10,155,564 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | － | 155,298,380 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 86,952,827 | 190,474,884 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 86,952,827 | 190,474,884 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,767,246 | 53,054,097 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,767,246 | 53,054,097 |
| 分配金 | ※1　－ | ※1　－ |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 155,298,380 | 273,851,379 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 1,139,363,470円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,218,074,496円 | 1,148,408,392円 |
| 期中一部解約元本額 | 79,711,026円 | 363,438,941円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 1,139,363,470口 | 1,924,332,921口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（73,113,232円）、投資信託約款に規定される収益調整金（82,185,738円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は155,298,970円（1万口当たり1,363.03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（215,714,740円）及び分配準備積立金（58,139,791円）より分配対象額は273,854,531円（1万口当たり1,423.11円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 77,725,025 | △4,592,489 |
| 合計 | 77,725,025 | △4,592,489 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.1363円 | 1.1423円 |

| | | |
|---|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (11,363円) | (11,423円) |

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 1,206,916,157 | 2,197,794,321 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 2,197,794,321 | |
| 合計 | | | 2,197,794,321 | |

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

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 314,544,910 | 509,287,039 |

| | | |
|---|---|---|
| 金銭信託 | ― | 483,926,548 |
| コール・ローン | 367,668,408 | 941,124,553 |
| 株式 | 25,105,407,733 | 35,303,993,367 |
| 投資信託受益証券 | 3,294,270 | ― |
| 投資証券 | 683,496,021 | 970,437,547 |
| 派生商品評価勘定 | 328,748,037 | 14,499,310 |
| 未収入金 | 265,720 | 323,147 |
| 未収配当金 | 43,635,428 | 67,945,267 |
| 差入委託証拠金 | 203,226,657 | 661,940,856 |
| 流動資産合計 | 27,050,287,184 | 38,953,477,634 |
| 資産合計 | 27,050,287,184 | 38,953,477,634 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 8,906,561 | 377,280,834 |
| 未払解約金 | 6,808,700 | ― |
| その他未払費用 | ― | 12,983 |
| 流動負債合計 | 15,715,261 | 377,293,817 |
| 負債合計 | 15,715,261 | 377,293,817 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 14,973,926,481 | 21,183,891,958 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 12,060,645,442 | 17,392,291,859 |
| 元本等合計 | 27,034,571,923 | 38,576,183,817 |
| 純資産合計 | 27,034,571,923 | 38,576,183,817 |
| 負債純資産合計 | 27,050,287,184 | 38,953,477,634 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(3)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 7,765,887,299円 | 14,973,926,481円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,393,246,817円 | 8,674,912,394円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,185,207,635円 | 2,464,946,917円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 12,688,382,275円 | 18,413,212,043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） | 716,933,917円 | 1,206,916,157円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 33,389,265円 | 212,178,578円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 564,376,429円 | 26,245,147円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 968,728,533円 | 54,785,252円 |
| ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 2,116,062円 | 1,270,554,781円 |
| 計 | 14,973,926,481円 | 21,183,891,958円 |

| | | |
|---|---|---|
| 2.　期末日における受益権の総数 | 14,973,926,481口 | 21,183,891,958口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 株式 | 2,371,306,336 | △1,271,807,298 |
| 投資信託受益証券 | 114,158 | ― |
| 投資証券 | 30,348,342 | 13,793,630 |
| 合計 | 2,401,768,836 | △1,258,013,668 |

（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（平成29年1月11日から平成29年11月30日まで、及び平成30年1月11日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 株価指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | 943,559,422 | ― | 964,070,431 | 20,511,009 | 2,681,646,444 | ― | 2,636,051,921 | △45,594,523 |
| 合計 | 943,559,422 | ― | 964,070,431 | 20,511,009 | 2,681,646,444 | ― | 2,636,051,921 | △45,594,523 |

（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 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売　建 | 26,414,411,764 | － | 26,115,081,297 | 299,330,467 | 36,415,975,016 | － | 36,733,162,017 | △317,187,001 |
| アメリカ・ドル | 17,019,454,765 | － | 16,772,889,600 | 246,565,165 | 24,935,326,974 | － | 25,133,324,382 | △197,997,408 |
| イギリス・ポンド | 1,951,877,920 | － | 1,941,043,216 | 10,834,704 | 2,435,684,907 | － | 2,439,125,952 | △3,441,045 |
| イスラエル・シュケル | 32,718,516 | － | 32,283,306 | 435,210 | 43,145,697 | － | 43,382,738 | △237,041 |
| オーストラリア・ドル | 761,597,234 | － | 742,746,031 | 18,851,203 | 906,669,264 | － | 940,605,355 | △33,936,091 |
| カナダ・ドル | 1,048,972,982 | － | 1,035,906,618 | 13,066,364 | 1,316,986,281 | － | 1,314,493,404 | 2,492,877 |
| シンガポール・ドル | 144,469,746 | － | 143,991,540 | 478,206 | 183,301,554 | － | 186,704,792 | △3,403,238 |
| スイス・フラン | 876,908,030 | － | 875,110,848 | 1,797,182 | 1,148,830,400 | － | 1,168,648,170 | △19,817,770 |
| スウェーデン・クローナ | 328,598,965 | － | 323,635,440 | 4,963,525 | 394,475,705 | － | 400,263,705 | △5,788,000 |
| デンマーク・クローネ | 216,956,108 | － | 217,253,736 | △297,628 | 241,414,152 | － | 244,036,380 | △2,622,228 |
| ニュージーランド・ドル | 21,589,677 | － | 21,121,984 | 467,693 | 32,551,226 | － | 34,412,004 | △1,860,778 |
| ノルウェー・クローネ | 79,684,883 | － | 77,686,893 | 1,997,990 | 115,938,512 | － | 115,028,341 | 910,171 |
| ユーロ | 3,568,759,531 | － | 3,574,668,735 | △5,909,204 | 4,196,728,856 | － | 4,243,989,294 | △47,260,438 |
| 香港・ドル | 362,823,407 | － | 356,743,350 | 6,080,057 | 464,921,488 | － | 469,147,500 | △4,226,012 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 合計 | 26,414,411,764 | － | 26,115,081,297 | 299,330,467 | 36,415,975,016 | － | 36,733,162,017 | △317,187,001 |

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.8054円<br>(18,054円) | 1.8210円<br>(18,210円) |

**附属明細表**

**第１ 有価証券明細表**

**(1) 株式**

| 通 貨 | 銘 柄 | 株 式 数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単 価 | 金 額 | |
| アメリカ・ドル | | 株 | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル | |
| | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 1,100 | 101.770 | 111,947.000 | |
| | PALO ALTO NETWORKS INC | 800 | 176.050 | 140,840.000 | |
| | KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 1,659 | 61.520 | 102,061.680 | |
| | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 550 | 147.520 | 81,136.000 | |
| | SYNCHRONY FINANCIAL | 6,200 | 25.970 | 161,014.000 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 15,908 | 73.260 | 1,165,420.080 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ARCONIC INC | 3,950 | 21.340 | 84,293.000 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 1,596 | 123.830 | 197,632.680 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 3,400 | 54.470 | 185,198.000 | |
| AMPHENOL CORP-CL A | 2,400 | 87.010 | 208,824.000 | |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 3,353 | 105.850 | 354,915.050 | |
| QORVO INC | 1,179 | 65.290 | 76,976.910 | |
| AFLAC INC | 7,068 | 45.400 | 320,887.200 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 1,248 | 111.260 | 138,852.480 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 1,000 | 55.910 | 55,910.000 | |
| ADOBE INC | 4,622 | 249.090 | 1,151,293.980 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 1,750 | 43.500 | 76,125.000 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 1,008 | 129.460 | 130,495.680 | |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 4,409 | 16.370 | 72,175.330 | |
| GARMIN LTD | 750 | 65.980 | 49,485.000 | |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 1,942 | 159.210 | 309,185.820 | |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 7,031 | 145.740 | 1,024,697.940 | |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 1,710 | 87.200 | 149,112.000 | |
| WR BERKLEY CORP | 600 | 78.450 | 47,070.000 | |
| AUTOZONE INC | 240 | 825.830 | 198,199.200 | |
| DOLLAR TREE INC | 1,911 | 88.430 | 168,989.730 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 9,683 | 21.900 | 212,057.700 | |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 900 | 88.840 | 79,956.000 | |
| CELANESE CORP | 1,297 | 100.550 | 130,413.350 | |
| DR HORTON INC | 3,306 | 37.350 | 123,479.100 | |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 1,249 | 46.360 | 57,903.640 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 2,450 | 36.990 | 90,625.500 | |
| AUTODESK INC | 1,913 | 145.550 | 278,437.150 | |
| MOODY'S CORP | 1,490 | 156.640 | 233,393.600 | |
| DEVON ENERGY CORP | 4,868 | 26.910 | 130,997.880 | |
| ALBEMARLE CORP | 800 | 96.420 | 77,136.000 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 1,050 | 93.450 | 98,122.500 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 2,200 | 44.670 | 98,274.000 | |
| CITIGROUP INC | 23,328 | 64.900 | 1,513,987.200 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 4,052 | 145.850 | 590,984.200 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 4,453 | 76.350 | 339,986.550 | |
| ALLEGHANY CORP | 138 | 632.000 | 87,216.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| DOMINO'S PIZZA INC | 300 | 280.180 | 84,054.000 | |
| HESS CORP | 2,896 | 54.440 | 157,658.240 | |
| DAVITA INC | 1,000 | 65.660 | 65,660.000 | |
| DANAHER CORP | 5,431 | 107.940 | 586,222.140 | |
| FORTIVE CORP | 3,044 | 74.130 | 225,651.720 | |
| AVNET INC | 1,100 | 43.400 | 47,740.000 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 5,314 | 81.090 | 430,912.260 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 1,200 | 23.140 | 27,768.000 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 1,701 | 21.750 | 36,996.750 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 4,584 | 46.040 | 211,047.360 | |
| BUNGE LTD | 950 | 57.960 | 55,062.000 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 3,246 | 75.700 | 245,722.200 | |
| APPLE INC | 44,642 | 179.550 | 8,015,471.100 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 3,359 | 71.220 | 239,227.980 | |
| BOEING CO/THE | 5,077 | 342.560 | 1,739,177.120 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 1,450 | 81.480 | 118,146.000 | |
| BECTON DICKINSON AND CO | 2,493 | 250.100 | 623,499.300 | |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | 1,500 | 18.120 | 27,180.000 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 1,400 | 62.080 | 86,912.000 | |
| CDK GLOBAL INC | 1,100 | 50.180 | 55,198.000 | |
| NISOURCE INC | 4,026 | 26.050 | 104,877.300 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 1,050 | 91.750 | 96,337.500 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 9,584 | 50.680 | 485,717.120 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 37,919 | 59.450 | 2,254,284.550 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 11,672 | 217.700 | 2,540,994.400 | |
| ANSYS INC | 720 | 159.400 | 114,768.000 | |
| H&R BLOCK INC | 1,600 | 28.240 | 45,184.000 | |
| BB&T CORP | 6,955 | 50.600 | 351,923.000 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 15,131 | 51.820 | 784,088.420 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 30,928 | 110.060 | 3,403,935.680 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 2,275 | 97.870 | 222,654.250 | |
| CIGNA CORP | 2,409 | 222.520 | 536,050.680 | |
| LKQ CORP | 3,300 | 27.780 | 91,674.000 | |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 547 | 130.780 | 71,536.660 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 2,652 | 48.300 | 128,091.600 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 2,650 | 44.120 | 116,918.000 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 1,200 | 127.580 | 153,096.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| DOLLAR GENERAL CORP | 2,672 | 110.890 | 296,298.080 | |
| SERVICENOW INC | 1,681 | 179.100 | 301,067.100 | |
| CATERPILLAR INC | 5,596 | 130.230 | 728,767.080 | |
| CMS ENERGY CORP | 2,500 | 51.310 | 128,275.000 | |
| MOSAIC CO/THE | 3,000 | 36.170 | 108,510.000 | |
| DELTA AIR LINES INC | 1,650 | 58.860 | 97,119.000 | |
| CORNING INC | 7,047 | 31.860 | 224,517.420 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 42,758 | 47.340 | 2,024,163.720 | |
| MORGAN STANLEY | 12,559 | 44.510 | 559,001.090 | |
| WABCO HOLDINGS INC | 320 | 120.250 | 38,480.000 | |
| MSCI INC | 730 | 157.040 | 114,639.200 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 450 | 222.520 | 100,134.000 | |
| MIDDLEBY CORP | 400 | 118.070 | 47,228.000 | |
| COTY INC-CL A | 4,757 | 8.520 | 40,529.640 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 1,734 | 48.500 | 84,099.000 | |
| BROADCOM INC | 3,842 | 235.780 | 905,866.760 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 300 | 117.290 | 35,187.000 | |
| ACUITY BRANDS INC | 350 | 129.060 | 45,171.000 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 700 | 80.610 | 56,427.000 | |
| ARAMARK | 1,700 | 37.840 | 64,328.000 | |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 1,400 | 24.640 | 34,496.000 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 1,350 | 117.670 | 158,854.500 | |
| CENTENE CORP | 1,954 | 141.940 | 277,350.760 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 900 | 106.830 | 96,147.000 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 4,050 | 36.030 | 145,921.500 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 1,797 | 78.030 | 140,219.910 | |
| GARTNER INC | 800 | 153.150 | 122,520.000 | |
| SPLUNK INC | 1,712 | 101.630 | 173,990.560 | |
| AGCO CORP | 500 | 58.500 | 29,250.000 | |
| DOMINION ENERGY INC | 6,301 | 73.750 | 464,698.750 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 4,436 | 58.800 | 260,836.800 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 1,400 | 46.840 | 65,576.000 | |
| DEERE & CO | 2,686 | 149.970 | 402,819.420 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 1,610 | 110.750 | 178,307.500 | |
| VMWARE INC-CLASS A | 833 | 161.480 | 134,512.840 | |
| CHEMOURS CO/THE | 1,400 | 28.500 | 39,900.000 | |
| NASDAQ INC | 850 | 90.390 | 76,831.500 | |
| VAIL RESORTS INC | 390 | 277.770 | 108,330.300 | |
| EAST WEST BANCORP INC | 1,461 | 52.880 | 77,257.680 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TARGA RESOURCES CORP | 2,029 | 45.210 | 91,731.090 | |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 450 | 147.480 | 66,366.000 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 874 | 102.800 | 89,847.200 | |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 405 | 71.820 | 29,087.100 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 2,994 | 79.240 | 237,244.560 | |
| COGNEX CORP | 1,400 | 42.360 | 59,304.000 | |
| TELEFLEX INC | 485 | 271.510 | 131,682.350 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 806 | 106.240 | 85,629.440 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 1,225 | 98.690 | 120,895.250 | |
| IDEX CORP | 700 | 134.360 | 94,052.000 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 7,633 | 63.040 | 481,184.320 | |
| ROLLINS INC | 700 | 63.750 | 44,625.000 | |
| AMETEK INC | 1,982 | 73.220 | 145,122.040 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 2,155 | 65.960 | 142,143.800 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 1,000 | 34.350 | 34,350.000 | |
| XPO LOGISTICS INC | 1,060 | 76.340 | 80,920.400 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 2,820 | 93.020 | 262,316.400 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 4,083 | 231.000 | 943,173.000 | |
| SCANA CORP | 700 | 46.110 | 32,277.000 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 400 | 111.580 | 44,632.000 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 240 | 482.560 | 115,814.400 | |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN | 2,800 | 21.970 | 61,516.000 | |
| UGI CORP | 2,085 | 56.770 | 118,365.450 | |
| CUMMINS INC | 1,300 | 148.200 | 192,660.000 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 6,565 | 52.560 | 345,056.400 | |
| SABRE CORP | 1,600 | 26.040 | 41,664.000 | |
| CDW CORP/DE | 1,300 | 92.390 | 120,107.000 | |
| SIGNATURE BANK | 350 | 122.590 | 42,906.500 | |
| COSTAR GROUP INC | 382 | 370.430 | 141,504.260 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 450 | 243.720 | 109,674.000 | |
| AMERCO | 70 | 348.670 | 24,406.900 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 440 | 135.010 | 59,404.400 | |
| MERCADOLIBRE INC | 383 | 357.990 | 137,110.170 | |
| HANESBRANDS INC | 2,900 | 15.660 | 45,414.000 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 837 | 139.130 | 116,451.810 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 2,313 | 76.460 | 176,851.980 | |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC | 2,245 | 17.680 | 39,691.600 | |
| IPG PHOTONICS CORP | 250 | 141.290 | 35,322.500 | |
| COPART INC | 1,778 | 51.710 | 91,940.380 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 979 | 112.000 | 109,648.000 | |
| SEATTLE GENETICS INC | 1,000 | 62.880 | 62,880.000 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 650 | 228.700 | 148,655.000 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 500 | 367.370 | 183,685.000 | |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 2,500 | 27.150 | 67,875.000 | |
| KINDER MORGAN INC | 17,169 | 16.870 | 289,641.030 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 2,689 | 144.500 | 388,560.500 | |
| CABOT OIL & GAS CORP | 4,608 | 24.690 | 113,771.520 | |
| T-MOBILE US INC | 3,449 | 68.680 | 236,877.320 | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 700 | 36.800 | 25,760.000 | |
| COCA-COLA CO/THE | 36,383 | 48.980 | 1,782,039.340 | |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 1,600 | 48.730 | 77,968.000 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 1,946 | 75.870 | 147,643.020 | |
| EATON VANCE CORP | 1,250 | 40.700 | 50,875.000 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 2,200 | 33.500 | 73,700.000 | |
| CSX CORP | 8,073 | 71.770 | 579,399.210 | |
| FLUOR CORP | 1,290 | 41.080 | 52,993.200 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 1,050 | 161.810 | 169,900.500 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 1,150 | 119.740 | 137,701.000 | |
| AUTOLIV INC | 800 | 86.330 | 69,064.000 | |
| AMAZON.COM INC | 3,753 | 1,673.570 | 6,280,908.210 | |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 1,600 | 20.870 | 33,392.000 | |
| FLOWSERVE CORP | 900 | 47.740 | 42,966.000 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 1,945 | 162.800 | 316,646.000 | |
| EXXON MOBIL CORP | 38,514 | 79.060 | 3,044,916.840 | |
| FLIR SYSTEMS INC | 1,613 | 45.670 | 73,665.710 | |
| AES CORP | 4,000 | 15.440 | 61,760.000 | |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 650 | 182.940 | 118,911.000 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 350 | 220.120 | 77,042.000 | |
| EOG RESOURCES INC | 5,099 | 105.470 | 537,791.530 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 1,250 | 68.110 | 85,137.500 | |
| ABIOMED INC | 355 | 331.990 | 117,856.450 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 1,360 | 90.500 | 123,080.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 2,500 | 71.570 | 178,925.000 | |
| FORD MOTOR CO | 32,129 | 9.370 | 301,048.730 | |
| MACY'S INC | 2,200 | 33.740 | 74,228.000 | |
| DISCOVERY INC - A | 1,100 | 31.630 | 34,793.000 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 2,416 | 24.920 | 60,206.720 | |
| DISCOVERY INC-C | 2,149 | 28.660 | 61,590.340 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 1,824 | 52.630 | 95,997.120 | |
| FORTINET INC | 1,050 | 73.900 | 77,595.000 | |
| MARKEL CORP | 110 | 1,116.150 | 122,776.500 | |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 800 | 21.820 | 17,456.000 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 4,399 | 177.120 | 779,150.880 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 11,450 | 11.820 | 135,339.000 | |
| US BANCORP | 14,281 | 54.040 | 771,745.240 | |
| UNITED RENTALS INC | 1,115 | 115.920 | 129,250.800 | |
| F5 NETWORKS INC | 550 | 173.530 | 95,441.500 | |
| FASTENAL CO | 2,907 | 59.260 | 172,268.820 | |
| FISERV INC | 3,500 | 78.440 | 274,540.000 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 77,045 | 7.940 | 611,737.300 | |
| NEKTAR THERAPEUTICS | 1,401 | 39.260 | 55,003.260 | |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 2,149 | 51.560 | 110,802.440 | |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 2,250 | 23.070 | 51,907.500 | |
| GENERAL MOTORS CO | 12,263 | 36.760 | 450,787.880 | |
| TRIPADVISOR INC | 700 | 63.540 | 44,478.000 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 2,316 | 182.170 | 421,905.720 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 3,329 | 194.850 | 648,655.650 | |
| ALPHABET INC-CL A | 2,721 | 1,094.580 | 2,978,352.180 | |
| ALPHABET INC-CL C | 2,890 | 1,088.300 | 3,145,187.000 | |
| OWENS CORNING | 800 | 51.590 | 41,272.000 | |
| GENERAL MILLS INC | 5,556 | 42.210 | 234,518.760 | |
| FIRSTENERGY CORP | 4,488 | 37.150 | 166,729.200 | |
| GENUINE PARTS CO | 1,200 | 103.090 | 123,708.000 | |
| IHS MARKIT LTD | 3,355 | 52.800 | 177,144.000 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 5,850 | 27.540 | 161,109.000 | |
| HARRIS CORP | 982 | 143.130 | 140,553.660 | |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 950 | 38.420 | 36,499.000 | |
| HALLIBURTON CO | 7,826 | 31.890 | 249,571.140 | |
| HOME DEPOT INC | 10,605 | 175.660 | 1,862,874.300 | |
| ASSURANT INC | 286 | 97.800 | 27,970.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 10,745 | 14.500 | 155,802.500 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 350 | 214.850 | 75,197.500 | |
| HERSHEY CO/THE | 1,358 | 107.450 | 145,917.100 | |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 1,400 | 42.490 | 59,486.000 | |
| HUMANA INC | 1,288 | 330.290 | 425,413.520 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 3,419 | 82.910 | 283,469.290 | |
| HELMERICH & PAYNE | 1,336 | 61.150 | 81,696.400 | |
| HENRY SCHEIN INC | 1,100 | 89.140 | 98,054.000 | |
| HP INC | 14,150 | 22.860 | 323,469.000 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 13,250 | 15.120 | 200,340.000 | |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 1,100 | 39.890 | 43,879.000 | |
| HOLLYFRONTIER CORP | 1,783 | 61.680 | 109,975.440 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 1,350 | 30.380 | 41,013.000 | |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 850 | 39.620 | 33,677.000 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 3,600 | 28.380 | 102,168.000 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 5,973 | 51.190 | 305,757.870 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 8,462 | 121.480 | 1,027,963.760 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 4,047 | 45.740 | 185,109.780 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 1,500 | 43.420 | 65,130.000 | |
| ZOETIS INC | 4,663 | 92.770 | 432,586.510 | |
| INGERSOLL-RAND PLC | 2,548 | 103.370 | 263,386.760 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 1,750 | 61.650 | 107,887.500 | |
| ALLEGION PLC | 1,110 | 91.750 | 101,842.500 | |
| LEGGETT & PLATT INC | 1,572 | 38.780 | 60,962.160 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C | 5,108 | 24.360 | 124,430.880 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 2,665 | 78.300 | 208,669.500 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 2,850 | 28.590 | 81,481.500 | |
| JM SMUCKER CO/THE | 900 | 103.440 | 93,096.000 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 24,409 | 145.850 | 3,560,052.650 | |
| ABBVIE INC | 14,059 | 89.910 | 1,264,044.690 | |
| HOLOGIC INC | 3,042 | 44.410 | 135,095.220 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 3,141 | 114.950 | 361,057.950 | |
| KROGER CO | 7,160 | 30.360 | 217,377.600 | |
| KLA-TENCOR CORP | 1,520 | 96.690 | 146,968.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LOCKHEED MARTIN CORP | 2,288 | 302.420 | 691,936.960 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 730 | 191.680 | 139,926.400 | |
| L BRANDS INC | 1,950 | 33.590 | 65,500.500 | |
| LOWE'S COS INC | 7,606 | 93.200 | 708,879.200 | |
| ELI LILLY & CO | 8,698 | 117.000 | 1,017,666.000 | |
| LAM RESEARCH CORP | 1,477 | 152.750 | 225,611.750 | |
| JONES LANG LASALLE INC | 300 | 141.190 | 42,357.000 | |
| LOEWS CORP | 2,550 | 47.980 | 122,349.000 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 1,800 | 62.490 | 112,482.000 | |
| MCDONALD'S CORP | 7,243 | 189.260 | 1,370,810.180 | |
| 3M CO | 5,513 | 204.560 | 1,127,739.280 | |
| FACEBOOK INC-CLASS A | 21,696 | 138.680 | 3,008,801.280 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V | 1,717 | 106.000 | 182,002.000 | |
| MANPOWERGROUP INC | 650 | 80.150 | 52,097.500 | |
| S&P GLOBAL INC | 2,387 | 180.350 | 430,495.450 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 540 | 196.810 | 106,277.400 | |
| CONCHO RESOURCES INC | 1,800 | 131.500 | 236,700.000 | |
| FIRST DATA CORP- CLASS A | 5,832 | 18.970 | 110,633.040 | |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 1,900 | 26.000 | 49,400.000 | |
| PHILLIPS 66 | 3,847 | 92.680 | 356,539.960 | |
| TECHNIPFMC PLC | 4,561 | 23.690 | 108,050.090 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 5,659 | 27.320 | 154,603.880 | |
| MATTEL INC | 3,600 | 13.760 | 49,536.000 | |
| DXC TECHNOLOGY CO | 2,429 | 62.310 | 151,350.990 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 1,029 | 149.050 | 153,372.450 | |
| MYLAN NV | 4,888 | 34.040 | 166,387.520 | |
| METLIFE INC | 7,519 | 44.390 | 333,768.410 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 6,124 | 16.070 | 98,412.680 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 423 | 236.310 | 99,959.130 | |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 1,349 | 43.110 | 58,155.390 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 1,435 | 132.580 | 190,252.300 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 210 | 630.920 | 132,493.200 | |
| BAKER HUGHES A GE CO | 3,784 | 23.110 | 87,448.240 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 1,100 | 171.770 | 188,947.000 | |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 536 | 40.040 | 21,461.440 | |
| MERCK & CO. INC. | 24,803 | 77.910 | 1,932,401.730 | |
| DOWDUPONT INC | 21,558 | 57.240 | 1,233,979.920 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MASCO CORP | 3,543 | 31.280 | 110,825.040 | |
| M & T BANK CORP | 1,323 | 168.690 | 223,176.870 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 4,504 | 87.170 | 392,613.680 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 2,783 | 121.840 | 339,080.720 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 1,200 | 145.300 | 174,360.000 | |
| SQUARE INC - A | 2,791 | 69.900 | 195,090.900 | |
| TRANSUNION | 2,029 | 63.830 | 129,511.070 | |
| VISTRA ENERGY CORP | 2,500 | 23.200 | 58,000.000 | |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 1,100 | 43.800 | 48,180.000 | |
| WORLDPAY INC-CLASS A | 2,876 | 85.580 | 246,128.080 | |
| NETAPP INC | 2,300 | 67.400 | 155,020.000 | |
| NIKE INC -CL B | 11,589 | 74.340 | 861,526.260 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 2,553 | 168.440 | 430,027.320 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 2,050 | 74.420 | 152,561.000 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 1,050 | 76.270 | 80,083.500 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 3,300 | 26.480 | 87,384.000 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 1,440 | 260.670 | 375,364.800 | |
| APTIV PLC | 2,680 | 71.500 | 191,620.000 | |
| NEWMONT MINING CORP | 4,150 | 32.340 | 134,211.000 | |
| MCKESSON CORP | 1,769 | 127.010 | 224,680.690 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 2,387 | 55.340 | 132,096.580 | |
| XYLEM INC | 1,972 | 71.300 | 140,603.600 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 14,609 | 86.960 | 1,270,398.640 | |
| NUCOR CORP | 2,700 | 59.980 | 161,946.000 | |
| WESTERN UNION CO | 3,600 | 18.680 | 67,248.000 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 1,300 | 65.860 | 85,618.000 | |
| NEWELL BRANDS INC | 4,058 | 23.800 | 96,580.400 | |
| EVERGY INC | 2,400 | 58.820 | 141,168.000 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 6,797 | 70.910 | 481,975.270 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 800 | 84.630 | 67,704.000 | |
| LINDE PLC | 4,733 | 159.310 | 754,014.230 | |
| PAYCHEX INC | 2,675 | 69.920 | 187,036.000 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 700 | 354.850 | 248,395.000 | |
| ALTRIA GROUP INC | 17,446 | 55.940 | 975,929.240 | |
| P G & E CORP | 4,479 | 26.760 | 119,858.040 | |
| PFIZER INC | 53,006 | 45.510 | 2,412,303.060 | |
| ALKERMES PLC | 1,050 | 35.750 | 37,537.500 | |
| XCEL ENERGY INC | 4,050 | 51.530 | 208,696.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| STRYKER CORP | 3,126 | 170.910 | 534,264.660 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 1,239 | 168.900 | 209,267.100 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 1,650 | 149.170 | 246,130.500 | |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 400 | 96.390 | 38,556.000 | |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 22,580 | 92.820 | 2,095,875.600 | |
| EXELON CORP | 9,042 | 45.670 | 412,948.140 | |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 2,207 | 123.340 | 272,211.380 | |
| NVR INC | 30 | 2,473.770 | 74,213.100 | |
| CONOCOPHILLIPS | 10,605 | 66.870 | 709,156.350 | |
| PEPSICO INC | 12,693 | 118.270 | 1,501,201.110 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 3,550 | 92.910 | 329,830.500 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 1,350 | 92.480 | 124,848.000 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 5,787 | 161.070 | 932,112.090 | |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 600 | 55.310 | 33,186.000 | |
| PENTAIR PLC | 1,575 | 42.470 | 66,890.250 | |
| QUALCOMM INC | 12,536 | 58.110 | 728,466.960 | |
| INVESCO LTD | 3,700 | 20.250 | 74,925.000 | |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 819 | 177.670 | 145,511.730 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 2,300 | 49.680 | 114,264.000 | |
| RAYTHEON COMPANY | 2,567 | 173.580 | 445,579.860 | |
| RED HAT INC | 1,530 | 177.890 | 272,171.700 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 745 | 359.570 | 267,879.650 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 2,050 | 76.790 | 157,419.500 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 450 | 1,865.150 | 839,317.500 | |
| ROSS STORES INC | 3,618 | 85.940 | 310,930.920 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 844 | 96.500 | 81,446.000 | |
| RESMED INC | 1,383 | 110.500 | 152,821.500 | |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 1,200 | 87.940 | 105,528.000 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 800 | 61.820 | 49,456.000 | |
| RALPH LAUREN CORP | 400 | 111.290 | 44,516.000 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 9,250 | 16.210 | 149,942.500 | |
| CHEVRON CORP | 17,478 | 118.850 | 2,077,260.300 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 3,103 | 54.720 | 169,796.160 | |
| TESLA INC | 1,194 | 341.170 | 407,356.980 | |
| SYMANTEC CORP | 5,400 | 22.580 | 121,932.000 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 1,581 | 127.460 | 201,514.260 | |
| SYNOPSYS INC | 1,100 | 89.520 | 98,472.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 1,605 | 330.330 | 530,179.650 | |
| CBRE GROUP INC - A | 2,800 | 43.140 | 120,792.000 | |
| TWITTER INC | 5,700 | 31.300 | 178,410.000 | |
| SOUTHERN CO/THE | 8,927 | 46.540 | 415,462.580 | |
| SYSCO CORP | 4,392 | 67.540 | 296,635.680 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 2,482 | 130.630 | 324,223.660 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 1,000 | 53.480 | 53,480.000 | |
| STERICYCLE INC | 500 | 48.210 | 24,105.000 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 2,300 | 34.980 | 80,454.000 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 12,094 | 45.900 | 555,114.600 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 2,026 | 45.810 | 92,811.060 | |
| AT&T INC | 66,294 | 30.570 | 2,026,607.580 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 1,758 | 53.230 | 93,578.340 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 3,627 | 18.500 | 67,099.500 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 761 | 419.760 | 319,437.360 | |
| SEMPRA ENERGY | 2,068 | 112.670 | 233,001.560 | |
| TIFFANY & CO | 1,086 | 89.770 | 97,490.220 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 2,349 | 42.650 | 100,184.850 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 9,023 | 97.430 | 879,110.890 | |
| SALESFORCE.COM INC | 6,351 | 139.720 | 887,361.720 | |
| WESTROCK CO | 2,321 | 46.350 | 107,578.350 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 8,388 | 34.270 | 287,456.760 | |
| UNION PACIFIC CORP | 6,985 | 150.480 | 1,051,102.800 | |
| MARATHON OIL CORP | 6,100 | 16.550 | 100,955.000 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 6,083 | 64.900 | 394,786.700 | |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 7,879 | 121.200 | 954,934.800 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 6,448 | 113.260 | 730,300.480 | |
| UNUM GROUP | 1,900 | 36.390 | 69,141.000 | |
| SPRINT CORP | 4,114 | 6.320 | 26,000.480 | |
| ANTERO RESOURCES CORP | 1,000 | 13.480 | 13,480.000 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 1,432 | 124.950 | 178,928.400 | |
| VOYA FINANCIAL INC | 1,800 | 44.670 | 80,406.000 | |
| AMEREN CORPORATION | 1,850 | 67.820 | 125,467.000 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 8,773 | 282.550 | 2,478,811.150 | |
| VERISIGN INC | 1,085 | 156.660 | 169,976.100 | |
| VALERO ENERGY CORP | 3,882 | 79.470 | 308,502.540 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ULTA BEAUTY INC | 480 | 300.370 | 144,177.600 | |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 3,008 | 33.180 | 99,805.440 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 992 | 137.860 | 136,757.120 | |
| ANTHEM INC | 2,346 | 292.170 | 685,430.820 | |
| WALT DISNEY CO/THE | 13,383 | 116.610 | 1,560,591.630 | |
| WELLS FARGO & CO | 42,006 | 54.040 | 2,270,004.240 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 4,225 | 92.720 | 391,742.000 | |
| WILLIAMS COS INC | 10,790 | 25.560 | 275,792.400 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 1,050 | 94.670 | 99,403.500 | |
| WHIRLPOOL CORP | 500 | 126.400 | 63,200.000 | |
| WALMART INC | 13,209 | 97.290 | 1,285,103.610 | |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 900 | 81.240 | 73,116.000 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 1,956 | 114.960 | 224,861.760 | |
| WYNN RESORTS LTD | 717 | 108.120 | 77,522.040 | |
| XEROX CORP | 1,988 | 26.880 | 53,437.440 | |
| WABTEC CORP | 644 | 92.660 | 59,673.040 | |
| TJX COMPANIES INC | 11,206 | 47.490 | 532,172.940 | |
| WATERS CORP | 650 | 203.490 | 132,268.500 | |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 350 | 95.070 | 33,274.500 | |
| ALLERGAN PLC | 3,129 | 155.240 | 485,745.960 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 8,064 | 84.850 | 684,230.400 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 1,536 | 158.490 | 243,440.640 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 2,545 | 45.520 | 115,848.400 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 2,869 | 71.000 | 203,699.000 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 4,250 | 54.520 | 231,710.000 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 16,227 | 139.100 | 2,257,175.700 | |
| PPL CORP | 5,900 | 30.670 | 180,953.000 | |
| PULTEGROUP INC | 1,900 | 26.730 | 50,787.000 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 2,012 | 108.470 | 218,241.640 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 2,062 | 97.000 | 200,014.000 | |
| NVIDIA CORP | 5,259 | 157.360 | 827,556.240 | |
| IAC/INTERACTIVECORP | 859 | 180.280 | 154,860.520 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 4,175 | 133.650 | 557,988.750 | |
| QURATE RETAIL INC | 4,288 | 22.440 | 96,222.720 | |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 1,200 | 39.280 | 47,136.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TYSON FOODS INC-CL A | 2,450 | 57.720 | 141,414.000 | |
| NETFLIX INC | 3,986 | 288.750 | 1,150,957.500 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 3,575 | 248.570 | 888,637.750 | |
| TORCHMARK CORP | 1,215 | 87.320 | 106,093.800 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 1,300 | 96.190 | 125,047.000 | |
| TEXTRON INC | 2,210 | 55.960 | 123,671.600 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A | 10,350 | 49.530 | 512,635.500 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 3,200 | 49.300 | 157,760.000 | |
| NEWS CORP - CLASS A | 2,900 | 13.210 | 38,309.000 | |
| OGE ENERGY CORP | 1,200 | 38.890 | 46,668.000 | |
| OMNICOM GROUP | 1,850 | 77.180 | 142,783.000 | |
| ORACLE CORP | 27,501 | 47.900 | 1,317,297.900 | |
| MASTERCARD INC - A | 8,498 | 196.660 | 1,671,216.680 | |
| ONEOK INC | 3,736 | 61.340 | 229,166.240 | |
| CENTURYLINK INC | 9,747 | 18.620 | 181,489.140 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 900 | 293.870 | 264,483.000 | |
| YUM! BRANDS INC | 2,524 | 91.860 | 231,854.640 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 1,191 | 111.910 | 133,284.810 | |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 400 | 196.700 | 78,680.000 | |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 1,775 | 64.310 | 114,150.250 | |
| NOBLE ENERGY INC | 3,750 | 24.270 | 91,012.500 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 88,046 | 28.040 | 2,468,809.840 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 1,497 | 96.750 | 144,834.750 | |
| NORDSTROM INC | 800 | 52.300 | 41,840.000 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 6,584 | 111.310 | 732,865.040 | |
| ANALOG DEVICES INC | 3,336 | 89.520 | 298,638.720 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 9,545 | 21.430 | 204,549.350 | |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 2,394 | 53.120 | 127,169.280 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 8,469 | 43.440 | 367,893.360 | |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 5,105 | 53.700 | 274,138.500 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 1,569 | 71.230 | 111,759.870 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 1,784 | 111.630 | 199,147.920 | |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 1,200 | 17.550 | 21,060.000 | |
| AVERY DENNISON CORP | 650 | 95.330 | 61,964.500 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 5,353 | 70.300 | 376,315.900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EMERSON ELECTRIC CO | 5,656 | 67.330 | 380,818.480 | |
| AON PLC | 2,296 | 163.680 | 375,809.280 | |
| AMGEN INC | 6,083 | 202.370 | 1,231,016.710 | |
| TAPESTRY INC | 2,550 | 38.010 | 96,925.500 | |
| EATON CORP PLC | 4,102 | 76.010 | 311,793.020 | |
| CELGENE CORP | 7,024 | 70.160 | 492,803.840 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 1,506 | 196.210 | 295,492.260 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 9,164 | 36.540 | 334,852.560 | |
| CIT GROUP INC | 900 | 46.290 | 41,661.000 | |
| CIMAREX ENERGY CO | 800 | 83.600 | 66,880.000 | |
| CME GROUP INC | 3,041 | 188.910 | 574,475.310 | |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 3,389 | 32.730 | 110,921.970 | |
| ECOLAB INC | 2,364 | 158.390 | 374,433.960 | |
| EQUIFAX INC | 1,256 | 102.800 | 129,116.800 | |
| GAP INC/THE | 2,820 | 26.650 | 75,153.000 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 11,775 | 69.690 | 820,599.750 | |
| HORMEL FOODS CORP | 2,200 | 45.230 | 99,506.000 | |
| STATE STREET CORP | 3,000 | 72.370 | 217,110.000 | |
| SUNTRUST BANKS INC | 4,615 | 62.490 | 288,391.350 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 11,510 | 44.160 | 508,281.600 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 4,541 | 68.020 | 308,878.820 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 1,300 | 39.630 | 51,519.000 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 800 | 50.930 | 40,744.000 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 2,450 | 55.020 | 134,799.000 | |
| FEDEX CORP | 2,283 | 227.500 | 519,382.500 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 4,569 | 88.870 | 406,047.030 | |
| FMC CORP | 1,142 | 83.050 | 94,843.100 | |
| FLEX LTD | 4,500 | 8.550 | 38,475.000 | |
| CERNER CORP | 2,368 | 57.350 | 135,804.800 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 754 | 141.580 | 106,751.320 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 1,350 | 110.460 | 149,121.000 | |
| INTEL CORP | 42,771 | 47.700 | 2,040,176.700 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 2,800 | 24.350 | 68,180.000 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 2,850 | 44.280 | 126,198.000 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 2,856 | 135.900 | 388,130.400 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 15,300 | 6.320 | 96,696.000 | |
| ILLUMINA INC | 1,307 | 337.960 | 441,713.720 | |
| SEALED AIR CORP | 1,450 | 36.410 | 52,794.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| INTUITIVE SURGICAL INC | 1,028 | 520.970 | 535,557.160 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 1,236 | 110.380 | 136,429.680 | |
| SNAP-ON INC | 500 | 164.000 | 82,000.000 | |
| CARMAX INC | 1,990 | 66.090 | 131,519.100 | |
| COMERICA INC | 1,476 | 78.990 | 116,589.240 | |
| INGREDION INC | 530 | 103.810 | 55,019.300 | |
| DUKE ENERGY CORP | 6,064 | 87.600 | 531,206.400 | |
| TARGET CORP | 4,932 | 71.170 | 351,010.440 | |
| DOVER CORP | 1,200 | 84.040 | 100,848.000 | |
| WW GRAINGER INC | 400 | 311.190 | 124,476.000 | |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 1,116 | 65.100 | 72,651.600 | |
| CINTAS CORP | 763 | 188.040 | 143,474.520 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 3,442 | 32.270 | 111,073.340 | |
| CLOROX COMPANY | 1,278 | 166.050 | 212,211.900 | |
| ENTERGY CORP | 1,600 | 85.870 | 137,392.000 | |
| MICROSOFT CORP | 66,632 | 110.190 | 7,342,180.080 | |
| INCYTE CORP | 1,447 | 64.790 | 93,751.130 | |
| CVS HEALTH CORP | 12,121 | 80.000 | 969,680.000 | |
| MEDTRONIC PLC | 12,179 | 96.600 | 1,176,491.400 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 11,372 | 37.910 | 431,112.520 | |
| BLACKROCK INC | 1,057 | 422.940 | 447,047.580 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 5,636 | 27.740 | 156,342.640 | |
| HASBRO INC | 1,000 | 96.850 | 96,850.000 | |
| KELLOGG CO | 2,620 | 63.250 | 165,715.000 | |
| KEYCORP | 8,773 | 18.140 | 159,142.220 | |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 750 | 101.180 | 75,885.000 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 13,302 | 44.530 | 592,338.060 | |
| KOHLS CORP | 1,650 | 67.100 | 110,715.000 | |
| COOPER COS INC/THE | 350 | 277.420 | 97,097.000 | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 4,828 | 10.560 | 50,983.680 | |
| APACHE CORP | 3,673 | 35.540 | 130,538.420 | |
| CHUBB LTD | 4,288 | 134.210 | 575,492.480 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 1,000 | 76.470 | 76,470.000 | |
| ALLSTATE CORP | 3,410 | 88.480 | 301,716.800 | |
| EBAY INC | 9,053 | 29.520 | 267,244.560 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 10,254 | 84.260 | 864,002.040 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 1,283 | 79.040 | 101,408.320 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | XILINX INC | 2,200 | 91.200 | 200,640.000 | |
| | EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 5,412 | 101.220 | 547,802.640 | |
| | DISH NETWORK CORP-A | 1,500 | 32.960 | 49,440.000 | |
| | ZIONS BANCORP NA | 1,900 | 48.210 | 91,599.000 | |
| | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 2,044 | 141.500 | 289,226.000 | |
| | TOLL BROTHERS INC | 1,200 | 33.610 | 40,332.000 | |
| | TRIMBLE INC | 2,200 | 37.400 | 82,280.000 | |
| | LENNAR CORP-A | 2,260 | 43.040 | 97,270.400 | |
| | LEAR CORP | 600 | 134.870 | 80,922.000 | |
| | E*TRADE FINANCIAL CORP | 2,300 | 51.460 | 118,358.000 | |
| | PROGRESSIVE CORP | 5,067 | 65.190 | 330,317.730 | |
| | PACCAR INC | 3,525 | 61.310 | 216,117.750 | |
| | PVH CORP | 550 | 109.770 | 60,373.500 | |
| | BIOGEN INC | 1,899 | 326.610 | 620,232.390 | |
| | IDEXX LABORATORIES INC | 742 | 201.120 | 149,231.040 | |
| | STARBUCKS CORP | 12,484 | 66.880 | 834,929.920 | |
| | PERRIGO CO PLC | 900 | 64.110 | 57,699.000 | |
| | EVERSOURCE ENERGY | 2,400 | 67.070 | 160,968.000 | |
| | INTUIT INC | 2,097 | 209.190 | 438,671.430 | |
| | BORGWARNER INC | 1,550 | 39.370 | 61,023.500 | |
| | BEST BUY CO INC | 2,300 | 64.070 | 147,361.000 | |
| | BALL CORP | 2,892 | 49.570 | 143,356.440 | |
| | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 13,142 | 37.040 | 486,779.680 | |
| | ELECTRONIC ARTS INC | 3,024 | 86.390 | 261,243.360 | |
| | VULCAN MATERIALS CO | 1,050 | 106.920 | 112,266.000 | |
| | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 2,303 | 179.450 | 413,273.350 | |
| | VF CORP | 3,204 | 79.460 | 254,589.840 | |
| | CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 2,841 | 55.350 | 157,249.350 | |
| | VIACOM INC-CLASS B | 3,071 | 32.030 | 98,364.130 | |
| | MOHAWK INDUSTRIES INC | 480 | 127.380 | 61,142.400 | |
| | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 1,003 | 121.190 | 121,553.570 | |
| | CARNIVAL CORP | 3,814 | 60.730 | 231,624.220 | |
| | COMCAST CORP-CLASS A | 41,124 | 39.420 | 1,621,108.080 | |
| | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 2,100 | 36.990 | 77,679.000 | |
| | JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 2,200 | 64.900 | 142,780.000 | |
| | DAIRY FARM INTL HLDGS LTD | 5,600 | 8.850 | 49,560.000 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 11,000 | 6.380 | 70,180.000 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | | | アメリカ・ドル<br>214,062,461.840 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | (24,289,667,546) | |
| イギリス・ポンド | | 株 | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド | |
| | MERLIN ENTERTAINMENT | 5,000 | 3.450 | 17,250.000 | |
| | TUI AG-DI | 4,802 | 11.960 | 57,431.920 | |
| | BP PLC | 181,202 | 5.221 | 946,055.640 | |
| | UNILEVER PLC | 11,199 | 42.545 | 476,461.450 | |
| | BARCLAYS PLC | 150,591 | 1.672 | 251,848.380 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 14,034 | 8.476 | 118,952.180 | |
| | MARKS & SPENCER GROUP PLC | 10,500 | 3.027 | 31,783.500 | |
| | RANDGOLD RESOURCES LTD | 1,012 | 64.500 | 65,274.000 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 22,506 | 15.485 | 348,505.410 | |
| | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 50,836 | 2.214 | 112,550.900 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 1,758 | 30.090 | 52,898.220 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 29,337 | 4.903 | 143,839.310 | |
| | AVIVA PLC | 32,789 | 4.114 | 134,893.940 | |
| | GLAXOSMITHKLINE PLC | 45,560 | 15.976 | 727,866.560 | |
| | INFORMA PLC | 11,000 | 7.096 | 78,056.000 | |
| | MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 3,133 | 15.730 | 49,282.090 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 40,000 | 1.844 | 73,760.000 | |
| | MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 2,900 | 3.654 | 10,596.600 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 13,352 | 4.373 | 58,388.290 | |
| | DCC PLC | 938 | 59.350 | 55,670.300 | |
| | GVC HOLDINGS PLC | 4,161 | 7.515 | 31,269.910 | |
| | CONVATEC GROUP PLC | 6,581 | 1.532 | 10,085.380 | |
| | ROYAL MAIL PLC | 10,076 | 3.237 | 32,616.010 | |
| | NMC HEALTH PLC | 975 | 35.420 | 34,534.500 | |
| | RELX PLC | 17,881 | 16.550 | 295,930.550 | |
| | DIAGEO PLC | 22,895 | 28.290 | 647,699.550 | |
| | RIO TINTO PLC | 10,582 | 36.190 | 382,962.580 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 29,745 | 6.153 | 183,020.980 | |
| | TESCO PLC | 88,748 | 2.000 | 177,496.000 | |
| | FRESNILLO PLC | 2,400 | 7.772 | 18,652.800 | |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 8,329 | 14.225 | 118,480.020 | |
| | GLENCORE PLC | 106,703 | 2.933 | 312,959.890 | |
| | WOOD GROUP (JOHN) PLC | 5,466 | 6.466 | 35,343.150 | |
| | HARGREAVES LANSDOWN PLC | 3,200 | 19.450 | 62,240.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SMITHS GROUP PLC | 4,080 | 14.175 | 57,834.000 | |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 600 | 5.814 | 3,488.400 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 10,963 | 3.269 | 35,838.040 | |
| PEARSON PLC | 8,271 | 9.610 | 79,484.310 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 17,631 | 3.126 | 55,114.500 | |
| NEXT PLC | 1,159 | 50.600 | 58,645.400 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 32,236 | 1.385 | 44,662.970 | |
| WHITBREAD PLC | 1,785 | 46.660 | 83,288.100 | |
| BUNZL PLC | 3,159 | 24.520 | 77,458.680 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 247,753 | 1.677 | 415,630.430 | |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 803 | 49.300 | 39,587.900 | |
| KINGFISHER PLC | 17,229 | 2.576 | 44,381.900 | |
| WPP PLC | 13,021 | 8.680 | 113,022.280 | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 8,244 | 7.790 | 64,220.760 | |
| SEVERN TRENT PLC | 1,300 | 18.770 | 24,401.000 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 5,855 | 66.220 | 387,718.100 | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 4,883 | 10.335 | 50,465.800 | |
| SCHRODERS PLC | 1,227 | 25.900 | 31,779.300 | |
| SSE PLC | 8,282 | 10.990 | 91,019.180 | |
| WEIR GROUP PLC/THE | 1,300 | 14.655 | 19,051.500 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 12,368 | 4.727 | 58,463.530 | |
| ASTRAZENECA PLC | 11,153 | 61.540 | 686,355.620 | |
| FERGUSON PLC | 1,989 | 50.520 | 100,484.280 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 49,681 | 2.474 | 122,910.790 | |
| 3I GROUP PLC | 8,439 | 8.582 | 72,423.490 | |
| ASHTEAD GROUP PLC | 3,900 | 17.955 | 70,024.500 | |
| SAGE GROUP PLC/THE | 9,725 | 6.060 | 58,933.500 | |
| NATIONAL GRID PLC | 30,325 | 8.340 | 252,910.500 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 676,372 | 0.561 | 379,715.240 | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 12,586 | 5.398 | 67,939.220 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 8,223 | 24.180 | 198,832.140 | |
| CENTRICA PLC | 38,002 | 1.361 | 51,739.720 | |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 700 | 33.060 | 23,142.000 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 20,398 | 27.810 | 567,268.380 | |
| BHP GROUP PLC | 17,820 | 15.310 | 272,824.200 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 2,960 | 24.470 | 72,431.200 | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 182,842 | 6.692 | 1,223,578.660 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SHIRE PLC | 8,223 | 45.050 | 370,446.150 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 10,745 | 16.110 | 173,101.950 | |
| | MONDI PLC | 3,400 | 17.340 | 58,956.000 | |
| | WM MORRISON SUPERMARKETS | 14,500 | 2.435 | 35,307.500 | |
| | CARNIVAL PLC | 1,383 | 46.280 | 64,005.240 | |
| | EASYJET PLC | 1,644 | 11.435 | 18,799.140 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 14,239 | 16.705 | 237,862.490 | |
| | PERSIMMON PLC | 2,569 | 19.655 | 50,493.690 | |
| | BT GROUP PLC | 85,624 | 2.619 | 224,292.060 | |
| | COCA-COLA HBC AG-DI | 1,200 | 23.800 | 28,560.000 | |
| | BURBERRY GROUP PLC | 3,300 | 18.285 | 60,340.500 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 1,372 | 43.190 | 59,256.680 | |
| | TRAVIS PERKINS PLC | 1,700 | 10.980 | 18,666.000 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 1,592 | 48.040 | 76,479.680 | |
| | ITV PLC | 27,587 | 1.504 | 41,490.840 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 2,735 | 40.830 | 111,670.050 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 40,270 | 23.720 | 955,204.400 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 34,053 | 24.145 | 822,209.680 | |
| | MEGGITT PLC | 9,925 | 5.168 | 51,292.400 | |
| | G4S PLC | 11,320 | 1.964 | 22,238.140 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 1,570 | 21.060 | 33,064.200 | |
| | INVESTEC PLC | 4,600 | 4.893 | 22,507.800 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 3,460 | 8.364 | 28,939.440 | |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 17,899 | 2.705 | 48,425.740 | |
| | EXPERIAN PLC | 7,555 | 18.970 | 143,318.350 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | | イギリス・ポンド<br>15,968,653.650<br>(2,315,614,466) | |
| イスラエル・シュケル | | 株 | イスラエル・シュケル | イスラエル・シュケル | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 530 | 186.700 | 98,951.000 | |
| | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 5,000 | 4.280 | 21,400.000 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LTD | 11,096 | 21.740 | 241,227.040 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 300 | 455.000 | 136,500.000 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 7,900 | 25.500 | 201,450.000 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 11,400 | 24.420 | 278,388.000 | |
| | NICE LTD | 800 | 428.000 | 342,400.000 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | | | イスラエル・シュケル | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 1,320,316.040<br>(40,401,671) | |
| オーストラリア・ドル | | 株 | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | |
| | HEALTHSCOPE LTD | 16,000 | 2.200 | 35,200.000 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 22,824 | 2.480 | 56,603.520 | |
| | BHP BILLITON LIMITED | 27,332 | 30.980 | 846,745.360 | |
| | SOUTH32 LTD | 56,387 | 3.140 | 177,055.180 | |
| | ALUMINA LTD | 12,100 | 2.310 | 27,951.000 | |
| | WOODSIDE PETROLEUM LTD | 7,728 | 31.170 | 240,881.760 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 10,500 | 4.030 | 42,315.000 | |
| | BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 3,600 | 10.820 | 38,952.000 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 22,399 | 24.910 | 557,959.090 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 29,481 | 26.420 | 778,888.020 | |
| | SANTOS LTD | 18,270 | 5.640 | 103,042.800 | |
| | AUSNET SERVICES | 28,500 | 1.585 | 45,172.500 | |
| | AUST AND NZ BANKING GROUP | 24,874 | 27.150 | 675,329.100 | |
| | RIO TINTO LTD | 3,349 | 73.250 | 245,314.250 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 12,050 | 6.590 | 79,409.500 | |
| | AMCOR LIMITED | 10,996 | 13.430 | 147,676.280 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 15,310 | 4.250 | 65,067.500 | |
| | COLES GROUP LTD | 9,567 | 12.390 | 118,535.130 | |
| | OIL SEARCH LTD | 15,418 | 7.320 | 112,859.760 | |
| | SEEK LTD | 2,600 | 18.760 | 48,776.000 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 5,592 | 14.850 | 83,041.200 | |
| | NEWCREST MINING LTD | 5,804 | 20.780 | 120,607.120 | |
| | INCITEC PIVOT LTD | 20,400 | 3.810 | 77,724.000 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 15,492 | 72.430 | 1,122,085.560 | |
| | CALTEX AUSTRALIA LTD | 2,000 | 27.490 | 54,980.000 | |
| | ORICA LTD | 2,000 | 17.720 | 35,440.000 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 9,822 | 11.480 | 112,756.560 | |
| | CIMIC GROUP LTD | 1,000 | 42.940 | 42,940.000 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 11,760 | 29.830 | 350,800.800 | |
| | COCA-COLA AMATIL LTD | 2,600 | 10.100 | 26,260.000 | |
| | TABCORP HOLDINGS LTD | 17,352 | 4.460 | 77,389.920 | |
| | CROWN RESORTS LTD | 3,000 | 11.800 | 35,400.000 | |
| | TELSTRA CORP LTD | 35,114 | 2.960 | 103,937.440 | |
| | AMP LTD | 24,935 | 2.440 | 60,841.400 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 3,200 | 16.450 | 52,640.000 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 2,542 | 116.810 | 296,931.020 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 6,163 | 25.440 | 156,786.720 | |
| | BANK OF QUEENSLAND LTD | 3,000 | 10.120 | 30,360.000 | |
| | CSL LTD | 4,037 | 180.800 | 729,889.600 | |
| | WESFARMERS LTD | 9,567 | 31.510 | 301,456.170 | |
| | COCHLEAR LTD | 444 | 172.700 | 76,678.800 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 7,092 | 11.160 | 79,146.720 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 9,938 | 13.550 | 134,659.900 | |
| | BORAL LTD | 8,600 | 5.260 | 45,236.000 | |
| | ASX LTD | 1,300 | 61.520 | 79,976.000 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 3,700 | 18.450 | 68,265.000 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 17,097 | 7.430 | 127,030.710 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 2,500 | 23.280 | 58,200.000 | |
| | CHALLENGER LTD | 6,300 | 9.840 | 61,992.000 | |
| | AGL ENERGY LTD | 4,739 | 18.690 | 88,571.910 | |
| | BRAMBLES LTD | 11,337 | 10.480 | 118,811.760 | |
| | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 800 | 48.280 | 38,624.000 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 900 | 55.560 | 50,004.000 | |
| | REA GROUP LTD | 608 | 76.450 | 46,481.600 | |
| | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 621 | 46.490 | 28,870.290 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | | オーストラリア・ドル<br>9,418,549.950<br>(782,493,130) | |
| カナダ・ドル | | 株 | カナダ・ドル | カナダ・ドル | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 2,300 | 40.560 | 93,288.000 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 150 | 938.000 | 140,700.000 | |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 2,438 | 17.720 | 43,201.360 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERN | 2,121 | 78.090 | 165,628.890 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 4,200 | 20.880 | 87,696.000 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 1,000 | 103.540 | 103,540.000 | |
| | BCE INC | 900 | 57.120 | 51,408.000 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 1,600 | 90.640 | 145,024.000 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 15,212 | 43.550 | 662,482.600 | |
| | METRO INC | 1,600 | 45.800 | 73,280.000 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 3,300 | 60.460 | 199,518.000 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 9,900 | 72.800 | 720,720.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 3,800 | 112.460 | 427,348.000 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 16,600 | 73.480 | 1,219,768.000 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 1,700 | 30.640 | 52,088.000 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 12,000 | 97.820 | 1,173,840.000 | |
| TOURMALINE OIL CORP | 1,300 | 18.300 | 23,790.000 | |
| VERMILION ENERGY INC | 1,400 | 33.710 | 47,194.000 | |
| TRANSCANADA CORP | 7,600 | 54.400 | 413,440.000 | |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 3,771 | 44.320 | 167,130.720 | |
| BOMBARDIER INC-B | 19,200 | 2.170 | 41,664.000 | |
| BARRICK GOLD CORP | 8,300 | 17.340 | 143,922.000 | |
| CAE INC | 2,300 | 26.590 | 61,157.000 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 1,833 | 66.420 | 121,747.860 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 1,800 | 25.320 | 45,576.000 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 600 | 70.090 | 42,054.000 | |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 1,000 | 53.130 | 53,130.000 | |
| LINAMAR CORP | 600 | 48.000 | 28,800.000 | |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 1,100 | 10.190 | 11,209.000 | |
| HYDRO ONE LTD | 1,500 | 19.660 | 29,490.000 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 1,489 | 61.330 | 91,320.370 | |
| WSP GLOBAL INC | 1,200 | 64.490 | 77,388.000 | |
| EMERA INC | 1,200 | 44.800 | 53,760.000 | |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 1,000 | 31.350 | 31,350.000 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 3,000 | 70.340 | 211,020.000 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 1,800 | 46.400 | 83,520.000 | |
| KINROSS GOLD CORP | 10,534 | 3.620 | 38,133.080 | |
| BANK OF MONTREAL | 5,800 | 99.360 | 576,288.000 | |
| POWER CORP OF CANADA | 3,100 | 26.620 | 82,522.000 | |
| METHANEX CORP | 600 | 74.110 | 44,466.000 | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 800 | 197.860 | 158,288.000 | |
| NUTRIEN LTD | 5,127 | 68.160 | 349,456.320 | |
| AURORA CANNABIS INC | 7,000 | 7.510 | 52,570.000 | |
| CANOPY GROWTH CORP | 2,000 | 44.200 | 88,400.000 | |
| CAMECO CORP | 2,800 | 15.850 | 44,380.000 | |
| TELUS CORP | 300 | 47.560 | 14,268.000 | |
| POWER FINANCIAL CORP | 2,000 | 28.120 | 56,240.000 | |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 4,400 | 26.630 | 117,172.000 | |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 500 | 151.440 | 75,720.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 8,000 | 2.420 | 19,360.000 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 11,700 | 33.450 | 391,365.000 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 200 | 614.180 | 122,836.000 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 3,100 | 65.760 | 203,856.000 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 901 | 97.250 | 87,622.250 | |
| BLACKBERRY LTD | 6,400 | 11.700 | 74,880.000 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 5,200 | 48.580 | 252,616.000 | |
| ENBRIDGE INC | 14,300 | 43.950 | 628,485.000 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 7,800 | 58.810 | 458,718.000 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 16,000 | 21.770 | 348,320.000 | |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 2,000 | 31.560 | 63,120.000 | |
| GOLDCORP INC | 6,300 | 12.510 | 78,813.000 | |
| ENCANA CORP | 6,900 | 9.250 | 63,825.000 | |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 1,200 | 279.440 | 335,328.000 | |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 1,100 | 48.290 | 53,119.000 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 1,400 | 42.900 | 60,060.000 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 6,400 | 112.870 | 722,368.000 | |
| CGI GROUP INC - CLASS A | 1,900 | 84.320 | 160,208.000 | |
| HUSKY ENERGY INC | 3,012 | 16.010 | 48,222.120 | |
| ONEX CORPORATION | 700 | 81.930 | 57,351.000 | |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 3,900 | 24.960 | 97,344.000 | |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 2,500 | 27.080 | 67,700.000 | |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 1,900 | 48.850 | 92,815.000 | |
| IGM FINANCIAL INC | 300 | 33.920 | 10,176.000 | |
| OPEN TEXT CORP | 2,700 | 45.150 | 121,905.000 | |
| CI FINANCIAL CORP | 2,000 | 19.900 | 39,800.000 | |
| SAPUTO INC | 1,300 | 40.850 | 53,105.000 | |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 6,300 | 12.140 | 76,482.000 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 4,500 | 69.840 | 314,280.000 | |
| FORTIS INC | 4,200 | 46.050 | 193,410.000 | |
| LUNDIN MINING CORP | 6,600 | 5.700 | 37,620.000 | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 2,500 | 4.030 | 10,075.000 | |
| CENOVUS ENERGY INC | 8,000 | 9.750 | 78,000.000 | |
| DOLLARAMA INC | 2,700 | 35.840 | 96,768.000 | |
| ATCO LTD -CLASS I | 800 | 40.380 | 32,304.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ALTAGAS LTD | 800 | 14.000 | 11,200.000 | |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 2,000 | 19.940 | 39,880.000 | |
| | KEYERA CORP | 2,200 | 28.650 | 63,030.000 | |
| | INTER PIPELINE LTD | 4,800 | 21.590 | 103,632.000 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 2,800 | 9.150 | 25,620.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | | カナダ・ドル<br>14,631,715.570<br>(1,249,841,144) | |
| シンガポール・ドル | | 株 | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 13,300 | 25.110 | 333,963.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 17,100 | 24.180 | 413,478.000 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 7,100 | 9.650 | 68,515.000 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 17,300 | 6.150 | 106,395.000 | |
| | UOL GROUP LTD | 5,200 | 6.230 | 32,396.000 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 5,200 | 8.700 | 45,240.000 | |
| | CAPITALAND LTD | 19,000 | 3.160 | 60,040.000 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 27,000 | 1.260 | 34,020.000 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 12,000 | 2.660 | 31,920.000 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 900 | 35.290 | 31,761.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 34,800 | 11.240 | 391,152.000 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 45,000 | 0.970 | 43,650.000 | |
| | VENTURE CORP LTD | 3,200 | 15.320 | 49,024.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 65,400 | 3.080 | 201,432.000 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 14,100 | 3.460 | 48,786.000 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 4,000 | 2.650 | 10,600.000 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 9,000 | 0.230 | 2,070.000 | |
| | SATS LTD | 7,700 | 4.680 | 36,036.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 6,900 | 7.280 | 50,232.000 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 10,000 | 2.090 | 20,900.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 15,800 | 3.090 | 48,822.000 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | | シンガポール・ドル<br>2,060,432.000<br>(170,789,208) | |
| スイス・フラン | | 株 | スイス・フラン | スイス・フラン | |
| | DUFRY AG-REG | 189 | 108.700 | 20,544.300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| UBS GROUP AG-REG | 32,402 | 13.645 | 442,125.290 | |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 50 | 542.000 | 27,100.000 | |
| ADECCO GROUP AG-REG | 1,754 | 49.520 | 86,858.080 | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 6,091 | 254.200 | 1,548,332.200 | |
| PARGESA HOLDING SA-BR | 389 | 70.050 | 27,249.450 | |
| SIKA AG-REG | 1,140 | 124.200 | 141,588.000 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 1 | 80,300.000 | 80,300.000 | |
| ABB LTD-REG | 17,676 | 20.310 | 358,999.560 | |
| SWISS RE AG | 2,500 | 91.480 | 228,700.000 | |
| NESTLE SA-REG | 27,666 | 85.200 | 2,357,143.200 | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 163 | 668.500 | 108,965.500 | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 300 | 205.600 | 61,680.000 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 21,508 | 11.925 | 256,482.900 | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 2,198 | 41.020 | 90,161.960 | |
| SGS SA-REG | 46 | 2,379.000 | 109,434.000 | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 153 | 199.300 | 30,492.900 | |
| VIFOR PHARMA AG | 369 | 126.600 | 46,715.400 | |
| TEMENOS AG - REG | 508 | 126.400 | 64,211.200 | |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR | 267 | 300.900 | 80,340.300 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1,347 | 313.600 | 422,419.200 | |
| BALOISE HOLDING AG - REG | 320 | 148.900 | 47,648.000 | |
| CLARIANT AG-REG | 1,568 | 20.400 | 31,987.200 | |
| NOVARTIS AG-REG | 19,290 | 90.360 | 1,743,044.400 | |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 20 | 1,723.000 | 34,460.000 | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 4,447 | 65.680 | 292,078.960 | |
| SWISSCOM AG-REG | 276 | 475.500 | 131,238.000 | |
| GEBERIT AG-REG | 334 | 391.900 | 130,894.600 | |
| GIVAUDAN-REG | 89 | 2,478.000 | 220,542.000 | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 111 | 609.500 | 67,654.500 | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 563 | 161.500 | 90,924.500 | |
| LONZA GROUP AG-REG | 692 | 319.100 | 220,817.200 | |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG | 450 | 59.250 | 26,662.500 | |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 3,801 | 45.450 | 172,755.450 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 231 | 391.900 | 90,528.900 | |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 495 | 142.100 | 70,339.500 | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 946 | 82.150 | 77,713.900 | |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 10 | 6,850.000 | 68,500.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| スイス・フラン　小計 | | | | スイス・フラン<br>10,107,633.050<br>(1,151,259,405) | |
| スウェーデン・クローナ | | 株 | スウェーデン・クローナ | スウェーデン・クローナ | |
| | ICA GRUPPEN AB | 700 | 331.700 | 232,190.000 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 32,335 | 75.880 | 2,453,579.800 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 14,568 | 127.000 | 1,850,136.000 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 777 | 530.500 | 412,198.500 | |
| | SKF AB-B SHARES | 4,000 | 142.400 | 569,600.000 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 2,600 | 206.100 | 535,860.000 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 1,200 | 357.700 | 429,240.000 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 3,258 | 114.250 | 372,226.500 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 19,697 | 95.040 | 1,872,002.880 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 16,526 | 100.500 | 1,660,863.000 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 9,075 | 210.700 | 1,912,102.500 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 9,039 | 169.560 | 1,532,652.840 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 3,709 | 144.550 | 536,135.950 | |
| | SANDVIK AB | 10,122 | 134.700 | 1,363,433.400 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 4,550 | 393.600 | 1,790,880.000 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 7,668 | 219.100 | 1,680,058.800 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 2,500 | 152.200 | 380,500.000 | |
| | TELIA CO AB | 24,107 | 42.050 | 1,013,699.350 | |
| | ALFA LAVAL AB | 2,000 | 193.900 | 387,800.000 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 2,500 | 202.600 | 506,500.000 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 10,882 | 168.650 | 1,835,249.300 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 948 | 273.600 | 259,372.800 | |
| | LUNDIN PETROLEUM AB | 1,900 | 239.000 | 454,100.000 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 5,050 | 233.000 | 1,176,650.000 | |
| | BOLIDEN AB | 3,171 | 202.500 | 642,127.500 | |
| | EPIROC AB-A | 6,982 | 75.290 | 525,674.780 | |
| | EPIROC AB-B | 2,500 | 72.480 | 181,200.000 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 2,400 | 72.300 | 173,520.000 | |
| | NORDEA BANK ABP | 26,529 | 81.680 | 2,166,888.720 | |
| | KINNEVIK AB - B | 1,500 | 237.300 | 355,950.000 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 2,400 | 459.400 | 1,102,560.000 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 1,300 | 185.200 | 240,760.000 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | | | スウェーデン・クローナ | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 30,605,712.620<br>(382,877,465) | |
| デンマーク・クローネ | | 株 | デンマーク・クローネ | デンマーク・クローネ | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 17,325 | 299.100 | 5,181,907.500 | |
| | DANSKE BANK A/S | 7,236 | 131.700 | 952,981.200 | |
| | ISS A/S | 1,320 | 216.700 | 286,044.000 | |
| | AP MOELLER-MAERSK A/S-A | 30 | 9,025.000 | 270,750.000 | |
| | H LUNDBECK A/S | 500 | 265.500 | 132,750.000 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 1,857 | 485.300 | 901,202.100 | |
| | CARLSBERG AS-B | 1,232 | 717.400 | 883,836.800 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 1,802 | 311.400 | 561,142.800 | |
| | COLOPLAST-B | 1,052 | 643.600 | 677,067.200 | |
| | DSV A/S | 1,650 | 515.400 | 850,410.000 | |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 1,314 | 197.700 | 259,777.800 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 66 | 9,700.000 | 640,200.000 | |
| | TRYG A/S | 1,700 | 162.300 | 275,910.000 | |
| | PANDORA A/S | 750 | 358.300 | 268,725.000 | |
| | CHR HANSEN HOLDING A/S | 750 | 597.400 | 448,050.000 | |
| | GENMAB A/S | 733 | 1,005.000 | 736,665.000 | |
| | ORSTED A/S | 1,533 | 433.800 | 665,015.400 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | | | デンマーク・クローネ<br>13,992,434.800<br>(242,209,046) | |
| ニュージーランド・ドル | | 株 | ニュージーランド・ドル | ニュージーランド・ドル | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 15,000 | 3.250 | 48,750.000 | |
| | A2 MILK CO LTD | 7,000 | 10.900 | 76,300.000 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 16,860 | 4.170 | 70,306.200 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 8,100 | 7.050 | 57,105.000 | |
| | FLETCHER BUILDING LTD | 14,526 | 4.790 | 69,579.540 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 3,700 | 13.230 | 48,951.000 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 4,419 | 11.550 | 51,039.450 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | | | ニュージーランド・ドル<br>422,031.190<br>(32,863,569) | |
| ノルウェー・クローネ | | 株 | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NORSK HYDRO ASA | 13,050 | 40.950 | 534,397.500 | |
| | DNB ASA | 8,545 | 148.850 | 1,271,923.250 | |
| | ORKLA ASA | 7,000 | 71.060 | 497,420.000 | |
| | TELENOR ASA | 6,250 | 165.700 | 1,035,625.000 | |
| | EQUINOR ASA | 11,121 | 199.800 | 2,221,975.800 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 1,450 | 348.000 | 504,600.000 | |
| | MARINE HARVEST | 4,677 | 199.000 | 930,723.000 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 2,000 | 137.100 | 274,200.000 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 1,700 | 283.000 | 481,100.000 | |
| | AKER BP ASA | 1,306 | 246.200 | 321,537.200 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | | | ノルウェー・クローネ<br>8,073,501.750<br>(107,216,103) | |
| ユーロ | | 株 | ユーロ | ユーロ | |
| | BAYER AG-REG | 7,586 | 63.770 | 483,759.220 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 1,800 | 24.120 | 43,416.000 | |
| | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 15,695 | 8.300 | 130,268.500 | |
| | COMMERZBANK AG | 9,689 | 7.893 | 76,475.270 | |
| | VOLKSWAGEN AG | 420 | 145.700 | 61,194.000 | |
| | VOLKSWAGEN AG-PREF | 1,372 | 150.060 | 205,882.320 | |
| | SIEMENS AG-REG | 6,488 | 102.300 | 663,722.400 | |
| | E.ON SE | 22,270 | 8.979 | 199,962.330 | |
| | UNIPER SE | 1,380 | 23.110 | 31,891.800 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 2,921 | 72.850 | 212,794.850 | |
| | GEA GROUP AG | 1,300 | 24.060 | 31,278.000 | |
| | OSRAM LICHT AG | 645 | 41.260 | 26,612.700 | |
| | CONTINENTAL AG | 1,180 | 132.850 | 156,763.000 | |
| | BASF SE | 7,921 | 64.860 | 513,756.060 | |
| | K+S AG-REG | 1,400 | 15.890 | 22,246.000 | |
| | ALLIANZ SE-REG | 3,842 | 189.160 | 726,752.720 | |
| | THYSSENKRUPP AG | 4,030 | 16.730 | 67,421.900 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 1,857 | 102.350 | 190,063.950 | |
| | RWE AG | 5,309 | 19.050 | 101,136.450 | |
| | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 1,700 | 21.520 | 36,584.000 | |
| | FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 560 | 67.280 | 37,676.800 | |
| | BRENNTAG AG | 1,436 | 41.000 | 58,876.000 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 3,709 | 51.360 | 190,494.240 | |
| | UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 959 | 40.350 | 38,695.650 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HOCHTIEF AG | 166 | 126.100 | 20,932.600 | |
| SAP SE | 8,241 | 91.100 | 750,755.100 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 1,214 | 192.100 | 233,209.400 | |
| SCHAEFFLER AG | 2,102 | 7.558 | 15,886.910 | |
| ZALANDO SE | 700 | 28.680 | 20,076.000 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 1,230 | 59.460 | 73,135.800 | |
| KION GROUP AG | 600 | 51.080 | 30,648.000 | |
| WIRECARD AG | 1,000 | 136.300 | 136,300.000 | |
| COVESTRO AG | 1,945 | 51.340 | 99,856.300 | |
| INNOGY SE | 1,500 | 40.000 | 60,000.000 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 305 | 115.800 | 35,319.000 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 1,265 | 56.680 | 71,700.200 | |
| DELIVERY HERO SE | 1,056 | 33.360 | 35,228.160 | |
| METRO AG | 1,500 | 13.740 | 20,610.000 | |
| 1&1 DRILLISCH AG | 500 | 45.020 | 22,510.000 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 1,500 | 38.800 | 58,200.000 | |
| BEIERSDORF AG | 815 | 94.000 | 76,610.000 | |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF | 700 | 37.280 | 26,096.000 | |
| MERCK KGAA | 1,149 | 97.240 | 111,728.760 | |
| ADIDAS AG | 1,592 | 197.500 | 314,420.000 | |
| PUMA SE | 51 | 448.500 | 22,873.500 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 650 | 91.300 | 59,345.000 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 28,991 | 15.385 | 446,026.530 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 2,271 | 72.420 | 164,465.820 | |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 8,010 | 50.670 | 405,866.700 | |
| QIAGEN N.V. | 2,521 | 31.180 | 78,604.780 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 9,773 | 18.340 | 179,236.820 | |
| HANNOVER RUECK SE | 644 | 122.900 | 79,147.600 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 8,974 | 28.560 | 256,297.440 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 1,897 | 111.200 | 210,946.400 | |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 1,560 | 18.170 | 28,345.200 | |
| LANXESS AG | 600 | 49.220 | 29,532.000 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 400 | 175.900 | 70,360.000 | |
| AXEL SPRINGER SE | 470 | 56.250 | 26,437.500 | |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 3,285 | 42.440 | 139,415.400 | |
| SYMRISE AG | 1,436 | 70.960 | 101,898.560 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 6,240 | 3.576 | 22,314.240 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 250 | 64.200 | 16,050.000 | |
| HUGO BOSS AG -ORD | 811 | 62.320 | 50,541.520 | |
| RTL GROUP | 350 | 53.700 | 18,795.000 | |
| VONOVIA SE | 4,435 | 43.240 | 191,769.400 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 8,113 | 32.900 | 266,917.700 | |
| NN GROUP NV | 3,100 | 37.940 | 117,614.000 | |
| ARCELORMITTAL | 5,327 | 20.055 | 106,832.980 | |
| UNILEVER NV-CVA | 12,732 | 48.965 | 623,422.380 | |
| HEINEKEN NV | 2,910 | 79.720 | 231,985.200 | |
| AEGON NV | 14,361 | 4.970 | 71,374.170 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 10,652 | 22.505 | 239,723.260 | |
| AKZO NOBEL | 2,118 | 73.820 | 156,350.760 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 1,938 | 78.000 | 151,164.000 | |
| WOLTERS KLUWER | 2,376 | 53.700 | 127,591.200 | |
| ING GROEP NV | 30,853 | 10.804 | 333,335.810 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 36,000 | 2.537 | 91,332.000 | |
| ASML HOLDING NV | 3,489 | 151.240 | 527,676.360 | |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA | 3,453 | 22.820 | 78,797.460 | |
| VOPAK | 630 | 38.810 | 24,450.300 | |
| RANDSTAD NV | 750 | 42.450 | 31,837.500 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 1,100 | 76.700 | 84,370.000 | |
| JCDECAUX SA | 845 | 29.940 | 25,299.300 | |
| TOTAL SA | 19,922 | 48.440 | 965,021.680 | |
| MICHELIN (CGDE) | 1,861 | 91.940 | 171,100.340 | |
| AIR LIQUIDE SA | 3,938 | 104.150 | 410,142.700 | |
| KERING | 708 | 388.700 | 275,199.600 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 4,286 | 64.340 | 275,761.240 | |
| BOUYGUES SA | 1,892 | 34.740 | 65,728.080 | |
| BNP PARIBAS | 9,582 | 44.775 | 429,034.050 | |
| PEUGEOT SA | 6,497 | 19.470 | 126,496.590 | |
| NATIXIS | 7,674 | 4.945 | 37,947.930 | |
| THALES SA | 918 | 107.250 | 98,455.500 | |
| DANONE | 4,932 | 65.540 | 323,243.280 | |
| CARREFOUR SA | 5,156 | 16.415 | 84,635.740 | |
| SUEZ | 2,950 | 13.140 | 38,763.000 | |
| VIVENDI | 8,801 | 22.290 | 196,174.290 | |
| L'OREAL | 2,056 | 208.400 | 428,470.400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 4,013 | 32.880 | 131,947.440 | |
| LEGRAND SA | 2,250 | 54.040 | 121,590.000 | |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 200 | 40.500 | 8,100.000 | |
| PERNOD RICARD SA | 2,154 | 140.350 | 302,313.900 | |
| SOCIETE BIC SA | 150 | 94.500 | 14,175.000 | |
| EURAZEO SE | 534 | 67.150 | 35,858.100 | |
| REXEL SA | 3,870 | 10.605 | 41,041.350 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 6,129 | 32.830 | 201,215.070 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 2,311 | 256.500 | 592,771.500 | |
| ACCOR SA | 1,850 | 39.870 | 73,759.500 | |
| CAPGEMINI SE | 1,645 | 102.850 | 169,188.250 | |
| VALEO SA | 1,965 | 25.540 | 50,186.100 | |
| PUBLICIS GROUPE | 1,806 | 52.700 | 95,176.200 | |
| BUREAU VERITAS SA | 3,227 | 19.455 | 62,781.280 | |
| EIFFAGE | 750 | 85.240 | 63,930.000 | |
| SODEXO SA | 669 | 91.220 | 61,026.180 | |
| IPSEN | 276 | 114.000 | 31,464.000 | |
| INGENICO GROUP | 499 | 64.460 | 32,165.540 | |
| AMUNDI SA | 437 | 50.940 | 22,260.780 | |
| TELEPERFORMANCE | 500 | 144.800 | 72,400.000 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 977 | 70.640 | 69,015.280 | |
| FAURECIA | 560 | 36.720 | 20,563.200 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 131 | 395.800 | 51,849.800 | |
| SEB SA | 197 | 129.200 | 25,452.400 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 1,831 | 111.650 | 204,431.150 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 22 | 1,350.000 | 29,700.000 | |
| AXA SA | 15,775 | 21.535 | 339,714.620 | |
| EDENRED | 1,913 | 33.430 | 63,951.590 | |
| RENAULT SA | 1,650 | 62.400 | 102,960.000 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 268 | 485.100 | 130,006.800 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 7,498 | 12.970 | 97,249.060 | |
| REMY COINTREAU | 253 | 102.000 | 25,806.000 | |
| ATOS SE | 946 | 75.120 | 71,063.520 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 1,149 | 107.400 | 123,402.600 | |
| WENDEL | 201 | 108.000 | 21,708.000 | |
| ORANGE | 17,404 | 15.020 | 261,408.080 | |
| ALSTOM | 1,310 | 39.070 | 51,181.700 | |
| CNP ASSURANCES | 1,349 | 20.220 | 27,276.780 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SANOFI | 9,252 | 78.870 | 729,705.240 | |
| VINCI SA | 4,464 | 77.580 | 346,317.120 | |
| AIRBUS SE | 5,112 | 94.860 | 484,924.320 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 6,973 | 18.740 | 130,674.020 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 9,904 | 11.052 | 109,459.000 | |
| BIOMERIEUX | 457 | 65.000 | 29,705.000 | |
| ENGIE | 14,444 | 12.490 | 180,405.560 | |
| IMERYS SA | 340 | 48.660 | 16,544.400 | |
| EDF | 6,760 | 14.710 | 99,439.600 | |
| SES | 4,402 | 18.320 | 80,644.640 | |
| SAFRAN SA | 2,592 | 111.500 | 289,008.000 | |
| ILIAD SA | 219 | 124.600 | 27,287.400 | |
| ARKEMA | 838 | 84.640 | 70,928.320 | |
| ADP | 350 | 173.200 | 60,620.000 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 1,400 | 18.130 | 25,382.000 | |
| SCOR SE | 1,297 | 42.500 | 55,122.500 | |
| GETLINK | 3,940 | 11.480 | 45,231.200 | |
| BOLLORE | 7,300 | 3.966 | 28,951.800 | |
| UCB SA | 1,110 | 73.340 | 81,407.400 | |
| KBC GROUP NV | 2,211 | 63.740 | 140,929.140 | |
| COLRUYT SA | 350 | 56.620 | 19,817.000 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 900 | 80.060 | 72,054.000 | |
| SOLVAY SA | 873 | 96.440 | 84,192.120 | |
| UMICORE | 1,600 | 37.960 | 60,736.000 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 6,589 | 67.380 | 443,966.820 | |
| AGEAS | 1,654 | 43.040 | 71,188.160 | |
| PROXIMUS | 2,269 | 24.120 | 54,728.280 | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 462 | 43.120 | 19,921.440 | |
| PRYSMIAN SPA | 1,440 | 15.990 | 23,025.600 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 11,733 | 14.755 | 173,120.410 | |
| MEDIOBANCA SPA | 4,460 | 7.808 | 34,823.680 | |
| TENARIS SA | 4,700 | 10.830 | 50,901.000 | |
| UNICREDIT SPA | 21,147 | 11.516 | 243,528.850 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 108,503 | 0.564 | 61,260.790 | |
| TELECOM ITALIA-RSP | 48,381 | 0.484 | 23,440.590 | |
| INTESA SANPAOLO | 135,457 | 2.032 | 275,316.350 | |
| ATLANTIA SPA | 3,527 | 18.345 | 64,702.810 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 2,900 | 6.706 | 19,447.400 | |
| MONCLER SPA | 1,522 | 29.510 | 44,914.220 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| RECORDATI SPA | 692 | 27.920 | 19,320.640 | |
| ENI SPA | 21,146 | 14.216 | 300,611.530 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 4,483 | 7.315 | 32,793.140 | |
| PIRELLI & C SPA | 5,651 | 6.244 | 35,284.840 | |
| LEONARDO SPA | 2,500 | 8.658 | 21,645.000 | |
| ENEL SPA | 71,157 | 4.758 | 338,565.000 | |
| SNAM SPA | 24,300 | 3.833 | 93,141.900 | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 1,307 | 51.700 | 67,571.900 | |
| TERNA SPA | 9,900 | 4.884 | 48,351.600 | |
| EXOR NV | 1,088 | 51.860 | 56,423.680 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 11,691 | 8.452 | 98,812.330 | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 10,787 | 14.730 | 158,892.510 | |
| FERRARI NV | 1,130 | 96.060 | 108,547.800 | |
| TELEFONICA SA | 40,569 | 7.804 | 316,600.470 | |
| ENDESA SA | 2,150 | 19.645 | 42,236.750 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 60,432 | 4.990 | 301,555.680 | |
| IBERDROLA SA | 46,886 | 6.602 | 309,541.370 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 49,634 | 1.124 | 55,788.610 | |
| BANKINTER SA | 6,700 | 7.414 | 49,673.800 | |
| REPSOL SA | 10,213 | 15.140 | 154,624.820 | |
| GRIFOLS SA | 3,004 | 26.200 | 78,704.800 | |
| BANCO SANTANDER SA | 140,479 | 4.213 | 591,908.260 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 4,311 | 64.020 | 275,990.220 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 3,978 | 21.690 | 86,282.820 | |
| MAPFRE SA | 8,005 | 2.524 | 20,204.620 | |
| CAIXABANK SA | 30,487 | 3.620 | 110,362.940 | |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 4,900 | 7.046 | 34,525.400 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 2,195 | 33.850 | 74,300.750 | |
| AENA SME SA | 569 | 142.050 | 80,826.450 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 9,655 | 27.310 | 263,678.050 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 1,793 | 12.650 | 22,681.450 | |
| ENAGAS SA | 3,675 | 24.070 | 88,457.250 | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 4,056 | 18.955 | 76,881.480 | |
| FERROVIAL SA | 3,876 | 18.090 | 70,116.840 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANKIA SA | 15,905 | 2.909 | 46,267.640 | |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 4,493 | 23.890 | 107,337.770 | |
| | NOKIA OYJ | 54,437 | 4.838 | 263,366.200 | |
| | WARTSILA OYJ ABP | 4,116 | 14.705 | 60,525.780 | |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 4,193 | 11.165 | 46,814.840 | |
| | METSO OYJ | 1,108 | 25.330 | 28,065.640 | |
| | ELISA OYJ | 1,300 | 34.650 | 45,045.000 | |
| | SAMPO OYJ-A SHS | 3,832 | 39.660 | 151,977.120 | |
| | FORTUM OYJ | 4,400 | 18.295 | 80,498.000 | |
| | KONE OYJ-B | 2,660 | 44.370 | 118,024.200 | |
| | NOKIAN RENKAAT OYJ | 1,770 | 28.430 | 50,321.100 | |
| | NESTE OYJ | 1,100 | 69.620 | 76,582.000 | |
| | ORION OYJ-CLASS B | 1,763 | 29.540 | 52,079.020 | |
| | OMV AG | 1,209 | 45.130 | 54,562.170 | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 2,750 | 34.900 | 95,975.000 | |
| | VOESTALPINE AG | 1,800 | 29.200 | 52,560.000 | |
| | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 1,100 | 26.290 | 28,919.000 | |
| | ANDRITZ AG | 550 | 42.340 | 23,287.000 | |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 1,995 | 23.820 | 47,520.900 | |
| | AIB GROUP PLC | 9,000 | 3.826 | 34,434.000 | |
| | BANK OF IRELAND GROUP PLC | 10,234 | 5.820 | 59,561.880 | |
| | JERONIMO MARTINS | 2,900 | 10.590 | 30,711.000 | |
| | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 27,576 | 3.070 | 84,658.320 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 3,609 | 14.440 | 52,113.960 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 1,712 | 91.050 | 155,877.600 | |
| | CRH PLC | 6,500 | 24.750 | 160,875.000 | |
| | PADDY POWER BETFAIR PLC | 889 | 79.750 | 70,897.750 | |
| ユーロ　小計 | | | | ユーロ<br>31,673,090.140<br>(4,091,846,515) | |
| 香港・ドル | | 株 | 香港・ドル | 香港・ドル | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 14,500 | 53.450 | 775,025.000 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 22,000 | 48.500 | 1,067,000.000 | |
| | MTR CORP | 16,500 | 40.150 | 662,475.000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 16,000 | 113.300 | 1,812,800.000 | |
| | SINO LAND CO | 34,000 | 13.500 | 459,000.000 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 27,052 | 81.500 | 2,204,738.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | WHARF HOLDINGS LTD | 8,000 | 21.300 | 170,400.000 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 3,500 | 86.350 | 302,225.000 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 13,500 | 87.850 | 1,185,975.000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 10,514 | 40.100 | 421,611.400 | |
| | HANG LUNG GROUP LTD | 8,000 | 21.350 | 170,800.000 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 79,305 | 15.600 | 1,237,158.000 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 6,400 | 180.100 | 1,152,640.000 | |
| | WHEELOCK & CO LTD | 6,000 | 45.100 | 270,600.000 | |
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 58,000 | 10.740 | 622,920.000 | |
| | WH GROUP LTD | 91,500 | 5.820 | 532,530.000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 11,900 | 228.200 | 2,715,580.000 | |
| | MINTH GROUP LTD | 6,000 | 27.250 | 163,500.000 | |
| | LI & FUNG LTD | 70,000 | 1.640 | 114,800.000 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 12,000 | 15.580 | 186,960.000 | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 2,000 | 80.000 | 160,000.000 | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 8,000 | 23.800 | 190,400.000 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 15,000 | 16.900 | 253,500.000 | |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 7,500 | 27.050 | 202,875.000 | |
| | BANK OF EAST ASIA LTD | 8,600 | 26.350 | 226,610.000 | |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 6,000 | 39.800 | 238,800.000 | |
| | SJM HOLDINGS LTD | 10,000 | 7.040 | 70,400.000 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 8,000 | 27.600 | 220,800.000 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 23,052 | 56.000 | 1,290,912.000 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 5,500 | 59.000 | 324,500.000 | |
| | PCCW LTD | 60,000 | 4.530 | 271,800.000 | |
| | AIA GROUP LTD | 115,600 | 64.400 | 7,444,640.000 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 14,000 | 47.950 | 671,300.000 | |
| | SANDS CHINA LTD | 23,000 | 34.050 | 783,150.000 | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 4,000 | 11.160 | 44,640.000 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 12,000 | 42.600 | 511,200.000 | |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 14,000 | 13.220 | 185,080.000 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 39,000 | 30.300 | 1,181,700.000 | |
| | WYNN MACAU LTD | 16,800 | 17.820 | 299,376.000 | |
| 香港・ドル　小計 | | | | 香港・ドル<br>30,800,420.400<br>(446,914,099) | |
| 合計 | | | | 35,303,993,367 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | [35,303,993,367] | |

(2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1,372 | 258,032.040 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 2,794 | 515,772.400 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 1,556 | 201,999.920 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 1,156 | 81,590.480 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 1,055 | 177,820.250 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 3,603 | 253,182.810 | |
| | | EQUINIX INC | 706 | 271,181.660 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 4,045 | 658,202.400 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 6,228 | 120,200.400 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 3,300 | 52,569.000 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 2,200 | 47,058.000 | |
| | | BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 2,403 | 42,028.470 | |
| | | VENTAS INC | 3,702 | 231,189.900 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 7,435 | 198,811.900 | |
| | | AGNC INVESTMENT CORP | 4,334 | 76,841.820 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 4,153 | 469,289.000 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 1,718 | 57,982.500 | |
| | | VEREIT INC | 7,750 | 59,132.500 | |
| | | PROLOGIS INC | 5,687 | 382,052.660 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1,200 | 146,856.000 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 650 | 60,918.000 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 3,100 | 87,017.000 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 600 | 155,604.000 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 450 | 58,900.500 | |
| | | WELLTOWER INC | 3,797 | 271,219.710 | |
| | | HCP INC | 4,550 | 131,040.000 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 1,000 | 44,410.000 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 1,100 | 112,442.000 | |
| | | MACERICH CO/THE | 700 | 35,042.000 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 9,600 | 96,576.000 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 1,552 | 76,777.440 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 2,550 | 162,843.000 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 1,540 | 326,264.400 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 1,150 | 72,243.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SL GREEN REALTY CORP | 650 | 60,983.000 | |
| | UDR INC | 1,900 | 79,591.000 | |
| | WP CAREY INC | 1,600 | 108,464.000 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 1,800 | 204,642.000 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 1,285 | 121,291.150 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>6,568,062.310<br>(745,278,030) | |
| イギリス・ポンド | | | イギリス・ポンド | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 4,808 | 40,021.790 | |
| | SEGRO PLC | 5,920 | 36,408.000 | |
| | HAMMERSON PLC | 10,958 | 42,637.570 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 6,300 | 35,910.000 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | イギリス・ポンド<br>154,977.360<br>(22,473,267) | |
| オーストラリア・ドル | | | オーストラリア・ドル | |
| | LENDLEASE GROUP | 4,303 | 56,541.420 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 26,027 | 299,050.230 | |
| | SYDNEY AIRPORT | 9,129 | 62,533.650 | |
| | APA GROUP | 7,500 | 68,775.000 | |
| | SCENTRE GROUP | 43,529 | 174,551.290 | |
| | DEXUS | 6,500 | 70,395.000 | |
| | GPT GROUP | 14,648 | 78,806.240 | |
| | MIRVAC GROUP | 31,638 | 71,501.880 | |
| | STOCKLAND | 14,300 | 53,768.000 | |
| | GOODMAN GROUP | 14,731 | 157,327.080 | |
| | VICINITY CENTRES | 19,523 | 53,297.790 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | オーストラリア・ドル<br>1,146,547.580<br>(95,255,173) | |
| カナダ・ドル | | | カナダ・ドル | |
| | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 2,000 | 42,440.000 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 1,400 | 34,496.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | カナダ・ドル<br>76,936.000<br>(6,571,873) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル | |
| | | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 28,000 | 49,280.000 | |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 30,500 | 78,995.000 | |
| | | CAPITALAND MALL TRUST | 9,000 | 20,340.000 | |
| | | SUNTEC REIT | 26,000 | 46,800.000 | |
| | シンガポール・ドル　小計 | | | シンガポール・ドル<br>195,415.000<br>(16,197,949) | |
| | ユーロ | | | ユーロ | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 1,249 | 193,170.340 | |
| | | ICADE | 406 | 28,927.500 | |
| | | GECINA SA | 334 | 41,883.600 | |
| | | KLEPIERRE | 2,394 | 69,952.680 | |
| | | COVIVIO | 353 | 30,834.550 | |
| | ユーロ　小計 | | | ユーロ<br>364,768.670<br>(47,124,465) | |
| | 香港・ドル | | | 香港・ドル | |
| | | LINK REIT | 24,000 | 1,810,800.000 | |
| | | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 52,000 | 394,680.000 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 34,000 | 381,480.000 | |
| | 香港・ドル　小計 | | | 香港・ドル<br>2,586,960.000<br>(37,536,790) | |
| 投資証券　合計 | | | | 970,437,547<br>[970,437,547] | |
| 合計 | | | | 970,437,547<br>[970,437,547] | |

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　592銘柄<br>投資証券　39銘柄 | 97.0% | 3.0% | 69.0% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イギリス・ポンド | 株式 96銘柄<br>投資証券 4銘柄 | 99.0% | 1.0% | 6.4% |
| イスラエル・シュケル | 株式 7銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| オーストラリア・ドル | 株式 55銘柄<br>投資証券 11銘柄 | 89.1% | 10.9% | 2.4% |
| カナダ・ドル | 株式 89銘柄<br>投資証券 2銘柄 | 99.5% | 0.5% | 3.5% |
| シンガポール・ドル | 株式 21銘柄<br>投資証券 4銘柄 | 91.3% | 8.7% | 0.5% |
| スイス・フラン | 株式 38銘柄 | 100% | -% | 3.2% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 32銘柄 | 100% | -% | 1.1% |
| デンマーク・クローネ | 株式 17銘柄 | 100% | -% | 0.7% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 7銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 10銘柄 | 100% | -% | 0.3% |
| ユーロ | 株式 236銘柄<br>投資証券 5銘柄 | 98.9% | 1.1% | 11.4% |
| 香港・ドル | 株式 39銘柄<br>投資証券 3銘柄 | 92.3% | 7.7% | 1.3% |

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

**【ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス 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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。**

## 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 5,914,061 |
| コール・ローン | 12,964,275 | 11,501,474 |
| 親投資信託受益証券 | 908,411,058 | 1,624,398,082 |
| 未収入金 | 600,000 | ― |
| 流動資産合計 | 921,975,333 | 1,641,813,617 |
| 資産合計 | 921,975,333 | 1,641,813,617 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 5,398,920 | 1,793,565 |
| 未払受託者報酬 | 59,369 | 171,575 |
| 未払委託者報酬 | 876,225 | 2,531,518 |
| その他未払費用 | 14,776 | 42,986 |
| 流動負債合計 | 6,349,290 | 4,539,644 |
| 負債合計 | 6,349,290 | 4,539,644 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 803,832,811 | ※1 1,417,526,848 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 111,793,232 | 219,747,125 |
| （分配準備積立金） | 62,972,604 | 59,598,109 |
| 元本等合計 | 915,626,043 | 1,637,273,973 |
| 純資産合計 | 915,626,043 | 1,637,273,973 |
| 負債純資産合計 | 921,975,333 | 1,641,813,617 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | ― | 2 |
| 有価証券売買等損益 | 67,830,958 | 21,428,024 |
| 営業収益合計 | 67,830,958 | 21,428,026 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 2,082 | 9,864 |
| 受託者報酬 | 79,841 | 293,139 |
| 委託者報酬 | 1,178,733 | 4,325,105 |
| その他費用 | 19,822 | 74,580 |
| 営業費用合計 | 1,280,478 | 4,702,688 |
| 営業利益 | 66,550,480 | 16,725,338 |
| 経常利益 | 66,550,480 | 16,725,338 |
| 当期純利益 | 66,550,480 | 16,725,338 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 3,579,857 | 7,582,270 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 111,793,232 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 51,717,035 | 136,731,615 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 51,717,035 | 136,731,615 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,894,426 | 37,920,790 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,894,426 | 37,920,790 |
| 分配金 | ※1　― | ※1　― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 111,793,232 | 219,747,125 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 10,000,000円 | 803,832,811円 |
| 期中追加設定元本額 | 866,066,727円 | 874,852,673円 |
| 期中一部解約元本額 | 72,233,916円 | 261,158,636円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 803,832,811口 | 1,417,526,848口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（62,972,604円）、投資信託約款に規定される収益調整金（48,824,093円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は111,796,697円（1万口当たり1,390.80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（9,150,492円）、投資信託約款に規定される収益調整金（160,158,034円）及び分配準備積立金（50,447,617円）より分配対象額は219,756,143円（1万口当たり1,550.28円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 67,567,526 | 18,604,175 |
| 合計 | 67,567,526 | 18,604,175 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.1391円 | 1.1550円 |

| | | |
|---|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (11,391円) | (11,550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 | 209,548,098 | 326,874,078 | |
| | 外国株式インデックスマザーファンド | 529,688,114 | 1,297,524,004 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 1,624,398,082 | |
| 合計 | | | 1,624,398,082 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 預金 | 348,838,841 | 498,352,197 |
| 金銭信託 | ― | 333,952,924 |
| コール・ローン | 591,680,576 | 649,460,746 |
| 株式 | 90,681,988,461 | 102,418,129,349 |
| 投資証券 | 2,483,442,333 | 2,814,132,682 |
| 派生商品評価勘定 | 50,894,023 | 45,643,154 |
| 未収入金 | 910,881 | 4,687,255 |
| 未収配当金 | 160,250,126 | 196,655,015 |
| 差入委託証拠金 | 683,871,590 | 770,259,958 |
| 流動資産合計 | 95,001,876,831 | 107,731,273,280 |
| 資産合計 | 95,001,876,831 | 107,731,273,280 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 79,836 | 4,415,029 |
| 未払解約金 | 74,468,800 | 33,327,900 |
| その他未払費用 | ― | 4,482 |
| 流動負債合計 | 74,548,636 | 37,747,411 |
| 負債合計 | 74,548,636 | 37,747,411 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 39,734,106,968 | 43,964,024,902 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 55,193,221,227 | 63,729,500,967 |
| 元本等合計 | 94,927,328,195 | 107,693,525,869 |
| 純資産合計 | 94,927,328,195 | 107,693,525,869 |
| 負債純資産合計 | 95,001,876,831 | 107,731,273,280 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 39,853,274,452円 | 39,734,106,968円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,391,848,229円 | 7,457,653,079円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,511,015,713円 | 3,227,735,145円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ外国株式インデックスＶＡ | 565,889,975円 | 507,485,808円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 18,626,936円 | 14,096,372円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 281,422,814円 | 197,649,153円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 32,623,332円 | 25,055,668円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 908,478,453円 | 627,330,937円 |
| 外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用） | －円 | 812,920円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 399,976,869円 | 550,738,616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） | 900,220,105円 | 1,489,095,675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） | 305,036,599円 | 529,688,114円 |

| | | |
|---|---|---|
| Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス | 992,761円 | 5,542,491円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 175,432円 | 197,868円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） | 391,225,801円 | 723,449,418円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 291,084,495円 | 557,965,043円 |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | －円 | 8,203,476円 |
| ＤＣダイワ外国株式インデックス | 24,052,269,212円 | 27,624,252,366円 |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 500,509,712円 | 569,101,264円 |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 709,804,567円 | 839,595,806円 |
| ダイワ・ライフ・バランス７０ | 564,304,287円 | 676,868,528円 |
| 大和ＤＣ海外株式インデックスファンド | 1,438,818,935円 | 1,489,592,147円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 5,379,290円 | 4,144,667円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 14,469,810円 | 13,247,986円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 3,513,286円 | 4,228,403円 |
| ダイワつみたてインデックス外国株式 | －円 | 4,608,188円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ | 81,383円 | 76,173円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ | 162,594円 | 156,042円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ | 2,143,628円 | 1,204,032円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ | 8,975,878円 | 2,140,945円 |
| ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 506,282,561円 | 237,257,604円 |
| ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 392,714,678円 | 353,114,328円 |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 3,809,894,746円 | 3,137,819,193円 |
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 179,797,597円 | 153,703,054円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国株式 | 498,683,806円 | 631,981,535円 |

| | | |
|---|---|---|
| ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド | 44,190,165円 | 88,367,711円 |
| ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用） | 464,730円 | 453,744円 |
| ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス | 2,755,474,027円 | 2,746,321,380円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 20,423,108円 | 19,463,084円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 71,323,850円 | 70,173,613円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 58,671,546円 | 58,841,550円 |
| 計 | 39,734,106,968円 | 43,964,024,902円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 39,734,106,968口 | 43,964,024,902口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 株式 | 13,300,631,037 | 54,564,220 |
| 投資証券 | 212,840,757 | △24,568,003 |
| 合計 | 13,513,471,794 | 29,996,217 |

（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（平成28年12月1日から平成29年11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | 平成30年11月30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 | 1,687,670,488 | － | 1,735,374,375 | 47,703,887 | 2,386,774,786 | － | 2,428,842,371 | 42,067,585 |
| 合計 | 1,687,670,488 | － | 1,735,374,375 | 47,703,887 | 2,386,774,786 | － | 2,428,842,371 | 42,067,585 |

（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 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | 500,889,700 | － | 504,000,000 | 3,110,300 | 941,976,460 | － | 941,137,000 | △839,460 |
| アメリカ・ドル | 500,889,700 | － | 504,000,000 | 3,110,300 | 941,976,460 | － | 941,137,000 | △839,460 |
| 合計 | 500,889,700 | － | 504,000,000 | 3,110,300 | 941,976,460 | － | 941,137,000 | △839,460 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.3891円<br>(23,891円) | 2.4496円<br>(24,496円) |

**附属明細表**

**第１ 有価証券明細表**

**(1) 株式**

| 通 貨 | 銘 柄 | 株 式 数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単 価 | 金 額 | |
| アメリカ・ドル | | 株 | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル | |
| | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 3,050 | 101.770 | 310,398.500 | |
| | PALO ALTO NETWORKS INC | 2,500 | 176.050 | 440,125.000 | |
| | KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN | 4,800 | 61.520 | 295,296.000 | |
| | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 1,600 | 147.520 | 236,032.000 | |
| | SYNCHRONY FINANCIAL | 18,800 | 25.970 | 488,236.000 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 45,666 | 73.260 | 3,345,491.160 | |
| | ARCONIC INC | 11,333 | 21.340 | 241,846.220 | |
| | VERISK ANALYTICS INC | 4,150 | 123.830 | 513,894.500 | |
| | LAS VEGAS SANDS CORP | 10,500 | 54.470 | 571,935.000 | |
| | AMPHENOL CORP-CL A | 7,800 | 87.010 | 678,678.000 | |
| | FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 8,479 | 105.850 | 897,502.150 | |
| | QORVO INC | 3,400 | 65.290 | 221,986.000 | |
| | AFLAC INC | 20,300 | 45.400 | 921,620.000 | |
| | DARDEN RESTAURANTS INC | 3,150 | 111.260 | 350,469.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 3,900 | 55.910 | 218,049.000 | |
| ADOBE INC | 12,780 | 249.090 | 3,183,370.200 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 5,950 | 43.500 | 258,825.000 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 2,600 | 129.460 | 336,596.000 | |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL | 10,000 | 16.370 | 163,700.000 | |
| GARMIN LTD | 2,900 | 65.980 | 191,342.000 | |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 5,800 | 159.210 | 923,418.000 | |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 19,200 | 145.740 | 2,798,208.000 | |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 4,171 | 87.200 | 363,711.200 | |
| WR BERKLEY CORP | 2,550 | 78.450 | 200,047.500 | |
| AUTOZONE INC | 700 | 825.830 | 578,081.000 | |
| DOLLAR TREE INC | 6,321 | 88.430 | 558,966.030 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 25,700 | 21.900 | 562,830.000 | |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 2,950 | 88.840 | 262,078.000 | |
| CELANESE CORP | 3,550 | 100.550 | 356,952.500 | |
| DR HORTON INC | 9,416 | 37.350 | 351,687.600 | |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 2,450 | 46.360 | 113,582.000 | |
| DENTSPLY SIRONA INC | 5,900 | 36.990 | 218,241.000 | |
| AUTODESK INC | 5,750 | 145.550 | 836,912.500 | |
| MOODY'S CORP | 4,450 | 156.640 | 697,048.000 | |
| DEVON ENERGY CORP | 13,950 | 26.910 | 375,394.500 | |
| ALBEMARLE CORP | 2,800 | 96.420 | 269,976.000 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 2,800 | 93.450 | 261,660.000 | |
| ALLIANT ENERGY CORP | 6,250 | 44.670 | 279,187.500 | |
| CITIGROUP INC | 66,073 | 64.900 | 4,288,137.700 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 11,500 | 145.850 | 1,677,275.000 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 13,000 | 76.350 | 992,550.000 | |
| ALLEGHANY CORP | 410 | 632.000 | 259,120.000 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 1,100 | 280.180 | 308,198.000 | |
| HESS CORP | 7,200 | 54.440 | 391,968.000 | |
| DAVITA INC | 3,500 | 65.660 | 229,810.000 | |
| DANAHER CORP | 16,300 | 107.940 | 1,759,422.000 | |
| FORTIVE CORP | 7,800 | 74.130 | 578,214.000 | |
| AVNET INC | 3,200 | 43.400 | 138,880.000 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 15,150 | 81.090 | 1,228,513.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 4,900 | 23.140 | 113,386.000 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 4,728 | 21.750 | 102,834.000 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 14,350 | 46.040 | 660,674.000 | |
| BUNGE LTD | 3,600 | 57.960 | 208,656.000 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 8,925 | 75.700 | 675,622.500 | |
| APPLE INC | 127,250 | 179.550 | 22,847,737.500 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 9,000 | 71.220 | 640,980.000 | |
| BOEING CO/THE | 14,310 | 342.560 | 4,902,033.600 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 3,915 | 81.480 | 318,994.200 | |
| BECTON DICKINSON AND CO | 7,019 | 250.100 | 1,755,451.900 | |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | 6,700 | 18.120 | 121,404.000 | |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 3,850 | 62.080 | 239,008.000 | |
| CDK GLOBAL INC | 3,200 | 50.180 | 160,576.000 | |
| NISOURCE INC | 9,350 | 26.050 | 243,567.500 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 3,600 | 91.750 | 330,300.000 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 26,521 | 50.680 | 1,344,084.280 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 107,454 | 59.450 | 6,388,140.300 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 33,450 | 217.700 | 7,282,065.000 | |
| ANSYS INC | 2,250 | 159.400 | 358,650.000 | |
| H&R BLOCK INC | 5,100 | 28.240 | 144,024.000 | |
| BB&T CORP | 20,000 | 50.600 | 1,012,000.000 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 42,150 | 51.820 | 2,184,213.000 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 87,770 | 110.060 | 9,659,966.200 | |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 6,300 | 97.870 | 616,581.000 | |
| CIGNA CORP | 6,400 | 222.520 | 1,424,128.000 | |
| LKQ CORP | 8,500 | 27.780 | 236,130.000 | |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 1,000 | 130.780 | 130,780.000 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 6,862 | 48.300 | 331,434.600 | |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 7,250 | 44.120 | 319,870.000 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 3,810 | 127.580 | 486,079.800 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 6,950 | 110.890 | 770,685.500 | |
| SERVICENOW INC | 4,650 | 179.100 | 832,815.000 | |
| CATERPILLAR INC | 15,550 | 130.230 | 2,025,076.500 | |
| CMS ENERGY CORP | 7,200 | 51.310 | 369,432.000 | |
| MOSAIC CO/THE | 9,750 | 36.170 | 352,657.500 | |
| DELTA AIR LINES INC | 4,750 | 58.860 | 279,585.000 | |
| CORNING INC | 21,300 | 31.860 | 678,618.000 | |
| CISCO SYSTEMS INC | 122,250 | 47.340 | 5,787,315.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MORGAN STANLEY | 34,600 | 44.510 | 1,540,046.000 | |
| WABCO HOLDINGS INC | 1,400 | 120.250 | 168,350.000 | |
| MSCI INC | 2,300 | 157.040 | 361,192.000 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 1,000 | 222.520 | 222,520.000 | |
| MIDDLEBY CORP | 1,450 | 118.070 | 171,201.500 | |
| COTY INC-CL A | 11,839 | 8.520 | 100,868.280 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 5,600 | 48.500 | 271,600.000 | |
| BROADCOM INC | 10,802 | 235.780 | 2,546,895.560 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 1,050 | 117.290 | 123,154.500 | |
| ACUITY BRANDS INC | 1,000 | 129.060 | 129,060.000 | |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 2,430 | 80.610 | 195,882.300 | |
| ARAMARK | 6,450 | 37.840 | 244,068.000 | |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 5,350 | 24.640 | 131,824.000 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 4,650 | 117.670 | 547,165.500 | |
| CENTENE CORP | 5,450 | 141.940 | 773,573.000 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 3,000 | 106.830 | 320,490.000 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 12,900 | 36.030 | 464,787.000 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 4,650 | 78.030 | 362,839.500 | |
| GARTNER INC | 2,350 | 153.150 | 359,902.500 | |
| SPLUNK INC | 3,800 | 101.630 | 386,194.000 | |
| AGCO CORP | 1,700 | 58.500 | 99,450.000 | |
| DOMINION ENERGY INC | 17,200 | 73.750 | 1,268,500.000 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 11,100 | 58.800 | 652,680.000 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 3,650 | 46.840 | 170,966.000 | |
| DEERE & CO | 8,000 | 149.970 | 1,199,760.000 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 4,250 | 110.750 | 470,687.500 | |
| VMWARE INC-CLASS A | 1,950 | 161.480 | 314,886.000 | |
| CHEMOURS CO/THE | 4,550 | 28.500 | 129,675.000 | |
| NASDAQ INC | 3,150 | 90.390 | 284,728.500 | |
| VAIL RESORTS INC | 1,020 | 277.770 | 283,325.400 | |
| EAST WEST BANCORP INC | 3,650 | 52.880 | 193,012.000 | |
| TARGA RESOURCES CORP | 5,850 | 45.210 | 264,478.500 | |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 1,650 | 147.480 | 243,342.000 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 1,980 | 102.800 | 203,544.000 | |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 1,050 | 71.820 | 75,411.000 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 8,000 | 79.240 | 633,920.000 | |
| COGNEX CORP | 4,550 | 42.360 | 192,738.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TELEFLEX INC | 1,230 | 271.510 | 333,957.300 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 2,300 | 106.240 | 244,352.000 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 3,150 | 98.690 | 310,873.500 | |
| IDEX CORP | 1,950 | 134.360 | 262,002.000 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 21,650 | 63.040 | 1,364,816.000 | |
| ROLLINS INC | 2,550 | 63.750 | 162,562.500 | |
| AMETEK INC | 6,175 | 73.220 | 452,133.500 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 6,500 | 65.960 | 428,740.000 | |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 3,200 | 34.350 | 109,920.000 | |
| XPO LOGISTICS INC | 3,100 | 76.340 | 236,654.000 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 8,550 | 93.020 | 795,321.000 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 11,400 | 231.000 | 2,633,400.000 | |
| SCANA CORP | 3,500 | 46.110 | 161,385.000 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 1,350 | 111.580 | 150,633.000 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 650 | 482.560 | 313,664.000 | |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN | 7,600 | 21.970 | 166,972.000 | |
| UGI CORP | 4,600 | 56.770 | 261,142.000 | |
| CUMMINS INC | 4,050 | 148.200 | 600,210.000 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 19,150 | 52.560 | 1,006,524.000 | |
| SABRE CORP | 6,850 | 26.040 | 178,374.000 | |
| CDW CORP/DE | 4,050 | 92.390 | 374,179.500 | |
| SIGNATURE BANK | 1,500 | 122.590 | 183,885.000 | |
| COSTAR GROUP INC | 970 | 370.430 | 359,317.100 | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 1,390 | 243.720 | 338,770.800 | |
| AMERCO | 220 | 348.670 | 76,707.400 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 1,650 | 135.010 | 222,766.500 | |
| MERCADOLIBRE INC | 1,090 | 357.990 | 390,209.100 | |
| HANESBRANDS INC | 9,500 | 15.660 | 148,770.000 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 1,950 | 139.130 | 271,303.500 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 7,416 | 76.460 | 567,027.360 | |
| COMMSCOPE HOLDING CO INC | 4,600 | 17.680 | 81,328.000 | |
| IPG PHOTONICS CORP | 1,020 | 141.290 | 144,115.800 | |
| COPART INC | 5,400 | 51.710 | 279,234.000 | |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 2,650 | 112.000 | 296,800.000 | |
| SEATTLE GENETICS INC | 2,900 | 62.880 | 182,352.000 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 1,950 | 228.700 | 445,965.000 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 1,280 | 367.370 | 470,233.600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 9,000 | 27.150 | 244,350.000 | |
| KINDER MORGAN INC | 50,981 | 16.870 | 860,049.470 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 7,350 | 144.500 | 1,062,075.000 | |
| CABOT OIL & GAS CORP | 12,050 | 24.690 | 297,514.500 | |
| T-MOBILE US INC | 9,000 | 68.680 | 618,120.000 | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 2,900 | 36.800 | 106,720.000 | |
| COCA-COLA CO/THE | 105,100 | 48.980 | 5,147,798.000 | |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 5,750 | 48.730 | 280,197.500 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 4,550 | 75.870 | 345,208.500 | |
| EATON VANCE CORP | 3,050 | 40.700 | 124,135.000 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 8,650 | 33.500 | 289,775.000 | |
| CSX CORP | 21,400 | 71.770 | 1,535,878.000 | |
| FLUOR CORP | 3,650 | 41.080 | 149,942.000 | |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 2,600 | 161.810 | 420,706.000 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 3,225 | 119.740 | 386,161.500 | |
| AUTOLIV INC | 2,150 | 86.330 | 185,609.500 | |
| AMAZON.COM INC | 10,740 | 1,673.570 | 17,974,141.800 | |
| PARSLEY ENERGY INC-CLASS A | 6,650 | 20.870 | 138,785.500 | |
| FLOWSERVE CORP | 3,200 | 47.740 | 152,768.000 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 5,450 | 162.800 | 887,260.000 | |
| EXXON MOBIL CORP | 109,905 | 79.060 | 8,689,089.300 | |
| FLIR SYSTEMS INC | 3,400 | 45.670 | 155,278.000 | |
| AES CORP | 17,000 | 15.440 | 262,480.000 | |
| L3 TECHNOLOGIES INC | 2,050 | 182.940 | 375,027.000 | |
| EVEREST RE GROUP LTD | 1,020 | 220.120 | 224,522.400 | |
| EOG RESOURCES INC | 15,250 | 105.470 | 1,608,417.500 | |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 4,450 | 68.110 | 303,089.500 | |
| ABIOMED INC | 1,080 | 331.990 | 358,549.200 | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 4,250 | 90.500 | 384,625.000 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 8,390 | 71.570 | 600,472.300 | |
| FORD MOTOR CO | 95,623 | 9.370 | 895,987.510 | |
| MACY'S INC | 8,098 | 33.740 | 273,226.520 | |
| DISCOVERY INC - A | 3,990 | 31.630 | 126,203.700 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 4,887 | 24.920 | 121,784.040 | |
| DISCOVERY INC-C | 7,989 | 28.660 | 228,964.740 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 3,400 | 52.630 | 178,942.000 | |
| FORTINET INC | 3,800 | 73.900 | 280,820.000 | |
| MARKEL CORP | 360 | 1,116.150 | 401,814.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 4,400 | 21.820 | 96,008.000 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 12,250 | 177.120 | 2,169,720.000 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 36,408 | 11.820 | 430,342.560 | |
| US BANCORP | 40,350 | 54.040 | 2,180,514.000 | |
| UNITED RENTALS INC | 2,150 | 115.920 | 249,228.000 | |
| F5 NETWORKS INC | 1,600 | 173.530 | 277,648.000 | |
| FASTENAL CO | 7,700 | 59.260 | 456,302.000 | |
| FISERV INC | 10,700 | 78.440 | 839,308.000 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 226,350 | 7.940 | 1,797,219.000 | |
| NEKTAR THERAPEUTICS | 4,450 | 39.260 | 174,707.000 | |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 5,600 | 51.560 | 288,736.000 | |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 6,050 | 23.070 | 139,573.500 | |
| GENERAL MOTORS CO | 33,400 | 36.760 | 1,227,784.000 | |
| TRIPADVISOR INC | 2,750 | 63.540 | 174,735.000 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 6,600 | 182.170 | 1,202,322.000 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 9,340 | 194.850 | 1,819,899.000 | |
| ALPHABET INC-CL A | 7,760 | 1,094.580 | 8,493,940.800 | |
| ALPHABET INC-CL C | 8,177 | 1,088.300 | 8,899,029.100 | |
| OWENS CORNING | 2,750 | 51.590 | 141,872.500 | |
| GENERAL MILLS INC | 15,650 | 42.210 | 660,586.500 | |
| FIRSTENERGY CORP | 12,568 | 37.150 | 466,901.200 | |
| GENUINE PARTS CO | 3,750 | 103.090 | 386,587.500 | |
| IHS MARKIT LTD | 10,184 | 52.800 | 537,715.200 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 17,600 | 27.540 | 484,704.000 | |
| HARRIS CORP | 3,050 | 143.130 | 436,546.500 | |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 3,000 | 38.420 | 115,260.000 | |
| HALLIBURTON CO | 23,400 | 31.890 | 746,226.000 | |
| HOME DEPOT INC | 29,850 | 175.660 | 5,243,451.000 | |
| ASSURANT INC | 1,400 | 97.800 | 136,920.000 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 29,400 | 14.500 | 426,300.000 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 1,190 | 214.850 | 255,671.500 | |
| HERSHEY CO/THE | 3,750 | 107.450 | 402,937.500 | |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 4,450 | 42.490 | 189,080.500 | |
| HUMANA INC | 3,600 | 330.290 | 1,189,044.000 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 8,950 | 82.910 | 742,044.500 | |
| HELMERICH & PAYNE | 2,900 | 61.150 | 177,335.000 | |
| HENRY SCHEIN INC | 4,050 | 89.140 | 361,017.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HP INC | 43,300 | 22.860 | 989,838.000 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 39,400 | 15.120 | 595,728.000 | |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 4,800 | 39.890 | 191,472.000 | |
| HOLLYFRONTIER CORP | 4,300 | 61.680 | 265,224.000 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 5,450 | 30.380 | 165,571.000 | |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 2,100 | 39.620 | 83,202.000 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 10,350 | 28.380 | 293,733.000 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 16,153 | 51.190 | 826,872.070 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 23,850 | 121.480 | 2,897,298.000 | |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 10,000 | 45.740 | 457,400.000 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 3,600 | 43.420 | 156,312.000 | |
| ZOETIS INC | 12,650 | 92.770 | 1,173,540.500 | |
| INGERSOLL-RAND PLC | 6,579 | 103.370 | 680,071.230 | |
| CHENIERE ENERGY INC | 5,450 | 61.650 | 335,992.500 | |
| ALLEGION PLC | 2,450 | 91.750 | 224,787.500 | |
| LEGGETT & PLATT INC | 3,500 | 38.780 | 135,730.000 | |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C | 13,673 | 24.360 | 333,074.280 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 6,857 | 78.300 | 536,903.100 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 8,900 | 28.590 | 254,451.000 | |
| JM SMUCKER CO/THE | 2,920 | 103.440 | 302,044.800 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 69,600 | 145.850 | 10,151,160.000 | |
| ABBVIE INC | 39,429 | 89.910 | 3,545,061.390 | |
| HOLOGIC INC | 7,100 | 44.410 | 315,311.000 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 8,950 | 114.950 | 1,028,802.500 | |
| KROGER CO | 21,850 | 30.360 | 663,366.000 | |
| KLA-TENCOR CORP | 4,100 | 96.690 | 396,429.000 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 6,670 | 302.420 | 2,017,141.400 | |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 2,320 | 191.680 | 444,697.600 | |
| L BRANDS INC | 5,900 | 33.590 | 198,181.000 | |
| LOWE'S COS INC | 21,200 | 93.200 | 1,975,840.000 | |
| ELI LILLY & CO | 25,250 | 117.000 | 2,954,250.000 | |
| LAM RESEARCH CORP | 4,230 | 152.750 | 646,132.500 | |
| JONES LANG LASALLE INC | 1,250 | 141.190 | 176,487.500 | |
| LOEWS CORP | 7,250 | 47.980 | 347,855.000 | |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 5,799 | 62.490 | 362,379.510 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MCDONALD'S CORP | 20,350 | 189.260 | 3,851,441.000 | |
| 3M CO | 15,350 | 204.560 | 3,139,996.000 | |
| FACEBOOK INC-CLASS A | 62,450 | 138.680 | 8,660,566.000 | |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V | 5,104 | 106.000 | 541,024.000 | |
| MANPOWERGROUP INC | 1,600 | 80.150 | 128,240.000 | |
| S&P GLOBAL INC | 6,500 | 180.350 | 1,172,275.000 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 1,600 | 196.810 | 314,896.000 | |
| CONCHO RESOURCES INC | 5,250 | 131.500 | 690,375.000 | |
| FIRST DATA CORP- CLASS A | 13,450 | 18.970 | 255,146.500 | |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 5,300 | 26.000 | 137,800.000 | |
| PHILLIPS 66 | 11,600 | 92.680 | 1,075,088.000 | |
| TECHNIPFMC PLC | 11,150 | 23.690 | 264,143.500 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 13,400 | 27.320 | 366,088.000 | |
| MATTEL INC | 8,700 | 13.760 | 119,712.000 | |
| DXC TECHNOLOGY CO | 7,338 | 62.310 | 457,230.780 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 3,200 | 149.050 | 476,960.000 | |
| MYLAN NV | 13,750 | 34.040 | 468,050.000 | |
| METLIFE INC | 22,700 | 44.390 | 1,007,653.000 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 15,700 | 16.070 | 252,299.000 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 1,390 | 236.310 | 328,470.900 | |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 4,200 | 43.110 | 181,062.000 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 4,278 | 132.580 | 567,177.240 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 640 | 630.920 | 403,788.800 | |
| BAKER HUGHES A GE CO | 13,273 | 23.110 | 306,739.030 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 3,230 | 171.770 | 554,817.100 | |
| BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC | 2,940 | 40.040 | 117,717.600 | |
| MERCK & CO. INC. | 69,621 | 77.910 | 5,424,172.110 | |
| DOWDUPONT INC | 59,855 | 57.240 | 3,426,100.200 | |
| MASCO CORP | 7,900 | 31.280 | 247,112.000 | |
| M & T BANK CORP | 3,519 | 168.690 | 593,620.110 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 13,250 | 87.170 | 1,155,002.500 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 7,722 | 121.840 | 940,848.480 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 3,750 | 145.300 | 544,875.000 | |
| SQUARE INC - A | 7,750 | 69.900 | 541,725.000 | |
| TRANSUNION | 4,700 | 63.830 | 300,001.000 | |
| VISTRA ENERGY CORP | 8,700 | 23.200 | 201,840.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 3,850 | 43.800 | 168,630.000 | |
| WORLDPAY INC-CLASS A | 7,950 | 85.580 | 680,361.000 | |
| NETAPP INC | 6,850 | 67.400 | 461,690.000 | |
| NIKE INC -CL B | 33,200 | 74.340 | 2,468,088.000 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 7,400 | 168.440 | 1,246,456.000 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 6,000 | 74.420 | 446,520.000 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 3,450 | 76.270 | 263,131.500 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 11,450 | 26.480 | 303,196.000 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 4,300 | 260.670 | 1,120,881.000 | |
| APTIV PLC | 6,850 | 71.500 | 489,775.000 | |
| NEWMONT MINING CORP | 14,000 | 32.340 | 452,760.000 | |
| MCKESSON CORP | 5,300 | 127.010 | 673,153.000 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 7,100 | 55.340 | 392,914.000 | |
| XYLEM INC | 4,800 | 71.300 | 342,240.000 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 40,450 | 86.960 | 3,517,532.000 | |
| NUCOR CORP | 8,200 | 59.980 | 491,836.000 | |
| WESTERN UNION CO | 11,746 | 18.680 | 219,415.280 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 4,500 | 65.860 | 296,370.000 | |
| NEWELL BRANDS INC | 12,292 | 23.800 | 292,549.600 | |
| EVERGY INC | 6,950 | 58.820 | 408,799.000 | |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 19,700 | 70.910 | 1,396,927.000 | |
| LIBERTY BROADBAND-C | 2,850 | 84.630 | 241,195.500 | |
| LINDE PLC | 14,796 | 159.310 | 2,357,150.760 | |
| PAYCHEX INC | 8,350 | 69.920 | 583,832.000 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 2,120 | 354.850 | 752,282.000 | |
| ALTRIA GROUP INC | 49,100 | 55.940 | 2,746,654.000 | |
| P G & E CORP | 13,250 | 26.760 | 354,570.000 | |
| PFIZER INC | 152,013 | 45.510 | 6,918,111.630 | |
| ALKERMES PLC | 4,000 | 35.750 | 143,000.000 | |
| XCEL ENERGY INC | 13,150 | 51.530 | 677,619.500 | |
| STRYKER CORP | 8,700 | 170.910 | 1,486,917.000 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 3,500 | 168.900 | 591,150.000 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 4,500 | 149.170 | 671,265.000 | |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 1,550 | 96.390 | 149,404.500 | |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 65,067 | 92.820 | 6,039,518.940 | |
| EXELON CORP | 25,472 | 45.670 | 1,163,306.240 | |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 5,750 | 123.340 | 709,205.000 | |
| NVR INC | 90 | 2,473.770 | 222,639.300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CONOCOPHILLIPS | 30,300 | 66.870 | 2,026,161.000 | |
| PEPSICO INC | 36,600 | 118.270 | 4,328,682.000 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 11,000 | 92.910 | 1,022,010.000 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 4,850 | 92.480 | 448,528.000 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 16,700 | 161.070 | 2,689,869.000 | |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 2,200 | 55.310 | 121,682.000 | |
| PENTAIR PLC | 4,205 | 42.470 | 178,586.350 | |
| QUALCOMM INC | 36,950 | 58.110 | 2,147,164.500 | |
| INVESCO LTD | 10,950 | 20.250 | 221,737.500 | |
| ADVANCE AUTO PARTS INC | 1,900 | 177.670 | 337,573.000 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 7,200 | 49.680 | 357,696.000 | |
| RAYTHEON COMPANY | 7,520 | 173.580 | 1,305,321.600 | |
| RED HAT INC | 4,550 | 177.890 | 809,399.500 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 2,090 | 359.570 | 751,501.300 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 6,000 | 76.790 | 460,740.000 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 1,250 | 1,865.150 | 2,331,437.500 | |
| ROSS STORES INC | 9,950 | 85.940 | 855,103.000 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 2,400 | 96.500 | 231,600.000 | |
| RESMED INC | 3,700 | 110.500 | 408,850.000 | |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 3,550 | 87.940 | 312,187.000 | |
| ROBERT HALF INTL INC | 3,050 | 61.820 | 188,551.000 | |
| RALPH LAUREN CORP | 1,450 | 111.290 | 161,370.500 | |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 28,835 | 16.210 | 467,415.350 | |
| CHEVRON CORP | 49,718 | 118.850 | 5,908,984.300 | |
| EDISON INTERNATIONAL | 8,300 | 54.720 | 454,176.000 | |
| TESLA INC | 3,300 | 341.170 | 1,125,861.000 | |
| SYMANTEC CORP | 16,150 | 22.580 | 364,667.000 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 3,922 | 127.460 | 499,898.120 | |
| SYNOPSYS INC | 3,750 | 89.520 | 335,700.000 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 4,505 | 330.330 | 1,488,136.650 | |
| CBRE GROUP INC - A | 8,700 | 43.140 | 375,318.000 | |
| TWITTER INC | 17,900 | 31.300 | 560,270.000 | |
| SOUTHERN CO/THE | 26,650 | 46.540 | 1,240,291.000 | |
| SYSCO CORP | 12,700 | 67.540 | 857,758.000 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 7,123 | 130.630 | 930,477.490 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 3,550 | 53.480 | 189,854.000 | |
| STERICYCLE INC | 2,150 | 48.210 | 103,651.500 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 6,200 | 34.980 | 216,876.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SCHLUMBERGER LTD | 35,902 | 45.900 | 1,647,901.800 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 4,600 | 45.810 | 210,726.000 | |
| AT&T INC | 188,791 | 30.570 | 5,771,340.870 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 3,650 | 53.230 | 194,289.500 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 11,000 | 18.500 | 203,500.000 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 2,190 | 419.760 | 919,274.400 | |
| SEMPRA ENERGY | 6,450 | 112.670 | 726,721.500 | |
| TIFFANY & CO | 2,950 | 89.770 | 264,821.500 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 7,050 | 42.650 | 300,682.500 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 25,300 | 97.430 | 2,464,979.000 | |
| SALESFORCE.COM INC | 18,600 | 139.720 | 2,598,792.000 | |
| WESTROCK CO | 6,630 | 46.350 | 307,300.500 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 23,884 | 34.270 | 818,504.680 | |
| UNION PACIFIC CORP | 20,150 | 150.480 | 3,032,172.000 | |
| MARATHON OIL CORP | 22,600 | 16.550 | 374,030.000 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 17,838 | 64.900 | 1,157,686.200 | |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 21,437 | 121.200 | 2,598,164.400 | |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 17,900 | 113.260 | 2,027,354.000 | |
| UNUM GROUP | 5,900 | 36.390 | 214,701.000 | |
| SPRINT CORP | 20,765 | 6.320 | 131,234.800 | |
| ANTERO RESOURCES CORP | 5,100 | 13.480 | 68,748.000 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 4,194 | 124.950 | 524,040.300 | |
| VOYA FINANCIAL INC | 4,350 | 44.670 | 194,314.500 | |
| AMEREN CORPORATION | 6,250 | 67.820 | 423,875.000 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 24,976 | 282.550 | 7,056,968.800 | |
| VERISIGN INC | 2,900 | 156.660 | 454,314.000 | |
| VALERO ENERGY CORP | 11,292 | 79.470 | 897,375.240 | |
| ULTA BEAUTY INC | 1,510 | 300.370 | 453,558.700 | |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 6,838 | 33.180 | 226,884.840 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 2,300 | 137.860 | 317,078.000 | |
| ANTHEM INC | 6,740 | 292.170 | 1,969,225.800 | |
| WALT DISNEY CO/THE | 38,700 | 116.610 | 4,512,807.000 | |
| WELLS FARGO & CO | 119,622 | 54.040 | 6,464,372.880 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 11,050 | 92.720 | 1,024,556.000 | |
| WILLIAMS COS INC | 31,900 | 25.560 | 815,364.000 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 3,200 | 94.670 | 302,944.000 | |
| WHIRLPOOL CORP | 1,700 | 126.400 | 214,880.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WALMART INC | 38,200 | 97.290 | 3,716,478.000 | |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A | 2,900 | 81.240 | 235,596.000 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 5,300 | 114.960 | 609,288.000 | |
| WYNN RESORTS LTD | 2,600 | 108.120 | 281,112.000 | |
| XEROX CORP | 5,911 | 26.880 | 158,887.680 | |
| WABTEC CORP | 2,250 | 92.660 | 208,485.000 | |
| TJX COMPANIES INC | 32,800 | 47.490 | 1,557,672.000 | |
| WATERS CORP | 2,050 | 203.490 | 417,154.500 | |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS | 1,800 | 95.070 | 171,126.000 | |
| ALLERGAN PLC | 8,857 | 155.240 | 1,374,960.680 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 22,000 | 84.850 | 1,866,700.000 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 3,523 | 158.490 | 558,360.270 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 7,800 | 45.520 | 355,056.000 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 8,280 | 71.000 | 587,880.000 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 13,400 | 54.520 | 730,568.000 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 46,050 | 139.100 | 6,405,555.000 | |
| PPL CORP | 18,600 | 30.670 | 570,462.000 | |
| PULTEGROUP INC | 6,900 | 26.730 | 184,437.000 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 6,450 | 108.470 | 699,631.500 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 5,650 | 97.000 | 548,050.000 | |
| NVIDIA CORP | 15,000 | 157.360 | 2,360,400.000 | |
| IAC/INTERACTIVECORP | 2,050 | 180.280 | 369,574.000 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 12,243 | 133.650 | 1,636,276.950 | |
| QURATE RETAIL INC | 11,450 | 22.440 | 256,938.000 | |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 4,700 | 39.280 | 184,616.000 | |
| TYSON FOODS INC-CL A | 7,900 | 57.720 | 455,988.000 | |
| NETFLIX INC | 11,340 | 288.750 | 3,274,425.000 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 10,500 | 248.570 | 2,609,985.000 | |
| TORCHMARK CORP | 2,925 | 87.320 | 255,411.000 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 4,250 | 96.190 | 408,807.500 | |
| TEXTRON INC | 6,850 | 55.960 | 383,326.000 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A | 27,500 | 49.530 | 1,362,075.000 | |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B | 11,600 | 49.300 | 571,880.000 | |
| NEWS CORP - CLASS A | 10,237 | 13.210 | 135,230.770 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| OGE ENERGY CORP | 5,300 | 38.890 | 206,117.000 | |
| OMNICOM GROUP | 6,050 | 77.180 | 466,939.000 | |
| ORACLE CORP | 79,283 | 47.900 | 3,797,655.700 | |
| MASTERCARD INC - A | 24,050 | 196.660 | 4,729,673.000 | |
| ONEOK INC | 10,750 | 61.340 | 659,405.000 | |
| CENTURYLINK INC | 25,352 | 18.620 | 472,054.240 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 2,720 | 293.870 | 799,326.400 | |
| YUM! BRANDS INC | 8,300 | 91.860 | 762,438.000 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 3,050 | 111.910 | 341,325.500 | |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 1,330 | 196.700 | 261,611.000 | |
| MOLSON COORS BREWING CO -B | 5,050 | 64.310 | 324,765.500 | |
| NOBLE ENERGY INC | 12,400 | 24.270 | 300,948.000 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 249,101 | 28.040 | 6,984,792.040 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 4,600 | 96.750 | 445,050.000 | |
| NORDSTROM INC | 3,000 | 52.300 | 156,900.000 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 19,050 | 111.310 | 2,120,455.500 | |
| ANALOG DEVICES INC | 9,549 | 89.520 | 854,826.480 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 23,800 | 21.430 | 510,034.000 | |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 7,200 | 53.120 | 382,464.000 | |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 23,022 | 43.440 | 1,000,075.680 | |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 13,500 | 53.700 | 724,950.000 | |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 4,800 | 71.230 | 341,904.000 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 4,450 | 111.630 | 496,753.500 | |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 5,100 | 17.550 | 89,505.000 | |
| AVERY DENNISON CORP | 2,300 | 95.330 | 219,259.000 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 15,350 | 70.300 | 1,079,105.000 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 16,550 | 67.330 | 1,114,311.500 | |
| AON PLC | 6,300 | 163.680 | 1,031,184.000 | |
| AMGEN INC | 17,250 | 202.370 | 3,490,882.500 | |
| TAPESTRY INC | 7,650 | 38.010 | 290,776.500 | |
| EATON CORP PLC | 11,536 | 76.010 | 876,851.360 | |
| CELGENE CORP | 19,200 | 70.160 | 1,347,072.000 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 4,330 | 196.210 | 849,589.300 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 26,300 | 36.540 | 961,002.000 | |
| CIT GROUP INC | 3,300 | 46.290 | 152,757.000 | |
| CIMAREX ENERGY CO | 2,500 | 83.600 | 209,000.000 | |
| CME GROUP INC | 9,350 | 188.910 | 1,766,308.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 9,894 | 32.730 | 323,830.620 | |
| ECOLAB INC | 6,850 | 158.390 | 1,084,971.500 | |
| EQUIFAX INC | 3,150 | 102.800 | 323,820.000 | |
| GAP INC/THE | 5,950 | 26.650 | 158,567.500 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 33,600 | 69.690 | 2,341,584.000 | |
| HORMEL FOODS CORP | 7,750 | 45.230 | 350,532.500 | |
| STATE STREET CORP | 9,743 | 72.370 | 705,100.910 | |
| SUNTRUST BANKS INC | 12,048 | 62.490 | 752,879.520 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 31,800 | 44.160 | 1,404,288.000 | |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 13,100 | 68.020 | 891,062.000 | |
| CAMPBELL SOUP CO | 4,850 | 39.630 | 192,205.500 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 3,450 | 50.930 | 175,708.500 | |
| CARDINAL HEALTH INC | 8,300 | 55.020 | 456,666.000 | |
| FEDEX CORP | 6,600 | 227.500 | 1,501,500.000 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 12,654 | 88.870 | 1,124,560.980 | |
| FMC CORP | 3,600 | 83.050 | 298,980.000 | |
| FLEX LTD | 12,900 | 8.550 | 110,295.000 | |
| CERNER CORP | 7,750 | 57.350 | 444,462.500 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 2,624 | 141.580 | 371,505.920 | |
| CITRIX SYSTEMS INC | 3,700 | 110.460 | 408,702.000 | |
| INTEL CORP | 120,500 | 47.700 | 5,747,850.000 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 10,200 | 24.350 | 248,370.000 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 9,100 | 44.280 | 402,948.000 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 7,950 | 135.900 | 1,080,405.000 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 41,700 | 6.320 | 263,544.000 | |
| ILLUMINA INC | 3,870 | 337.960 | 1,307,905.200 | |
| SEALED AIR CORP | 4,400 | 36.410 | 160,204.000 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 2,970 | 520.970 | 1,547,280.900 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 3,450 | 110.380 | 380,811.000 | |
| SNAP-ON INC | 1,550 | 164.000 | 254,200.000 | |
| CARMAX INC | 4,600 | 66.090 | 304,014.000 | |
| COMERICA INC | 4,500 | 78.990 | 355,455.000 | |
| INGREDION INC | 1,900 | 103.810 | 197,239.000 | |
| DUKE ENERGY CORP | 18,378 | 87.600 | 1,609,912.800 | |
| TARGET CORP | 13,250 | 71.170 | 943,002.500 | |
| DOVER CORP | 3,900 | 84.040 | 327,756.000 | |
| WW GRAINGER INC | 1,300 | 311.190 | 404,547.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 3,400 | 65.100 | 221,340.000 | |
| CINTAS CORP | 2,350 | 188.040 | 441,894.000 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 12,700 | 32.270 | 409,829.000 | |
| CLOROX COMPANY | 3,300 | 166.050 | 547,965.000 | |
| ENTERGY CORP | 4,750 | 85.870 | 407,882.500 | |
| MICROSOFT CORP | 189,200 | 110.190 | 20,847,948.000 | |
| INCYTE CORP | 4,600 | 64.790 | 298,034.000 | |
| CVS HEALTH CORP | 33,569 | 80.000 | 2,685,520.000 | |
| MEDTRONIC PLC | 34,988 | 96.600 | 3,379,840.800 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 30,550 | 37.910 | 1,158,150.500 | |
| BLACKROCK INC | 3,130 | 422.940 | 1,323,802.200 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 12,900 | 27.740 | 357,846.000 | |
| HASBRO INC | 3,100 | 96.850 | 300,235.000 | |
| KELLOGG CO | 6,850 | 63.250 | 433,262.500 | |
| KEYCORP | 28,200 | 18.140 | 511,548.000 | |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 2,750 | 101.180 | 278,245.000 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 38,461 | 44.530 | 1,712,668.330 | |
| KOHLS CORP | 4,450 | 67.100 | 298,595.000 | |
| COOPER COS INC/THE | 1,300 | 277.420 | 360,646.000 | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 12,000 | 10.560 | 126,720.000 | |
| APACHE CORP | 9,860 | 35.540 | 350,424.400 | |
| CHUBB LTD | 12,049 | 134.210 | 1,617,096.290 | |
| ARROW ELECTRONICS INC | 2,150 | 76.470 | 164,410.500 | |
| ALLSTATE CORP | 9,200 | 88.480 | 814,016.000 | |
| EBAY INC | 24,900 | 29.520 | 735,048.000 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 29,300 | 84.260 | 2,468,818.000 | |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 3,750 | 79.040 | 296,400.000 | |
| XILINX INC | 6,550 | 91.200 | 597,360.000 | |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 14,710 | 101.220 | 1,488,946.200 | |
| DISH NETWORK CORP-A | 5,750 | 32.960 | 189,520.000 | |
| ZIONS BANCORP NA | 5,200 | 48.210 | 250,692.000 | |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 5,750 | 141.500 | 813,625.000 | |
| TOLL BROTHERS INC | 3,800 | 33.610 | 127,718.000 | |
| TRIMBLE INC | 6,400 | 37.400 | 239,360.000 | |
| LENNAR CORP-A | 7,600 | 43.040 | 327,104.000 | |
| LEAR CORP | 1,650 | 134.870 | 222,535.500 | |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 7,000 | 51.460 | 360,220.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PROGRESSIVE CORP | 15,400 | 65.190 | 1,003,926.000 | |
| | PACCAR INC | 9,137 | 61.310 | 560,189.470 | |
| | PVH CORP | 2,000 | 109.770 | 219,540.000 | |
| | BIOGEN INC | 5,460 | 326.610 | 1,783,290.600 | |
| | IDEXX LABORATORIES INC | 2,220 | 201.120 | 446,486.400 | |
| | STARBUCKS CORP | 35,450 | 66.880 | 2,370,896.000 | |
| | PERRIGO CO PLC | 3,400 | 64.110 | 217,974.000 | |
| | EVERSOURCE ENERGY | 8,130 | 67.070 | 545,279.100 | |
| | INTUIT INC | 6,300 | 209.190 | 1,317,897.000 | |
| | BORGWARNER INC | 5,600 | 39.370 | 220,472.000 | |
| | BEST BUY CO INC | 6,500 | 64.070 | 416,455.000 | |
| | BALL CORP | 8,734 | 49.570 | 432,944.380 | |
| | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 36,047 | 37.040 | 1,335,180.880 | |
| | ELECTRONIC ARTS INC | 7,850 | 86.390 | 678,161.500 | |
| | VULCAN MATERIALS CO | 3,450 | 106.920 | 368,874.000 | |
| | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 6,600 | 179.450 | 1,184,370.000 | |
| | VF CORP | 8,700 | 79.460 | 691,302.000 | |
| | CBS CORP-CLASS B NON VOTING | 8,871 | 55.350 | 491,009.850 | |
| | VIACOM INC-CLASS B | 9,271 | 32.030 | 296,950.130 | |
| | MOHAWK INDUSTRIES INC | 1,570 | 127.380 | 199,986.600 | |
| | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 2,400 | 121.190 | 290,856.000 | |
| | CARNIVAL CORP | 11,200 | 60.730 | 680,176.000 | |
| | COMCAST CORP-CLASS A | 118,890 | 39.420 | 4,686,643.800 | |
| | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 6,100 | 36.990 | 225,639.000 | |
| | JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 5,900 | 64.900 | 382,910.000 | |
| | DAIRY FARM INTL HLDGS LTD | 9,000 | 8.850 | 79,650.000 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 31,300 | 6.380 | 199,694.000 | |
| アメリカ・ドル | 小計 | | | アメリカ・ドル<br>613,411,193.160<br>(69,603,768,088) | |
| イギリス・ポンド | | 株 | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド | |
| | MERLIN ENTERTAINMENT | 19,300 | 3.450 | 66,585.000 | |
| | TUI AG-DI | 11,897 | 11.960 | 142,288.120 | |
| | BP PLC | 530,000 | 5.221 | 2,767,130.000 | |
| | UNILEVER PLC | 32,310 | 42.545 | 1,374,628.950 | |
| | BARCLAYS PLC | 450,000 | 1.672 | 752,580.000 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 44,000 | 8.476 | 372,944.000 | |
| | MARKS & SPENCER GROUP PLC | 42,100 | 3.027 | 127,436.700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 2,480 | 64.500 | 159,960.000 | |
| PRUDENTIAL PLC | 69,000 | 15.485 | 1,068,465.000 | |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 126,791 | 2.214 | 280,715.270 | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 4,964 | 30.090 | 149,366.760 | |
| BAE SYSTEMS PLC | 85,600 | 4.903 | 419,696.800 | |
| AVIVA PLC | 107,566 | 4.114 | 442,526.520 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 130,902 | 15.976 | 2,091,290.350 | |
| INFORMA PLC | 32,000 | 7.096 | 227,072.000 | |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL | 11,500 | 15.730 | 180,895.000 | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 126,300 | 1.844 | 232,897.200 | |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | 9,300 | 3.654 | 33,982.200 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 25,300 | 4.373 | 110,636.900 | |
| DCC PLC | 2,600 | 59.350 | 154,310.000 | |
| GVC HOLDINGS PLC | 14,000 | 7.515 | 105,210.000 | |
| CONVATEC GROUP PLC | 33,000 | 1.532 | 50,572.500 | |
| ROYAL MAIL PLC | 22,300 | 3.237 | 72,185.100 | |
| NMC HEALTH PLC | 2,700 | 35.420 | 95,634.000 | |
| RELX PLC | 52,846 | 16.550 | 874,601.300 | |
| DIAGEO PLC | 65,300 | 28.290 | 1,847,337.000 | |
| RIO TINTO PLC | 31,450 | 36.190 | 1,138,175.500 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 81,300 | 6.153 | 500,238.900 | |
| TESCO PLC | 254,800 | 2.000 | 509,600.000 | |
| FRESNILLO PLC | 5,600 | 7.772 | 43,523.200 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 23,550 | 14.225 | 334,998.750 | |
| GLENCORE PLC | 306,625 | 2.933 | 899,331.120 | |
| WOOD GROUP (JOHN) PLC | 18,000 | 6.466 | 116,388.000 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 7,400 | 19.450 | 143,930.000 | |
| SMITHS GROUP PLC | 10,233 | 14.175 | 145,052.770 | |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 6,100 | 5.814 | 35,465.400 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 36,883 | 3.269 | 120,570.520 | |
| PEARSON PLC | 20,163 | 9.610 | 193,766.430 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 45,225 | 3.126 | 141,373.350 | |
| NEXT PLC | 3,550 | 50.600 | 179,630.000 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 84,200 | 1.385 | 116,659.100 | |
| WHITBREAD PLC | 4,961 | 46.660 | 231,480.260 | |
| BUNZL PLC | 8,855 | 24.520 | 217,124.600 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 702,183 | 1.677 | 1,177,982.200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 3,443 | 49.300 | 169,739.900 | |
| KINGFISHER PLC | 55,411 | 2.576 | 142,738.730 | |
| WPP PLC | 33,100 | 8.680 | 287,308.000 | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 17,127 | 7.790 | 133,419.330 | |
| SEVERN TRENT PLC | 6,333 | 18.770 | 118,870.410 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 17,850 | 66.220 | 1,182,027.000 | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 13,600 | 10.335 | 140,556.000 | |
| SCHRODERS PLC | 3,050 | 25.900 | 78,995.000 | |
| SSE PLC | 26,400 | 10.990 | 290,136.000 | |
| WEIR GROUP PLC/THE | 6,150 | 14.655 | 90,128.250 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 25,900 | 4.727 | 122,429.300 | |
| ASTRAZENECA PLC | 33,400 | 61.540 | 2,055,436.000 | |
| FERGUSON PLC | 6,237 | 50.520 | 315,093.240 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 155,100 | 2.474 | 383,717.400 | |
| 3I GROUP PLC | 25,391 | 8.582 | 217,905.560 | |
| ASHTEAD GROUP PLC | 12,700 | 17.955 | 228,028.500 | |
| SAGE GROUP PLC/THE | 27,614 | 6.060 | 167,340.840 | |
| NATIONAL GRID PLC | 90,034 | 8.340 | 750,883.560 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 1,919,965 | 0.561 | 1,077,868.350 | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 26,260 | 5.398 | 141,751.480 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 25,400 | 24.180 | 614,172.000 | |
| CENTRICA PLC | 152,660 | 1.361 | 207,846.590 | |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 3,200 | 33.060 | 105,792.000 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 60,510 | 27.810 | 1,682,783.100 | |
| BHP GROUP PLC | 56,577 | 15.310 | 866,193.870 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 9,100 | 24.470 | 222,677.000 | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 530,250 | 6.692 | 3,548,433.000 | |
| SHIRE PLC | 24,324 | 45.050 | 1,095,796.200 | |
| ANGLO AMERICAN PLC | 32,883 | 16.110 | 529,745.130 | |
| MONDI PLC | 9,350 | 17.340 | 162,129.000 | |
| WM MORRISON SUPERMARKETS | 59,300 | 2.435 | 144,395.500 | |
| CARNIVAL PLC | 4,861 | 46.280 | 224,967.080 | |
| EASYJET PLC | 4,000 | 11.435 | 45,740.000 | |
| COMPASS GROUP PLC | 42,239 | 16.705 | 705,602.490 | |
| PERSIMMON PLC | 8,500 | 19.655 | 167,067.500 | |
| BT GROUP PLC | 222,400 | 2.619 | 582,576.800 | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 5,200 | 23.800 | 123,760.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BURBERRY GROUP PLC | 11,339 | 18.285 | 207,333.610 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 4,636 | 43.190 | 200,228.840 | |
| | TRAVIS PERKINS PLC | 6,900 | 10.980 | 75,762.000 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 4,400 | 48.040 | 211,376.000 | |
| | ITV PLC | 93,100 | 1.504 | 140,022.400 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 8,349 | 40.830 | 340,889.670 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 121,700 | 23.720 | 2,886,724.000 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 99,568 | 24.145 | 2,404,069.360 | |
| | MEGGITT PLC | 19,500 | 5.168 | 100,776.000 | |
| | G4S PLC | 37,800 | 1.964 | 74,258.100 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 4,950 | 21.060 | 104,247.000 | |
| | INVESTEC PLC | 18,300 | 4.893 | 89,541.900 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 9,800 | 8.364 | 81,967.200 | |
| | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 58,762 | 2.705 | 158,980.590 | |
| | EXPERIAN PLC | 24,054 | 18.970 | 456,304.380 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | | イギリス・ポンド<br>47,102,767.930<br>(6,830,372,378) | |
| イスラエル・シュケル | | 株 | イスラエル・シュケル | イスラエル・シュケル | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 1,000 | 186.700 | 186,700.000 | |
| | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 48,300 | 4.280 | 206,724.000 | |
| | ISRAEL CHEMICALS LTD | 17,600 | 21.740 | 382,624.000 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 600 | 455.000 | 273,000.000 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 26,600 | 25.500 | 678,300.000 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 41,000 | 24.420 | 1,001,220.000 | |
| | NICE LTD | 1,650 | 428.000 | 706,200.000 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 3,000 | 67.550 | 202,650.000 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | | | イスラエル・シュケル<br>3,637,418.000<br>(111,304,991) | |
| オーストラリア・ドル | | 株 | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | |
| | HEALTHSCOPE LTD | 45,500 | 2.200 | 100,100.000 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 72,800 | 2.480 | 180,544.000 | |
| | BHP BILLITON LIMITED | 84,750 | 30.980 | 2,625,555.000 | |
| | SOUTH32 LTD | 134,100 | 3.140 | 421,074.000 | |
| | ALUMINA LTD | 62,300 | 2.310 | 143,913.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 24,500 | 31.170 | 763,665.000 | |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 42,500 | 4.030 | 171,275.000 | |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 13,300 | 10.820 | 143,906.000 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 71,250 | 24.910 | 1,774,837.500 | |
| WESTPAC BANKING CORP | 90,248 | 26.420 | 2,384,352.160 | |
| SANTOS LTD | 45,200 | 5.640 | 254,928.000 | |
| AUSNET SERVICES | 50,000 | 1.585 | 79,250.000 | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP | 77,000 | 27.150 | 2,090,550.000 | |
| RIO TINTO LTD | 10,950 | 73.250 | 802,087.500 | |
| ORIGIN ENERGY LTD | 46,200 | 6.590 | 304,458.000 | |
| AMCOR LIMITED | 31,400 | 13.430 | 421,702.000 | |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 54,300 | 4.250 | 230,775.000 | |
| COLES GROUP LTD | 29,745 | 12.390 | 368,540.550 | |
| OIL SEARCH LTD | 35,300 | 7.320 | 258,396.000 | |
| SEEK LTD | 8,300 | 18.760 | 155,708.000 | |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 19,100 | 14.850 | 283,635.000 | |
| NEWCREST MINING LTD | 19,750 | 20.780 | 410,405.000 | |
| INCITEC PIVOT LTD | 42,300 | 3.810 | 161,163.000 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 46,200 | 72.430 | 3,346,266.000 | |
| CALTEX AUSTRALIA LTD | 7,150 | 27.490 | 196,553.500 | |
| ORICA LTD | 10,100 | 17.720 | 178,972.000 | |
| QBE INSURANCE GROUP LTD | 36,050 | 11.480 | 413,854.000 | |
| CIMIC GROUP LTD | 2,400 | 42.940 | 103,056.000 | |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 35,100 | 29.830 | 1,047,033.000 | |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 13,700 | 10.100 | 138,370.000 | |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 48,400 | 4.460 | 215,864.000 | |
| CROWN RESORTS LTD | 9,600 | 11.800 | 113,280.000 | |
| TELSTRA CORP LTD | 110,500 | 2.960 | 327,080.000 | |
| AMP LTD | 75,000 | 2.440 | 183,000.000 | |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 12,050 | 16.450 | 198,222.500 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 8,584 | 116.810 | 1,002,697.040 | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 15,250 | 25.440 | 387,960.000 | |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 10,800 | 10.120 | 109,296.000 | |
| CSL LTD | 12,050 | 180.800 | 2,178,640.000 | |
| WESFARMERS LTD | 29,745 | 31.510 | 937,264.950 | |
| COCHLEAR LTD | 1,500 | 172.700 | 259,050.000 | |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 14,400 | 11.160 | 160,704.000 | |
| SUNCORP GROUP LTD | 34,300 | 13.550 | 464,765.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BORAL LTD | 30,500 | 5.260 | 160,430.000 | |
| | ASX LTD | 5,000 | 61.520 | 307,600.000 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 12,250 | 18.450 | 226,012.500 | |
| | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 14,000 | 3.120 | 43,680.000 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 59,536 | 7.430 | 442,352.480 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 10,400 | 23.280 | 242,112.000 | |
| | CHALLENGER LTD | 13,900 | 9.840 | 136,776.000 | |
| | AGL ENERGY LTD | 17,400 | 18.690 | 325,206.000 | |
| | BRAMBLES LTD | 41,500 | 10.480 | 434,920.000 | |
| | FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L | 1,400 | 48.280 | 67,592.000 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 3,850 | 55.560 | 213,906.000 | |
| | TPG TELECOM LTD | 8,700 | 7.580 | 65,946.000 | |
| | REA GROUP LTD | 1,350 | 76.450 | 103,207.500 | |
| | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 1,650 | 46.490 | 76,708.500 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | | オーストラリア・ドル<br>29,339,196.680<br>(2,437,500,460) | |
| カナダ・ドル | | 株 | カナダ・ドル | カナダ・ドル | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 7,600 | 40.560 | 308,256.000 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 500 | 938.000 | 469,000.000 | |
| | PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 5,096 | 17.720 | 90,301.120 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERN | 6,387 | 78.090 | 498,760.830 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 12,000 | 20.880 | 250,560.000 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 3,850 | 103.540 | 398,629.000 | |
| | BCE INC | 4,130 | 57.120 | 235,905.600 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 5,100 | 90.640 | 462,264.000 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 42,930 | 43.550 | 1,869,601.500 | |
| | METRO INC | 6,200 | 45.800 | 283,960.000 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 9,000 | 60.460 | 544,140.000 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 31,800 | 72.800 | 2,315,040.000 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 11,850 | 112.460 | 1,332,651.000 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 48,300 | 73.480 | 3,549,084.000 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 7,600 | 30.640 | 232,864.000 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 38,350 | 97.820 | 3,751,397.000 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 6,600 | 18.300 | 120,780.000 | |
| | VERMILION ENERGY INC | 3,700 | 33.710 | 124,727.000 | |
| | TRANSCANADA CORP | 23,850 | 54.400 | 1,297,440.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| PEMBINA PIPELINE CORP | 13,229 | 44.320 | 586,309.280 | |
| BOMBARDIER INC-B | 53,000 | 2.170 | 115,010.000 | |
| BARRICK GOLD CORP | 30,400 | 17.340 | 527,136.000 | |
| CAE INC | 7,200 | 26.590 | 191,448.000 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 6,812 | 66.420 | 452,453.040 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 4,600 | 25.320 | 116,472.000 | |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 1,600 | 70.090 | 112,144.000 | |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 3,850 | 53.130 | 204,550.500 | |
| LINAMAR CORP | 1,300 | 48.000 | 62,400.000 | |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 6,400 | 10.190 | 65,216.000 | |
| HYDRO ONE LTD | 8,400 | 19.660 | 165,144.000 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 5,460 | 61.330 | 334,861.800 | |
| WSP GLOBAL INC | 2,700 | 64.490 | 174,123.000 | |
| EMERA INC | 1,300 | 44.800 | 58,240.000 | |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 3,300 | 31.350 | 103,455.000 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 9,500 | 70.340 | 668,230.000 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 5,900 | 46.400 | 273,760.000 | |
| KINROSS GOLD CORP | 34,100 | 3.620 | 123,442.000 | |
| BANK OF MONTREAL | 17,100 | 99.360 | 1,699,056.000 | |
| POWER CORP OF CANADA | 9,400 | 26.620 | 250,228.000 | |
| METHANEX CORP | 2,200 | 74.110 | 163,042.000 | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 2,300 | 197.860 | 455,078.000 | |
| NUTRIEN LTD | 16,519 | 68.160 | 1,125,935.040 | |
| AURORA CANNABIS INC | 17,500 | 7.510 | 131,425.000 | |
| CANOPY GROWTH CORP | 5,500 | 44.200 | 243,100.000 | |
| CAMECO CORP | 10,600 | 15.850 | 168,010.000 | |
| TELUS CORP | 5,400 | 47.560 | 256,824.000 | |
| POWER FINANCIAL CORP | 6,200 | 28.120 | 174,344.000 | |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B | 14,000 | 26.630 | 372,820.000 | |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 1,600 | 151.440 | 242,304.000 | |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 24,800 | 2.420 | 60,016.000 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 32,800 | 33.450 | 1,097,160.000 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 700 | 614.180 | 429,926.000 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 8,700 | 65.760 | 572,112.000 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 2,037 | 97.250 | 198,098.250 | |
| BLACKBERRY LTD | 13,500 | 11.700 | 157,950.000 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 15,850 | 48.580 | 769,993.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ENBRIDGE INC | 48,800 | 43.950 | 2,144,760.000 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 22,050 | 58.810 | 1,296,760.500 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 52,900 | 21.770 | 1,151,633.000 | |
| | BAUSCH HEALTH COS INC | 8,700 | 31.560 | 274,572.000 | |
| | GOLDCORP INC | 23,359 | 12.510 | 292,221.090 | |
| | ENCANA CORP | 25,800 | 9.250 | 238,650.000 | |
| | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 3,800 | 279.440 | 1,061,872.000 | |
| | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 2,900 | 48.290 | 140,041.000 | |
| | GILDAN ACTIVEWEAR INC | 5,600 | 42.900 | 240,240.000 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 19,250 | 112.870 | 2,172,747.500 | |
| | CGI GROUP INC - CLASS A | 6,900 | 84.320 | 581,808.000 | |
| | HUSKY ENERGY INC | 9,358 | 16.010 | 149,821.580 | |
| | ONEX CORPORATION | 2,200 | 81.930 | 180,246.000 | |
| | SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 11,600 | 24.960 | 289,536.000 | |
| | FINNING INTERNATIONAL INC | 4,400 | 27.080 | 119,152.000 | |
| | SNC-LAVALIN GROUP INC | 4,500 | 48.850 | 219,825.000 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 1,900 | 33.920 | 64,448.000 | |
| | OPEN TEXT CORP | 7,000 | 45.150 | 316,050.000 | |
| | CI FINANCIAL CORP | 7,000 | 19.900 | 139,300.000 | |
| | SAPUTO INC | 6,300 | 40.850 | 257,355.000 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 17,700 | 12.140 | 214,878.000 | |
| | ALIMENTATION COUCHE-TARD -B | 11,600 | 69.840 | 810,144.000 | |
| | FORTIS INC | 11,000 | 46.050 | 506,550.000 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 16,100 | 5.700 | 91,770.000 | |
| | CRESCENT POINT ENERGY CORP | 13,300 | 4.030 | 53,599.000 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 27,200 | 9.750 | 265,200.000 | |
| | DOLLARAMA INC | 8,300 | 35.840 | 297,472.000 | |
| | ATCO LTD -CLASS I | 1,700 | 40.380 | 68,646.000 | |
| | ALTAGAS LTD | 6,900 | 14.000 | 96,600.000 | |
| | FIRST CAPITAL REALTY INC | 4,800 | 19.940 | 95,712.000 | |
| | KEYERA CORP | 5,300 | 28.650 | 151,845.000 | |
| | INTER PIPELINE LTD | 10,400 | 21.590 | 224,536.000 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 9,700 | 9.150 | 88,755.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | | カナダ・ドル<br>45,333,922.630<br>(3,872,423,671) | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| シンガポール・ドル | | 株 | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 35,900 | 25.110 | 901,449.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 47,300 | 24.180 | 1,143,714.000 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 13,670 | 9.650 | 131,915.500 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 39,500 | 6.150 | 242,925.000 | |
| | UOL GROUP LTD | 14,000 | 6.230 | 87,220.000 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 10,400 | 8.700 | 90,480.000 | |
| | CAPITALAND LTD | 68,900 | 3.160 | 217,724.000 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 56,800 | 1.260 | 71,568.000 | |
| | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 41,000 | 2.660 | 109,060.000 | |
| | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 2,700 | 35.290 | 95,283.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 82,800 | 11.240 | 930,672.000 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 153,000 | 0.970 | 148,410.000 | |
| | VENTURE CORP LTD | 7,200 | 15.320 | 110,304.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 220,950 | 3.080 | 680,526.000 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 39,500 | 3.460 | 136,670.000 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 22,700 | 2.650 | 60,155.000 | |
| | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 164,400 | 0.230 | 37,812.000 | |
| | SATS LTD | 16,000 | 4.680 | 74,880.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 20,800 | 7.280 | 151,424.000 | |
| | COMFORTDELGRO CORP LTD | 55,300 | 2.090 | 115,577.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 49,200 | 3.090 | 152,028.000 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | | シンガポール・ドル<br>5,689,796.500<br>(471,627,232) | |
| スイス・フラン | | 株 | スイス・フラン | スイス・フラン | |
| | DUFRY AG-REG | 850 | 108.700 | 92,395.000 | |
| | UBS GROUP AG-REG | 102,250 | 13.645 | 1,395,201.250 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 200 | 542.000 | 108,400.000 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 4,250 | 49.520 | 210,460.000 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 18,520 | 254.200 | 4,707,784.000 | |
| | PARGESA HOLDING SA-BR | 950 | 70.050 | 66,547.500 | |
| | SIKA AG-REG | 3,360 | 124.200 | 417,312.000 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 3 | 80,300.000 | 240,900.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ABB LTD-REG | 48,700 | 20.310 | 989,097.000 | |
| | SWISS RE AG | 8,400 | 91.480 | 768,432.000 | |
| | NESTLE SA-REG | 82,000 | 85.200 | 6,986,400.000 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 450 | 668.500 | 300,825.000 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 1,050 | 205.600 | 215,880.000 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 67,120 | 11.925 | 800,406.000 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 5,900 | 41.020 | 242,018.000 | |
| | SGS SA-REG | 140 | 2,379.000 | 333,060.000 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 500 | 199.300 | 99,650.000 | |
| | VIFOR PHARMA AG | 1,200 | 126.600 | 151,920.000 | |
| | TEMENOS AG - REG | 1,550 | 126.400 | 195,920.000 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-BR | 850 | 300.900 | 255,765.000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4,022 | 313.600 | 1,261,299.200 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 1,300 | 148.900 | 193,570.000 | |
| | CLARIANT AG-REG | 5,700 | 20.400 | 116,280.000 | |
| | NOVARTIS AG-REG | 57,400 | 90.360 | 5,186,664.000 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 60 | 1,723.000 | 103,380.000 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 13,960 | 65.680 | 916,892.800 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 710 | 475.500 | 337,605.000 | |
| | GEBERIT AG-REG | 990 | 391.900 | 387,981.000 | |
| | GIVAUDAN-REG | 250 | 2,478.000 | 619,500.000 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 270 | 609.500 | 164,565.000 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 1,420 | 161.500 | 229,330.000 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 2,010 | 319.100 | 641,391.000 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 1,520 | 59.250 | 90,060.000 | |
| | LAFARGEHOLCIM LTD-REG | 12,790 | 45.450 | 581,305.500 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 900 | 391.900 | 352,710.000 | |
| | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 1,490 | 142.100 | 211,729.000 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 2,030 | 82.150 | 166,764.500 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 29 | 6,850.000 | 198,650.000 | |
| スイス・フラン　小計 | | | | スイス・フラン<br>30,338,049.750<br>(3,455,503,867) | |
| スウェーデン・クローナ | | 株 | スウェーデン・クローナ | スウェーデン・クローナ | |
| | ICA GRUPPEN AB | 1,900 | 331.700 | 630,230.000 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 81,130 | 75.880 | 6,156,144.400 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 42,100 | 127.000 | 5,346,700.000 | |
| | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 1,800 | 530.500 | 954,900.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SKF AB-B SHARES | 9,750 | 142.400 | 1,388,400.000 | |
| | ELECTROLUX AB-SER B | 5,950 | 206.100 | 1,226,295.000 | |
| | SWEDISH MATCH AB | 4,600 | 357.700 | 1,645,420.000 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 13,700 | 114.250 | 1,565,225.000 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 43,050 | 95.040 | 4,091,472.000 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 41,050 | 100.500 | 4,125,525.000 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 23,500 | 210.700 | 4,951,450.000 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 23,550 | 169.560 | 3,993,138.000 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 9,150 | 144.550 | 1,322,632.500 | |
| | SANDVIK AB | 29,850 | 134.700 | 4,020,795.000 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 12,300 | 393.600 | 4,841,280.000 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 17,350 | 219.100 | 3,801,385.000 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 8,450 | 152.200 | 1,286,090.000 | |
| | TELIA CO AB | 77,000 | 42.050 | 3,237,850.000 | |
| | ALFA LAVAL AB | 7,700 | 193.900 | 1,493,030.000 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 10,300 | 202.600 | 2,086,780.000 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 26,850 | 168.650 | 4,528,252.500 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 1,800 | 273.600 | 492,480.000 | |
| | LUNDIN PETROLEUM AB | 4,650 | 239.000 | 1,111,350.000 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 15,700 | 233.000 | 3,658,100.000 | |
| | BOLIDEN AB | 7,000 | 202.500 | 1,417,500.000 | |
| | EPIROC AB-A | 17,950 | 75.290 | 1,351,455.500 | |
| | EPIROC AB-B | 9,700 | 72.480 | 703,056.000 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 11,450 | 72.300 | 827,835.000 | |
| | NORDEA BANK ABP | 79,400 | 81.680 | 6,485,392.000 | |
| | KINNEVIK AB - B | 6,050 | 237.300 | 1,435,665.000 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 6,900 | 459.400 | 3,169,860.000 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 4,600 | 185.200 | 851,920.000 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | | | スウェーデン・クローナ<br>84,197,607.900<br>(1,053,312,075) | |
| デンマーク・クローネ | | 株 | デンマーク・クローネ | デンマーク・クローネ | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 48,200 | 299.100 | 14,416,620.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 18,800 | 131.700 | 2,475,960.000 | |
| | ISS A/S | 4,400 | 216.700 | 953,480.000 | |
| | AP MOELLER-MAERSK A/S-A | 95 | 9,025.000 | 857,375.000 | |
| | H LUNDBECK A/S | 1,700 | 265.500 | 451,350.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 5,250 | 485.300 | 2,547,825.000 | |
| | CARLSBERG AS-B | 2,750 | 717.400 | 1,972,850.000 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 5,800 | 311.400 | 1,806,120.000 | |
| | COLOPLAST-B | 3,100 | 643.600 | 1,995,160.000 | |
| | DSV A/S | 5,010 | 515.400 | 2,582,154.000 | |
| | WILLIAM DEMANT HOLDING | 2,675 | 197.700 | 528,847.500 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 170 | 9,700.000 | 1,649,000.000 | |
| | TRYG A/S | 3,300 | 162.300 | 535,590.000 | |
| | PANDORA A/S | 2,750 | 358.300 | 985,325.000 | |
| | CHR HANSEN HOLDING A/S | 2,550 | 597.400 | 1,523,370.000 | |
| | GENMAB A/S | 1,700 | 1,005.000 | 1,708,500.000 | |
| | ORSTED A/S | 5,050 | 433.800 | 2,190,690.000 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | | | デンマーク・クローネ<br>39,180,216.500<br>(678,209,548) | |
| ニュージーランド・ドル | | 株 | ニュージーランド・ドル | ニュージーランド・ドル | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 34,500 | 3.250 | 112,125.000 | |
| | A2 MILK CO LTD | 19,000 | 10.900 | 207,100.000 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 52,689 | 4.170 | 219,713.130 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 23,400 | 7.050 | 164,970.000 | |
| | FLETCHER BUILDING LTD | 20,100 | 4.790 | 96,279.000 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 15,100 | 13.230 | 199,773.000 | |
| | RYMAN HEALTHCARE LTD | 8,800 | 11.550 | 101,640.000 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | | | ニュージーランド・ドル<br>1,101,600.130<br>(85,781,602) | |
| ノルウェー・クローネ | | 株 | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |
| | NORSK HYDRO ASA | 35,200 | 40.950 | 1,441,440.000 | |
| | DNB ASA | 26,150 | 148.850 | 3,892,427.500 | |
| | ORKLA ASA | 20,850 | 71.060 | 1,481,601.000 | |
| | TELENOR ASA | 19,900 | 165.700 | 3,297,430.000 | |
| | EQUINOR ASA | 31,223 | 199.800 | 6,238,355.400 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 4,560 | 348.000 | 1,586,880.000 | |
| | MARINE HARVEST | 11,050 | 199.000 | 2,198,950.000 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 4,850 | 137.100 | 664,935.000 | |
| | SCHIBSTED ASA-B SHS | 2,400 | 283.000 | 679,200.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | AKER BP ASA | 2,900 | 246.200 | 713,980.000 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | | | ノルウェー・クローネ<br>22,195,198.900<br>(294,752,241) | |
| ユーロ | | 株 | ユーロ | ユーロ | |
| | BAYER AG-REG | 24,670 | 63.770 | 1,573,205.900 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 4,250 | 24.120 | 102,510.000 | |
| | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 53,150 | 8.300 | 441,145.000 | |
| | COMMERZBANK AG | 26,335 | 7.893 | 207,862.150 | |
| | VOLKSWAGEN AG | 890 | 145.700 | 129,673.000 | |
| | VOLKSWAGEN AG-PREF | 4,970 | 150.060 | 745,798.200 | |
| | SIEMENS AG-REG | 20,200 | 102.300 | 2,066,460.000 | |
| | E.ON SE | 59,100 | 8.979 | 530,658.900 | |
| | UNIPER SE | 5,350 | 23.110 | 123,638.500 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 8,650 | 72.850 | 630,152.500 | |
| | GEA GROUP AG | 4,500 | 24.060 | 108,270.000 | |
| | OSRAM LICHT AG | 2,560 | 41.260 | 105,625.600 | |
| | CONTINENTAL AG | 2,970 | 132.850 | 394,564.500 | |
| | BASF SE | 24,420 | 64.860 | 1,583,881.200 | |
| | K+S AG-REG | 4,800 | 15.890 | 76,272.000 | |
| | ALLIANZ SE-REG | 11,630 | 189.160 | 2,199,930.800 | |
| | THYSSENKRUPP AG | 11,450 | 16.730 | 191,558.500 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 4,650 | 102.350 | 475,927.500 | |
| | RWE AG | 14,150 | 19.050 | 269,557.500 | |
| | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 6,100 | 21.520 | 131,272.000 | |
| | FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT | 1,000 | 67.280 | 67,280.000 | |
| | BRENNTAG AG | 3,950 | 41.000 | 161,950.000 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 11,250 | 51.360 | 577,800.000 | |
| | UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 3,320 | 40.350 | 133,962.000 | |
| | HOCHTIEF AG | 530 | 126.100 | 66,833.000 | |
| | SAP SE | 26,142 | 91.100 | 2,381,536.200 | |
| | MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 3,980 | 192.100 | 764,558.000 | |
| | SCHAEFFLER AG | 3,800 | 7.558 | 28,720.400 | |
| | ZALANDO SE | 2,900 | 28.680 | 83,172.000 | |
| | HEIDELBERGCEMENT AG | 3,900 | 59.460 | 231,894.000 | |
| | KION GROUP AG | 1,850 | 51.080 | 94,498.000 | |
| | WIRECARD AG | 3,070 | 136.300 | 418,441.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| COVESTRO AG | 5,200 | 51.340 | 266,968.000 | |
| INNOGY SE | 3,730 | 40.000 | 149,200.000 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 950 | 115.800 | 110,010.000 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 4,000 | 56.680 | 226,720.000 | |
| DELIVERY HERO SE | 2,500 | 33.360 | 83,400.000 | |
| METRO AG | 5,000 | 13.740 | 68,700.000 | |
| 1&1 DRILLISCH AG | 1,300 | 45.020 | 58,526.000 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 4,000 | 38.800 | 155,200.000 | |
| BEIERSDORF AG | 2,690 | 94.000 | 252,860.000 | |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF | 1,700 | 37.280 | 63,376.000 | |
| MERCK KGAA | 3,450 | 97.240 | 335,478.000 | |
| ADIDAS AG | 4,930 | 197.500 | 973,675.000 | |
| PUMA SE | 206 | 448.500 | 92,391.000 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 2,850 | 91.300 | 260,205.000 | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 87,800 | 15.385 | 1,350,803.000 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 5,870 | 72.420 | 425,105.400 | |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 23,850 | 50.670 | 1,208,479.500 | |
| QIAGEN N.V. | 5,998 | 31.180 | 187,017.640 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 30,050 | 18.340 | 551,117.000 | |
| HANNOVER RUECK SE | 1,610 | 122.900 | 197,869.000 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 26,350 | 28.560 | 752,556.000 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 5,100 | 111.200 | 567,120.000 | |
| PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | 5,950 | 18.170 | 108,111.500 | |
| LANXESS AG | 2,200 | 49.220 | 108,284.000 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 1,430 | 175.900 | 251,537.000 | |
| AXEL SPRINGER SE | 1,200 | 56.250 | 67,500.000 | |
| DEUTSCHE WOHNEN SE | 9,400 | 42.440 | 398,936.000 | |
| SYMRISE AG | 3,200 | 70.960 | 227,072.000 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 18,800 | 3.576 | 67,228.800 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 1,350 | 64.200 | 86,670.000 | |
| HUGO BOSS AG -ORD | 1,590 | 62.320 | 99,088.800 | |
| RTL GROUP | 1,000 | 53.700 | 53,700.000 | |
| VONOVIA SE | 13,200 | 43.240 | 570,768.000 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 24,526 | 32.900 | 806,905.400 | |
| NN GROUP NV | 8,050 | 37.940 | 305,417.000 | |
| ARCELORMITTAL | 17,700 | 20.055 | 354,973.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| UNILEVER NV-CVA | 41,100 | 48.965 | 2,012,461.500 | |
| HEINEKEN NV | 6,700 | 79.720 | 534,124.000 | |
| AEGON NV | 44,744 | 4.970 | 222,377.680 | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 33,483 | 22.505 | 753,534.910 | |
| AKZO NOBEL | 6,600 | 73.820 | 487,212.000 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 4,750 | 78.000 | 370,500.000 | |
| WOLTERS KLUWER | 7,800 | 53.700 | 418,860.000 | |
| ING GROEP NV | 103,450 | 10.804 | 1,117,673.800 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 84,250 | 2.537 | 213,742.250 | |
| ASML HOLDING NV | 10,900 | 151.240 | 1,648,516.000 | |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA | 11,050 | 22.820 | 252,161.000 | |
| VOPAK | 1,900 | 38.810 | 73,739.000 | |
| RANDSTAD NV | 3,200 | 42.450 | 135,840.000 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 3,150 | 76.700 | 241,605.000 | |
| JCDECAUX SA | 1,900 | 29.940 | 56,886.000 | |
| TOTAL SA | 63,650 | 48.440 | 3,083,206.000 | |
| MICHELIN (CGDE) | 4,500 | 91.940 | 413,730.000 | |
| AIR LIQUIDE SA | 11,292 | 104.150 | 1,176,061.800 | |
| KERING | 1,980 | 388.700 | 769,626.000 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 14,500 | 64.340 | 932,930.000 | |
| BOUYGUES SA | 5,600 | 34.740 | 194,544.000 | |
| BNP PARIBAS | 29,900 | 44.775 | 1,338,772.500 | |
| PEUGEOT SA | 15,450 | 19.470 | 300,811.500 | |
| NATIXIS | 25,350 | 4.945 | 125,355.750 | |
| THALES SA | 2,850 | 107.250 | 305,662.500 | |
| DANONE | 16,200 | 65.540 | 1,061,748.000 | |
| CARREFOUR SA | 15,800 | 16.415 | 259,357.000 | |
| SUEZ | 9,925 | 13.140 | 130,414.500 | |
| VIVENDI | 27,991 | 22.290 | 623,919.390 | |
| L'OREAL | 6,730 | 208.400 | 1,402,532.000 | |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 13,050 | 32.880 | 429,084.000 | |
| LEGRAND SA | 7,217 | 54.040 | 390,006.680 | |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 1,550 | 40.500 | 62,775.000 | |
| PERNOD RICARD SA | 5,617 | 140.350 | 788,345.950 | |
| SOCIETE BIC SA | 700 | 94.500 | 66,150.000 | |
| EURAZEO SE | 1,195 | 67.150 | 80,244.250 | |
| REXEL SA | 7,850 | 10.605 | 83,249.250 | |
| SOCIETE GENERALE SA | 20,050 | 32.830 | 658,241.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 7,350 | 256.500 | 1,885,275.000 | |
| ACCOR SA | 4,950 | 39.870 | 197,356.500 | |
| CAPGEMINI SE | 4,220 | 102.850 | 434,027.000 | |
| VALEO SA | 6,400 | 25.540 | 163,456.000 | |
| PUBLICIS GROUPE | 5,600 | 52.700 | 295,120.000 | |
| BUREAU VERITAS SA | 7,100 | 19.455 | 138,130.500 | |
| EIFFAGE | 2,140 | 85.240 | 182,413.600 | |
| SODEXO SA | 2,500 | 91.220 | 228,050.000 | |
| IPSEN | 1,000 | 114.000 | 114,000.000 | |
| INGENICO GROUP | 1,600 | 64.460 | 103,136.000 | |
| AMUNDI SA | 1,500 | 50.940 | 76,410.000 | |
| TELEPERFORMANCE | 1,500 | 144.800 | 217,200.000 | |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 2,000 | 70.640 | 141,280.000 | |
| FAURECIA | 1,900 | 36.720 | 69,768.000 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 290 | 395.800 | 114,782.000 | |
| SEB SA | 560 | 129.200 | 72,352.000 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 5,430 | 111.650 | 606,259.500 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 70 | 1,350.000 | 94,500.000 | |
| AXA SA | 51,800 | 21.535 | 1,115,513.000 | |
| EDENRED | 6,400 | 33.430 | 213,952.000 | |
| RENAULT SA | 5,000 | 62.400 | 312,000.000 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 860 | 485.100 | 417,186.000 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 18,550 | 12.970 | 240,593.500 | |
| REMY COINTREAU | 550 | 102.000 | 56,100.000 | |
| ATOS SE | 2,500 | 75.120 | 187,800.000 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 3,380 | 107.400 | 363,012.000 | |
| WENDEL | 680 | 108.000 | 73,440.000 | |
| ORANGE | 53,650 | 15.020 | 805,823.000 | |
| ALSTOM | 4,050 | 39.070 | 158,233.500 | |
| CNP ASSURANCES | 4,300 | 20.220 | 86,946.000 | |
| SANOFI | 29,675 | 78.870 | 2,340,467.250 | |
| VINCI SA | 13,450 | 77.580 | 1,043,451.000 | |
| AIRBUS SE | 15,450 | 94.860 | 1,465,587.000 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 14,450 | 18.740 | 270,793.000 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 30,100 | 11.052 | 332,665.200 | |
| BIOMERIEUX | 1,150 | 65.000 | 74,750.000 | |
| ENGIE | 47,873 | 12.490 | 597,933.770 | |
| IMERYS SA | 900 | 48.660 | 43,794.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EDF | 15,950 | 14.710 | 234,624.500 | |
| SES | 9,700 | 18.320 | 177,704.000 | |
| SAFRAN SA | 8,800 | 111.500 | 981,200.000 | |
| ILIAD SA | 650 | 124.600 | 80,990.000 | |
| ARKEMA | 1,770 | 84.640 | 149,812.800 | |
| ADP | 810 | 173.200 | 140,292.000 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 4,700 | 18.130 | 85,211.000 | |
| SCOR SE | 4,150 | 42.500 | 176,375.000 | |
| GETLINK | 12,400 | 11.480 | 142,352.000 | |
| BOLLORE | 24,100 | 3.966 | 95,580.600 | |
| UCB SA | 3,250 | 73.340 | 238,355.000 | |
| KBC GROUP NV | 6,500 | 63.740 | 414,310.000 | |
| COLRUYT SA | 1,600 | 56.620 | 90,592.000 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 2,000 | 80.060 | 160,120.000 | |
| SOLVAY SA | 1,950 | 96.440 | 188,058.000 | |
| UMICORE | 5,400 | 37.960 | 204,984.000 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 20,350 | 67.380 | 1,371,183.000 | |
| AGEAS | 4,940 | 43.040 | 212,617.600 | |
| PROXIMUS | 4,100 | 24.120 | 98,892.000 | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 1,450 | 43.120 | 62,524.000 | |
| PRYSMIAN SPA | 6,150 | 15.990 | 98,338.500 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 31,343 | 14.755 | 462,465.960 | |
| MEDIOBANCA SPA | 15,265 | 7.808 | 119,189.120 | |
| TENARIS SA | 12,000 | 10.830 | 129,960.000 | |
| UNICREDIT SPA | 53,156 | 11.516 | 612,144.490 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 282,782 | 0.564 | 159,658.710 | |
| TELECOM ITALIA-RSP | 146,950 | 0.484 | 71,197.270 | |
| INTESA SANPAOLO | 396,237 | 2.032 | 805,351.700 | |
| ATLANTIA SPA | 13,457 | 18.345 | 246,868.660 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 13,500 | 6.706 | 90,531.000 | |
| MONCLER SPA | 4,700 | 29.510 | 138,697.000 | |
| RECORDATI SPA | 2,600 | 27.920 | 72,592.000 | |
| ENI SPA | 68,200 | 14.216 | 969,531.200 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA | 14,300 | 7.315 | 104,604.500 | |
| PIRELLI & C SPA | 11,000 | 6.244 | 68,684.000 | |
| LEONARDO SPA | 10,975 | 8.658 | 95,021.550 | |
| ENEL SPA | 215,434 | 4.758 | 1,025,034.970 | |
| SNAM SPA | 61,600 | 3.833 | 236,112.800 | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 4,500 | 51.700 | 232,650.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TERNA SPA | 38,900 | 4.884 | 189,987.600 | |
| EXOR NV | 2,880 | 51.860 | 149,356.800 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 27,200 | 8.452 | 229,894.400 | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 28,550 | 14.730 | 420,541.500 | |
| FERRARI NV | 3,145 | 96.060 | 302,108.700 | |
| TELEFONICA SA | 125,027 | 7.804 | 975,710.700 | |
| ENDESA SA | 8,250 | 19.645 | 162,071.250 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 174,812 | 4.990 | 872,311.880 | |
| IBERDROLA SA | 162,134 | 6.602 | 1,070,408.660 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 144,909 | 1.124 | 162,877.710 | |
| BANKINTER SA | 18,300 | 7.414 | 135,676.200 | |
| REPSOL SA | 36,650 | 15.140 | 554,881.000 | |
| GRIFOLS SA | 7,750 | 26.200 | 203,050.000 | |
| BANCO SANTANDER SA | 426,450 | 4.213 | 1,796,847.070 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 11,700 | 64.020 | 749,034.000 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 9,050 | 21.690 | 196,294.500 | |
| MAPFRE SA | 25,450 | 2.524 | 64,235.800 | |
| CAIXABANK SA | 94,100 | 3.620 | 340,642.000 | |
| INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 15,200 | 7.046 | 107,099.200 | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 6,726 | 33.850 | 227,675.100 | |
| AENA SME SA | 1,850 | 142.050 | 262,792.500 | |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 28,500 | 27.310 | 778,335.000 | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE | 5,600 | 12.650 | 70,840.000 | |
| ENAGAS SA | 5,900 | 24.070 | 142,013.000 | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 11,500 | 18.955 | 217,982.500 | |
| FERROVIAL SA | 13,400 | 18.090 | 242,406.000 | |
| BANKIA SA | 30,105 | 2.909 | 87,575.440 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 13,700 | 23.890 | 327,293.000 | |
| NOKIA OYJ | 146,750 | 4.838 | 709,976.500 | |
| WARTSILA OYJ ABP | 12,000 | 14.705 | 176,460.000 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 13,800 | 11.165 | 154,077.000 | |
| METSO OYJ | 2,800 | 25.330 | 70,924.000 | |
| ELISA OYJ | 3,650 | 34.650 | 126,472.500 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 11,650 | 39.660 | 462,039.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | FORTUM OYJ | 12,250 | 18.295 | 224,113.750 | |
| | KONE OYJ-B | 8,800 | 44.370 | 390,456.000 | |
| | NOKIAN RENKAAT OYJ | 3,050 | 28.430 | 86,711.500 | |
| | NESTE OYJ | 3,450 | 69.620 | 240,189.000 | |
| | ORION OYJ-CLASS B | 2,750 | 29.540 | 81,235.000 | |
| | OMV AG | 3,550 | 45.130 | 160,211.500 | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 7,400 | 34.900 | 258,260.000 | |
| | VOESTALPINE AG | 2,850 | 29.200 | 83,220.000 | |
| | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA | 3,400 | 26.290 | 89,386.000 | |
| | ANDRITZ AG | 2,100 | 42.340 | 88,914.000 | |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 6,000 | 23.820 | 142,920.000 | |
| | AIB GROUP PLC | 23,000 | 3.826 | 87,998.000 | |
| | BANK OF IRELAND GROUP PLC | 27,460 | 5.820 | 159,817.200 | |
| | JERONIMO MARTINS | 6,000 | 10.590 | 63,540.000 | |
| | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 66,000 | 3.070 | 202,620.000 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 11,650 | 14.440 | 168,226.000 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 4,220 | 91.050 | 384,231.000 | |
| | CRH PLC | 22,700 | 24.750 | 561,825.000 | |
| | PADDY POWER BETFAIR PLC | 2,200 | 79.750 | 175,450.000 | |
| ユーロ　小計 | | | | ユーロ<br>94,924,759.309<br>(12,263,329,655) | |
| 香港・ドル | | 株 | 香港・ドル | 香港・ドル | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 37,500 | 53.450 | 2,004,375.000 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 65,000 | 48.500 | 3,152,500.000 | |
| | MTR CORP | 40,000 | 40.150 | 1,606,000.000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 42,000 | 113.300 | 4,758,600.000 | |
| | SINO LAND CO | 90,000 | 13.500 | 1,215,000.000 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 70,669 | 81.500 | 5,759,523.500 | |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 32,000 | 21.300 | 681,600.000 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 12,500 | 86.350 | 1,079,375.000 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 43,500 | 87.850 | 3,821,475.000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 35,916 | 40.100 | 1,440,231.600 | |
| | HANG LUNG GROUP LTD | 21,000 | 21.350 | 448,350.000 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 248,181 | 15.600 | 3,871,623.600 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 20,400 | 180.100 | 3,674,040.000 | |
| | WHEELOCK & CO LTD | 22,000 | 45.100 | 992,200.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NEW WORLD DEVELOPMENT | 159,000 | 10.740 | 1,707,660.000 | |
| | WH GROUP LTD | 222,500 | 5.820 | 1,294,950.000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 31,300 | 228.200 | 7,142,660.000 | |
| | MINTH GROUP LTD | 18,000 | 27.250 | 490,500.000 | |
| | LI & FUNG LTD | 152,000 | 1.640 | 249,280.000 | |
| | HANG LUNG PROPERTIES LTD | 50,000 | 15.580 | 779,000.000 | |
| | ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 7,600 | 80.000 | 608,000.000 | |
| | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 19,000 | 23.800 | 452,200.000 | |
| | NWS HOLDINGS LTD | 42,500 | 16.900 | 718,250.000 | |
| | KERRY PROPERTIES LTD | 17,500 | 27.050 | 473,375.000 | |
| | BANK OF EAST ASIA LTD | 32,640 | 26.350 | 860,064.000 | |
| | HYSAN DEVELOPMENT CO | 17,000 | 39.800 | 676,600.000 | |
| | SJM HOLDINGS LTD | 47,000 | 7.040 | 330,880.000 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 28,800 | 27.600 | 794,880.000 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 69,669 | 56.000 | 3,901,464.000 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 18,000 | 59.000 | 1,062,000.000 | |
| | PCCW LTD | 117,000 | 4.530 | 530,010.000 | |
| | AIA GROUP LTD | 321,200 | 64.400 | 20,685,280.000 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 33,000 | 47.950 | 1,582,350.000 | |
| | SANDS CHINA LTD | 64,400 | 34.050 | 2,192,820.000 | |
| | SHANGRI-LA ASIA LTD | 30,000 | 11.160 | 334,800.000 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 35,500 | 42.600 | 1,512,300.000 | |
| | MGM CHINA HOLDINGS LTD | 23,600 | 13.220 | 311,992.000 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 96,000 | 30.300 | 2,908,800.000 | |
| | WYNN MACAU LTD | 42,000 | 17.820 | 748,440.000 | |
| 香港・ドル　小計 | | | | 香港・ドル<br>86,853,448.700<br>(1,260,243,541) | |
| 合計 | | | | 102,418,129,349<br>[102,418,129,349] | |

(2)　株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 3,617 | 680,249.190 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 8,137 | 1,502,090.200 | |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 4,000 | 519,280.000 | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 4,347 | 306,811.260 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 3,050 | 514,077.500 | |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 9,800 | 688,646.000 | |
| | EQUINIX INC | 2,088 | 802,021.680 | |
| | AMERICAN TOWER CORP | 11,450 | 1,863,144.000 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 20,043 | 386,829.900 | |
| | KIMCO REALTY CORP | 11,100 | 176,823.000 | |
| | INVITATION HOMES INC | 8,300 | 177,537.000 | |
| | BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 6,279 | 109,819.710 | |
| | VENTAS INC | 9,150 | 571,417.500 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 20,064 | 536,511.360 | |
| | AGNC INVESTMENT CORP | 12,300 | 218,079.000 | |
| | CROWN CASTLE INTL CORP | 10,900 | 1,231,700.000 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 6,760 | 228,150.000 | |
| | VEREIT INC | 24,400 | 186,172.000 | |
| | PROLOGIS INC | 16,412 | 1,102,558.160 | |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 2,720 | 332,873.600 | |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 2,350 | 220,242.000 | |
| | DUKE REALTY CORP | 9,400 | 263,858.000 | |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1,700 | 440,878.000 | |
| | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 1,850 | 242,146.500 | |
| | WELLTOWER INC | 9,700 | 692,871.000 | |
| | HCP INC | 12,400 | 357,120.000 | |
| | LIBERTY PROPERTY TRUST | 3,950 | 175,419.500 | |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 3,000 | 306,660.000 | |
| | MACERICH CO/THE | 2,900 | 145,174.000 | |
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 33,600 | 338,016.000 | |
| | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 4,150 | 205,300.500 | |
| | REALTY INCOME CORP | 7,550 | 482,143.000 | |
| | PUBLIC STORAGE | 4,150 | 879,219.000 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 4,050 | 254,421.000 | |
| | SL GREEN REALTY CORP | 2,400 | 225,168.000 | |
| | UDR INC | 6,800 | 284,852.000 | |
| | WP CAREY INC | 4,300 | 291,497.000 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 5,500 | 625,295.000 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 3,250 | 306,767.500 | |
| アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | | 18,871,839.060<br>(2,141,387,578) | |
| イギリス・ポンド | | | イギリス・ポンド | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 19,662 | 163,666.480 | |
| | SEGRO PLC | 25,750 | 158,362.500 | |
| | HAMMERSON PLC | 19,200 | 74,707.200 | |
| | BRITISH LAND CO PLC | 23,400 | 133,380.000 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | イギリス・ポンド<br>530,116.180<br>(76,872,147) | |
| オーストラリア・ドル | | | オーストラリア・ドル | |
| | LENDLEASE GROUP | 14,900 | 195,786.000 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 68,100 | 782,469.000 | |
| | SYDNEY AIRPORT | 30,300 | 207,555.000 | |
| | APA GROUP | 31,200 | 286,104.000 | |
| | SCENTRE GROUP | 143,322 | 574,721.220 | |
| | DEXUS | 25,850 | 279,955.500 | |
| | GPT GROUP | 47,560 | 255,872.800 | |
| | MIRVAC GROUP | 98,800 | 223,288.000 | |
| | STOCKLAND | 66,000 | 248,160.000 | |
| | GOODMAN GROUP | 43,900 | 468,852.000 | |
| | VICINITY CENTRES | 89,273 | 243,715.290 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | オーストラリア・ドル<br>3,766,478.810<br>(312,919,060) | |
| カナダ・ドル | | | カナダ・ドル | |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 1,500 | 46,950.000 | |
| | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3,700 | 78,514.000 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 3,900 | 96,096.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | カナダ・ドル<br>221,560.000<br>(18,925,655) | |
| シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 70,100 | 123,376.000 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 69,500 | 180,005.000 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 63,200 | 142,832.000 | |
| | SUNTEC REIT | 63,000 | 113,400.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | シンガポール・ドル　小計 | | | シンガポール・ドル<br>559,613.000<br>(46,386,322) | |
| | ユーロ | | | ユーロ | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 3,610 | 558,322.600 | |
| | | ICADE | 800 | 57,000.000 | |
| | | GECINA SA | 1,250 | 156,750.000 | |
| | | KLEPIERRE | 5,650 | 165,093.000 | |
| | | COVIVIO | 970 | 84,729.500 | |
| | ユーロ　小計 | | | ユーロ<br>1,021,895.100<br>(132,018,628) | |
| | 香港・ドル | | | 香港・ドル | |
| | | LINK REIT | 57,000 | 4,300,650.000 | |
| | | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 64,500 | 489,555.000 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 99,000 | 1,110,780.000 | |
| | 香港・ドル　小計 | | | 香港・ドル<br>5,900,985.000<br>(85,623,292) | |
| 投資証券　合計 | | | | 2,814,132,682<br>[2,814,132,682] | |
| 合計 | | | | 2,814,132,682<br>[2,814,132,682] | |

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　592銘柄<br>投資証券　39銘柄 | 97.0% | 3.0% | 68.1% |
| イギリス・ポンド | 株式　96銘柄<br>投資証券　4銘柄 | 98.9% | 1.1% | 6.6% |
| イスラエル・シュケル | 株式　8銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| オーストラリア・ドル | 株式　57銘柄<br>投資証券　11銘柄 | 88.6% | 11.4% | 2.6% |
| カナダ・ドル | 株式　89銘柄<br>投資証券　3銘柄 | 99.5% | 0.5% | 3.7% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シンガポール・ドル | 株式 21銘柄<br>投資証券 4銘柄 | 91.0% | 9.0% | 0.5% |
| スイス・フラン | 株式 38銘柄 | 100% | -% | 3.3% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 32銘柄 | 100% | -% | 1.0% |
| デンマーク・クローネ | 株式 17銘柄 | 100% | -% | 0.6% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 7銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| ノルウェー・クローネ | 株式 10銘柄 | 100% | -% | 0.3% |
| ユーロ | 株式 236銘柄<br>投資証券 5銘柄 | 98.9% | 1.1% | 11.8% |
| 香港・ドル | 株式 39銘柄<br>投資証券 3銘柄 | 93.6% | 6.4% | 1.3% |

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国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

| | 平成29年11月30日現在<br>金　額（円） | 平成30年11月30日現在<br>金　額（円） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 20,051,538 | 71,246,230 |
| 金銭信託 | ― | 25,403,519 |
| コール・ローン | 65,648,748 | 49,403,934 |
| 株式 | 3,740,442,033 | 5,197,515,682 |
| 投資証券 | 522,883,991 | 924,423,814 |
| 派生商品評価勘定 | 359 | 185,864 |
| 未収配当金 | 2,071,136 | 4,372,749 |
| 差入委託証拠金 | 14,805,613 | 25,163,666 |
| 流動資産合計 | 4,365,903,418 | 6,297,715,458 |
| 資産合計 | 4,365,903,418 | 6,297,715,458 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |

| | | |
|---|---|---|
| 派生商品評価勘定 | 2,050 | 1,297,173 |
| 未払金 | 36,461,192 | 79,310,744 |
| 未払解約金 | 1,050,000 | 3,000,000 |
| その他未払費用 | ― | 349 |
| 流動負債合計 | 37,513,242 | 83,608,266 |
| 負債合計 | 37,513,242 | 83,608,266 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 2,723,283,667 | 3,983,740,010 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,605,106,509 | 2,230,367,182 |
| 元本等合計 | 4,328,390,176 | 6,214,107,192 |
| 純資産合計 | 4,328,390,176 | 6,214,107,192 |
| 負債純資産合計 | 4,365,903,418 | 6,297,715,458 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1．※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |

| | | |
|---|---|---|
| 期首元本額 | 1,456,258,081円 | 2,723,283,667円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,614,469,816円 | 1,553,881,551円 |
| 期中一部解約元本額 | 347,444,230円 | 293,425,208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（FOFs用）（適格機関投資家専用） | －円 | 6,993,217円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 147,974,518円 | 217,532,771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） | 113,028,892円 | 209,548,098円 |
| Ｄ－Ｉ's 新興国株式インデックス | 57,182,863円 | 86,296,597円 |
| ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス | 820,589,125円 | 1,278,144,286円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 431,983,078円 | 874,470,592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 | 790,143,943円 | 891,898,319円 |
| ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 | 312,535,206円 | 356,982,553円 |
| ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド | 49,846,042円 | 61,873,577円 |
| 計 | 2,723,283,667円 | 3,983,740,010円 |
| | | |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 2,723,283,667口 | 3,983,740,010口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|

| 種　類 | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 株式 | 310,972,245 | △14,126,307 |
| 投資証券 | 572,396 | △948,947 |
| 合計 | 311,544,641 | △15,075,254 |

（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（平成29年7月6日から平成29年11月30日まで、及び平成30年7月6日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 株価指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | － | － | － | － | 58,153,375 | － | 56,859,817 | △1,293,558 |
| 合計 | － | － | － | － | 58,153,375 | － | 56,859,817 | △1,293,558 |

（注）　1．　時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売　建 | 169,265 | － | 168,984 | 281 | 26,085 | － | 26,085 | 0 |
| インドネシア・ルピア | － | － | － | － | 26,085 | － | 26,085 | 0 |
| メキシコ・ペソ | 169,265 | － | 168,984 | 281 | － | － | － | － |
| 買　建 | 56,191,315 | － | 56,189,343 | △1,972 | 39,520,195 | － | 39,702,444 | 182,249 |
| アメリカ・ドル | 56,191,315 | － | 56,189,343 | △1,972 | 34,997,370 | － | 35,165,444 | 168,074 |
| インド・ルピー | － | － | － | － | 2,034,625 | － | 2,050,000 | 15,375 |
| 南アフリカ・ランド | － | － | － | － | 2,488,200 | － | 2,487,000 | △1,200 |
| 合計 | 56,360,580 | － | 56,358,327 | △1,691 | 39,546,280 | － | 39,728,529 | 182,249 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.5894円<br>(15,894円) | 1.5599円<br>(15,599円) |

## 附属明細表

### 第１ 有価証券明細表

#### (1) 株式

| 通 貨 | 銘 柄 | 株 式 数 | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単 価 | 金 額 | |
| アメリカ・ドル | | 株 | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル | |
| | SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF | 15,100 | 5.550 | 83,805.000 | |
| | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 900 | 156.280 | 140,652.000 | |
| | BAIDU INC - SPON ADR | 500 | 183.220 | 91,610.000 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR | 19,050 | 7.530 | 143,446.500 | |
| | JD.COM INC-ADR | 1,200 | 20.970 | 25,164.000 | |
| | NETEASE INC-ADR | 100 | 223.230 | 22,323.000 | |
| | CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR | 900 | 28.040 | 25,236.000 | |
| | VTB BANK JSC -GDR-REG S | 79,714 | 1.297 | 103,389.050 | |
| | TATNEFT PAO-SPONSORED ADR | 3,720 | 64.100 | 238,452.000 | |
| | SURGUTNEFTEGAS-SP ADR | 14,050 | 4.046 | 56,846.300 | |
| | MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR | 7,680 | 19.220 | 147,609.600 | |
| | SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR | 12,020 | 2.534 | 30,458.680 | |
| | MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 10,760 | 13.050 | 140,418.000 | |
| | RUSHYDRO PJSC-ADR | 32,910 | 0.740 | 24,353.400 | |
| | SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 41,930 | 11.885 | 498,338.050 | |
| | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 930 | 180.700 | 168,051.000 | |
| | LUKOIL PJSC-SPON ADR | 14,870 | 71.640 | 1,065,286.800 | |
| | ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR | 41,840 | 6.220 | 260,244.800 | |
| | GAZPROM PAO -SPON ADR | 266,010 | 4.991 | 1,327,655.910 | |
| | SEVERSTAL - GDR REG S | 3,930 | 14.990 | 58,910.700 | |
| | TATNEFT PJSC - PREF | 2,000 | 7.727 | 15,455.850 | |
| | ALROSA PJSC | 39,180 | 1.552 | 60,809.900 | |
| | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 17,509 | 1.358 | 23,792.400 | |
| | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 17,700 | 1.200 | 21,240.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | アメリカ・ドル 4,773,548.940 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | (541,654,598) | |
| インド・ルピー | | 株 | インド・ルピー | インド・ルピー | |
| | RAJESH EXPORTS LTD | 3,400 | 571.300 | 1,942,420.000 | |
| | TATA STEEL LTD | 5,320 | 533.550 | 2,838,486.000 | |
| | AXIS BANK LTD | 17,810 | 631.400 | 11,245,234.000 | |
| | MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 400 | 7,546.750 | 3,018,700.000 | |
| | HINDUSTAN UNILEVER LTD | 2,260 | 1,768.500 | 3,996,810.000 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 19,870 | 242.900 | 4,826,423.000 | |
| | STATE BANK OF INDIA | 42,820 | 286.400 | 12,263,648.000 | |
| | NTPC LTD | 40,950 | 142.250 | 5,825,137.500 | |
| | JSW STEEL LTD | 11,360 | 317.450 | 3,606,232.000 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 65,280 | 134.850 | 8,803,008.000 | |
| | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 24,685 | 328.500 | 8,109,022.500 | |
| | VODAFONE IDEA LTD | 30,430 | 37.850 | 1,151,775.500 | |
| | YES BANK LTD | 9,450 | 160.450 | 1,516,252.500 | |
| | TATA MOTORS LTD-A-DVR | 8,700 | 96.050 | 835,635.000 | |
| | REC LTD | 20,020 | 106.150 | 2,125,123.000 | |
| | COAL INDIA LTD | 27,050 | 246.900 | 6,678,645.000 | |
| | BHARTI INFRATEL LTD | 7,240 | 265.450 | 1,921,858.000 | |
| | INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 2,530 | 701.250 | 1,774,162.500 | |
| | GAIL INDIA LTD | 6,493 | 339.200 | 2,202,425.600 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 21,680 | 224.500 | 4,867,160.000 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 2,640 | 851.900 | 2,249,016.000 | |
| | WIPRO LTD | 9,720 | 314.900 | 3,060,828.000 | |
| | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 6,586 | 1,960.550 | 12,912,182.300 | |
| | INFOSYS LTD | 34,420 | 661.050 | 22,753,341.000 | |
| | LARSEN & TOUBRO LTD | 2,552 | 1,422.450 | 3,630,092.400 | |
| | TATA MOTORS LTD | 27,530 | 177.250 | 4,879,692.500 | |
| | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 9,220 | 1,956.300 | 18,037,086.000 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 33,980 | 1,168.500 | 39,705,630.000 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 74,175 | 140.600 | 10,429,005.000 | |
| | ITC LTD | 19,830 | 287.550 | 5,702,116.500 | |
| | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 6,450 | 773.200 | 4,987,140.000 | |
| | HERO MOTOCORP LTD | 770 | 3,016.800 | 2,322,936.000 | |
| | BHARTI AIRTEL LTD | 18,280 | 317.200 | 5,798,416.000 | |
| | SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 5,520 | 484.400 | 2,673,888.000 | |
| | HCL TECHNOLOGIES LTD | 3,990 | 1,013.450 | 4,043,665.500 | |
| | VEDANTA LTD | 25,390 | 198.800 | 5,047,532.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| インド・ルピー　小計 | | | | インド・ルピー<br>237,780,725.300<br>(389,960,390) | |
| インドネシア・ルピア | | 株 | インドネシア・ルピア | インドネシア・ルピア | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 15,100 | 29,350.000 | 443,185,000.000 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 223,100 | 8,475.000 | 1,890,772,500.000 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 63,500 | 6,400.000 | 406,400,000.000 | |
| | TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER | 641,300 | 3,740.000 | 2,398,462,000.000 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 79,000 | 8,775.000 | 693,225,000.000 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 51,500 | 26,200.000 | 1,349,300,000.000 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 210,800 | 7,650.000 | 1,612,620,000.000 | |
| | PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER | 298,700 | 1,940.000 | 579,478,000.000 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 552,400 | 3,710.000 | 2,049,404,000.000 | |
| インドネシア・ルピア　小計 | | | | インドネシア・ルピア<br>11,422,846,500.000<br>(90,240,488) | |
| シンガポール・ドル | | 株 | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 32,500 | 1.260 | 40,950.000 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | | シンガポール・ドル<br>40,950.000<br>(3,394,345) | |
| タイ・バーツ | | 株 | タイ・バーツ | タイ・バーツ | |
| | BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG | 7,300 | 211.000 | 1,540,300.000 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 13,900 | 442.000 | 6,143,800.000 | |
| | KASIKORNBANK PCL-FOREIGN | 16,400 | 192.000 | 3,148,800.000 | |
| | KASIKORNBANK PCL-NVDR | 11,700 | 192.000 | 2,246,400.000 | |
| | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 38,500 | 136.500 | 5,255,250.000 | |
| | THANACHART CAPITAL PCL-NVDR | 21,100 | 52.500 | 1,107,750.000 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 20,000 | 176.500 | 3,530,000.000 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 141,200 | 20.200 | 2,852,240.000 | |
| | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 74,800 | 16.800 | 1,256,640.000 | |
| | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 33,500 | 129.000 | 4,321,500.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | IRPC PCL - NVDR | 155,800 | 6.000 | 934,800.000 | |
| | BANGCHAK CORP PCL-NVDR | 29,100 | 33.250 | 967,575.000 | |
| | PTT PCL-NVDR | 337,900 | 49.250 | 16,641,575.000 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 19,300 | 75.000 | 1,447,500.000 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 31,800 | 68.500 | 2,178,300.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 128,600 | 25.000 | 3,215,000.000 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 40,100 | 78.500 | 3,147,850.000 | |
| タイ・バーツ　小計 | | | | タイ・バーツ<br>59,935,280.000<br>(206,177,363) | |
| チリ・ペソ | | 株 | チリ・ペソ | チリ・ペソ | |
| | ENEL CHILE SA | 487,797 | 65.290 | 31,848,266.130 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 475 | 43,930.000 | 20,866,750.000 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 5,870 | 6,799.100 | 39,910,717.000 | |
| | CENCOSUD SA | 34,740 | 1,270.100 | 44,123,274.000 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 752,680 | 52.550 | 39,553,334.000 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 419,200 | 117.400 | 49,214,080.000 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 16,880 | 2,370.600 | 40,015,728.000 | |
| | S.A.C.I. FALABELLA | 4,110 | 5,068.700 | 20,832,357.000 | |
| | EMPRESAS COPEC SA | 3,700 | 9,333.300 | 34,533,210.000 | |
| | BANCO DE CHILE | 270,262 | 98.830 | 26,709,993.460 | |
| チリ・ペソ　小計 | | | | チリ・ペソ<br>347,607,709.590<br>(58,884,746) | |
| トルコ・リラ | | 株 | トルコ・リラ | トルコ・リラ | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 44,110 | 8.100 | 357,291.000 | |
| | AKBANK T.A.S. | 48,640 | 7.540 | 366,745.600 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 55,340 | 4.220 | 233,534.800 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 24,110 | 12.900 | 311,019.000 | |
| | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 3,350 | 125.800 | 421,430.000 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 19,741 | 7.540 | 148,847.140 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 37,000 | 8.250 | 305,250.000 | |
| | TURKIYE HALK BANKASI | 37,610 | 7.170 | 269,663.700 | |
| | TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D | 27,170 | 3.990 | 108,408.300 | |
| | KOC HOLDING AS | 24,385 | 15.300 | 373,090.500 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 10,870 | 16.950 | 184,246.500 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 2,270 | 84.150 | 191,020.500 | |
| トルコ・リラ　小計 | | | | トルコ・リラ<br>3,270,547.040<br>(71,853,919) | |
| ブラジル・レアル | | 株 | ブラジル・レアル | ブラジル・レアル | |
| | CIA PARANAENSE DE ENERGIA | 1,200 | 30.290 | 36,348.000 | |
| | PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 13,900 | 24.460 | 339,994.000 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 104,600 | 25.170 | 2,632,782.000 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 63,934 | 38.920 | 2,488,311.280 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 91,536 | 36.350 | 3,327,333.600 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 15,700 | 8.780 | 137,846.000 | |
| | VALE SA | 61,590 | 52.000 | 3,202,680.000 | |
| | GERDAU SA-PREF | 25,500 | 15.100 | 385,050.000 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 81,600 | 27.850 | 2,272,560.000 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 78,397 | 12.630 | 990,154.110 | |
| | ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR | 37,541 | 12.490 | 468,887.090 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 3,500 | 55.830 | 195,405.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 5,600 | 29.250 | 163,800.000 | |
| | BANCO DO BRASIL S.A. | 45,100 | 45.240 | 2,040,324.000 | |
| | COSAN SA | 2,600 | 33.880 | 88,088.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 9,700 | 25.770 | 249,969.000 | |
| | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 5,900 | 32.600 | 192,340.000 | |
| | EMBRAER SA | 12,700 | 21.750 | 276,225.000 | |
| | METALURGICA GERDAU SA-PREF | 59,600 | 7.110 | 423,756.000 | |
| | CCR SA | 14,000 | 12.740 | 178,360.000 | |
| | BRF SA | 15,700 | 22.500 | 353,250.000 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 5,700 | 28.710 | 163,647.000 | |
| | CIA ENERGETICA DE SP-PREF B | 7,700 | 19.800 | 152,460.000 | |
| | TIM PARTICIPACOES SA | 12,326 | 12.040 | 148,405.040 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF | 10,100 | 46.750 | 472,175.000 | |
| | LOJAS RENNER S.A. | 3,850 | 39.440 | 151,844.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LOJAS AMERICANAS SA-PREF | 6,600 | 19.980 | 131,868.000 | |
| | JBS SA | 61,100 | 11.750 | 717,925.000 | |
| | SUZANO PAPEL E CELULOSE SA | 4,900 | 38.930 | 190,757.000 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 12,000 | 28.650 | 343,800.000 | |
| | BR MALLS PARTICIPACOES SA | 11,308 | 12.960 | 146,551.680 | |
| | CIELO SA | 9,928 | 8.910 | 88,458.480 | |
| | FIBRIA CELULOSE SA | 2,700 | 72.280 | 195,156.000 | |
| | CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF | 5,400 | 83.530 | 451,062.000 | |
| | CIA ENERGETICA DE MINAS GER | 5,600 | 12.650 | 70,840.000 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 7,400 | 43.500 | 321,900.000 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 6,600 | 17.050 | 112,530.000 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 8,500 | 48.420 | 411,570.000 | |
| | LOJAS AMERICANAS SA | 1,900 | 14.700 | 27,930.000 | |
| | KROTON EDUCACIONAL SA | 13,000 | 10.900 | 141,700.000 | |
| | BANCO BRADESCO S.A. | 16,888 | 34.620 | 584,662.560 | |
| | AMBEV SA | 44,500 | 16.640 | 740,480.000 | |
| ブラジル・レアル　小計 | | | | ブラジル・レアル<br>26,209,184.840<br>(771,598,401) | |
| ポーランド・ズロチ | | 株 | ポーランド・ズロチ | ポーランド・ズロチ | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 9,910 | 41.700 | 413,247.000 | |
| | BANK PEKAO SA | 3,120 | 109.450 | 341,484.000 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 12,260 | 42.950 | 526,567.000 | |
| | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | 22,790 | 6.330 | 144,260.700 | |
| | PGE SA | 11,870 | 11.370 | 134,961.900 | |
| | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 6,190 | 112.850 | 698,541.500 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 3,640 | 90.280 | 328,619.200 | |
| ポーランド・ズロチ　小計 | | | | ポーランド・ズロチ<br>2,587,681.300<br>(77,992,715) | |
| マレーシア・リンギット | | 株 | マレーシア・リンギット | マレーシア・リンギット | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 88,100 | 9.450 | 832,545.000 | |
| | GENTING BHD | 20,400 | 6.340 | 129,336.000 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 33,000 | 24.900 | 821,700.000 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 69,900 | 2.400 | 167,760.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | AXIATA GROUP BERHAD | 42,500 | 3.780 | 160,650.000 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 29,700 | 9.250 | 274,725.000 | |
| | GENTING MALAYSIA BHD | 30,200 | 2.840 | 85,768.000 | |
| | IOI CORP BHD | 29,500 | 4.400 | 129,800.000 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 100,000 | 5.850 | 585,000.000 | |
| | SIME DARBY PLANTATION BHD | 27,800 | 4.970 | 138,166.000 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 69,700 | 14.240 | 992,528.000 | |
| | DIGI.COM BHD | 26,900 | 4.230 | 113,787.000 | |
| | SAPURA ENERGY BHD | 251,100 | 0.340 | 85,374.000 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | | | マレーシア・リンギット<br>4,517,139.000<br>(122,459,639) | |
| メキシコ・ペソ | | 株 | メキシコ・ペソ | メキシコ・ペソ | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 626,200 | 13.970 | 8,748,014.000 | |
| | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO | 33,300 | 57.090 | 1,901,097.000 | |
| | CEMEX SAB-CPO | 424,519 | 10.360 | 4,398,016.840 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 26,900 | 176.340 | 4,743,546.000 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB-SER L | 7,300 | 126.360 | 922,428.000 | |
| | MEXICHEM SAB DE CV-* | 13,823 | 48.350 | 668,342.050 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 15,700 | 39.990 | 627,843.000 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 1,475 | 239.000 | 352,525.000 | |
| | ALFA S.A.B.-A | 75,800 | 20.280 | 1,537,224.000 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 61,500 | 42.080 | 2,587,920.000 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 77,500 | 49.800 | 3,859,500.000 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 28,700 | 91.930 | 2,638,391.000 | |
| メキシコ・ペソ　小計 | | | | メキシコ・ペソ<br>32,984,846.890<br>(185,044,991) | |
| 香港・ドル | | 株 | 香港・ドル | 香港・ドル | |
| | CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 80,500 | 10.240 | 824,320.000 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 125,000 | 7.290 | 911,250.000 | |
| | CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 20,000 | 14.300 | 286,000.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 12,500 | 21.050 | 263,125.000 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 15,000 | 15.440 | 231,600.000 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 34,000 | 27.100 | 921,400.000 | |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H | 32,000 | 9.410 | 301,120.000 | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 1,027,800 | 6.590 | 6,773,202.000 | |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 9,000 | 45.500 | 409,500.000 | |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 56,000 | 7.420 | 415,520.000 | |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 365,000 | 0.690 | 251,850.000 | |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 28,000 | 12.180 | 341,040.000 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 5,800 | 312.000 | 1,809,600.000 | |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H | 540,000 | 4.190 | 2,262,600.000 | |
| SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD | 92,000 | 1.940 | 178,480.000 | |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 152,000 | 9.000 | 1,368,000.000 | |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 32,500 | 19.000 | 617,500.000 | |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 66,000 | 3.650 | 240,900.000 | |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 74,000 | 14.800 | 1,095,200.000 | |
| PETROCHINA CO LTD-H | 596,000 | 5.430 | 3,236,280.000 | |
| CNOOC LTD | 454,000 | 12.820 | 5,820,280.000 | |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 196,000 | 4.790 | 938,840.000 | |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 13,000 | 40.500 | 526,500.000 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 84,000 | 6.190 | 519,960.000 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 2,264,000 | 6.640 | 15,032,960.000 | |
| CHINA MOBILE LTD | 129,000 | 76.500 | 9,868,500.000 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 15,800 | 25.950 | 410,010.000 | |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 237,000 | 5.000 | 1,185,000.000 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 16,800 | 13.060 | 219,408.000 | |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H | 176,000 | 1.590 | 279,840.000 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 7,500 | 63.950 | 479,625.000 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 126,000 | 4.650 | 585,900.000 | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 82,000 | 17.380 | 1,425,160.000 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 26,000 | 38.900 | 1,011,400.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 40,000 | 28.250 | 1,130,000.000 | |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 11,000 | 18.680 | 205,480.000 | |
| YANZHOU COAL MINING CO-H | 20,000 | 6.890 | 137,800.000 | |
| BYD CO LTD-H | 4,000 | 59.400 | 237,600.000 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 696,000 | 3.550 | 2,470,800.000 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 8,100 | 34.500 | 279,450.000 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 236,000 | 3.360 | 792,960.000 | |
| CITIC LTD | 77,000 | 12.540 | 965,580.000 | |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 271,000 | 2.080 | 563,680.000 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 1,696,000 | 5.520 | 9,361,920.000 | |
| LEGEND HOLDINGS CORP-H | 14,800 | 22.500 | 333,000.000 | |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 32,000 | 11.640 | 372,480.000 | |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 4,712 | 12.700 | 59,842.400 | |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD | 28,000 | 15.100 | 422,800.000 | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 64,000 | 26.600 | 1,702,400.000 | |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 125,000 | 7.720 | 965,000.000 | |
| CGN POWER CO LTD-H | 140,000 | 1.920 | 268,800.000 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 40,500 | 75.800 | 3,069,900.000 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 10,000 | 24.900 | 249,000.000 | |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 198,000 | 1.440 | 285,120.000 | |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 183,080 | 5.790 | 1,060,033.200 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 50,000 | 9.470 | 473,500.000 | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 11,300 | 27.300 | 308,490.000 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 144,000 | 8.040 | 1,157,760.000 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 46,500 | 5.020 | 233,430.000 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 193,000 | 1.800 | 347,400.000 | |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 35,000 | 7.270 | 254,450.000 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 100,000 | 2.770 | 277,000.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 32,200 | 27.800 | 895,160.000 | |
| | CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 84,000 | 16.780 | 1,409,520.000 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 6,000 | 70.400 | 422,400.000 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 62,000 | 9.420 | 584,040.000 | |
| | GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H | 23,600 | 11.900 | 280,840.000 | |
| | LENOVO GROUP LTD | 428,000 | 5.540 | 2,371,120.000 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 170,000 | 6.020 | 1,023,400.000 | |
| | BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 257,100 | 5.940 | 1,527,174.000 | |
| | CHINA EVERGRANDE GROUP | 33,000 | 22.700 | 749,100.000 | |
| | SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 70,000 | 3.460 | 242,200.000 | |
| | AGILE GROUP HOLDINGS LTD | 32,000 | 10.240 | 327,680.000 | |
| | CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 59,000 | 4.530 | 267,270.000 | |
| | GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 310,000 | 0.560 | 173,600.000 | |
| | CHINA MERCHANTS BANK-H | 58,500 | 32.200 | 1,883,700.000 | |
| | BANK OF CHINA LTD-H | 2,187,000 | 3.430 | 7,501,410.000 | |
| | SOHO CHINA LTD | 62,000 | 2.980 | 184,760.000 | |
| | CITIC SECURITIES CO LTD-H | 22,000 | 14.620 | 321,640.000 | |
| | CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 72,000 | 3.540 | 254,880.000 | |
| | HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 41,200 | 8.230 | 339,076.000 | |
| | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 16,500 | 22.000 | 363,000.000 | |
| 香港・ドル　小計 | | | | 香港・ドル<br>110,149,515.600<br>(1,598,269,472) | |
| 台湾・ドル | | 株 | 台湾・ドル | 台湾・ドル | |
| | TAIWAN CEMENT | 94,600 | 34.050 | 3,221,130.000 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 38,000 | 32.650 | 1,240,700.000 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 64,964 | 62.000 | 4,027,768.000 | |
| | TAIWAN CEMENT CORP RIGHTS | 2,963 | 0.000 | 0.000 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 57,112 | 72.200 | 4,123,486.400 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 53,600 | 99.500 | 5,333,200.000 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 57,140 | 74.300 | 4,245,502.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 50,390 | 104.500 | 5,265,755.000 | |
| WALSIN LIHWA CORP | 72,000 | 17.650 | 1,270,800.000 | |
| CHINA STEEL CORP | 106,686 | 23.850 | 2,544,461.100 | |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 29,255 | 41.600 | 1,217,008.000 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 48,616 | 40.000 | 1,944,640.000 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 28,000 | 128.500 | 3,598,000.000 | |
| ACER INC | 75,000 | 19.650 | 1,473,750.000 | |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 19,141 | 61.300 | 1,173,343.300 | |
| INVENTEC CORP | 65,000 | 22.100 | 1,436,500.000 | |
| TATUNG CO LTD | 47,000 | 39.850 | 1,872,950.000 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 48,000 | 49.150 | 2,359,200.000 | |
| AU OPTRONICS CORP | 427,000 | 12.700 | 5,422,900.000 | |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 60,400 | 106.500 | 6,432,600.000 | |
| MEDIATEK INC | 25,003 | 231.500 | 5,788,194.500 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 10,000 | 252.500 | 2,525,000.000 | |
| HTC CORP | 18,257 | 47.000 | 858,079.000 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 41,151 | 28.950 | 1,191,321.450 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 129,411 | 48.600 | 6,289,374.600 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 137,693 | 48.550 | 6,684,995.150 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 217,000 | 9.990 | 2,167,830.000 | |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 90,334 | 20.650 | 1,865,397.100 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 148,828 | 15.600 | 2,321,716.800 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 104,993 | 25.750 | 2,703,569.750 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 103,575 | 13.500 | 1,398,262.500 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 185,677 | 10.350 | 1,921,756.950 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 106,080 | 10.500 | 1,113,840.000 | |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 313,028 | 20.400 | 6,385,771.200 | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 96,210 | 20.200 | 1,943,442.000 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 1,000 | 3,515.000 | 3,515,000.000 | |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 10,000 | 127.000 | 1,270,000.000 | |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 19,000 | 109.000 | 2,071,000.000 | |
| WISTRON CORP | 111,110 | 19.550 | 2,172,200.500 | |
| INNOLUX CORP | 458,000 | 10.350 | 4,740,300.000 | |
| TPK HOLDING CO LTD | 16,000 | 52.000 | 832,000.000 | |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 21,000 | 73.100 | 1,535,100.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PEGATRON CORP | 80,000 | 52.400 | 4,192,000.000 | |
| | CHAILEASE HOLDING CO LTD | 11,220 | 95.200 | 1,068,144.000 | |
| | TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 61,800 | 17.800 | 1,100,040.000 | |
| | POWERTECH TECHNOLOGY INC | 11,400 | 72.500 | 826,500.000 | |
| | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 14,000 | 111.000 | 1,554,000.000 | |
| | POU CHEN | 27,440 | 32.650 | 895,916.000 | |
| | COMPAL ELECTRONICS | 61,453 | 17.500 | 1,075,427.500 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 193,000 | 229.000 | 44,197,000.000 | |
| | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 300,902 | 72.400 | 21,785,304.800 | |
| | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 5,000 | 323.500 | 1,617,500.000 | |
| | ASUSTEK COMPUTER INC | 8,760 | 218.000 | 1,909,680.000 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 63,000 | 28.300 | 1,782,900.000 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 355,000 | 11.500 | 4,082,500.000 | |
| 台湾・ドル　小計 | | | | 台湾・ドル<br>205,584,757.600<br>(756,551,908) | |
| 南アフリカ・ランド | | 株 | 南アフリカ・ランド | 南アフリカ・ランド | |
| | GOLD FIELDS LTD | 24,530 | 42.000 | 1,030,260.000 | |
| | MOTUS HOLDINGS LTD | 4,220 | 88.250 | 372,415.000 | |
| | VODACOM GROUP LTD | 8,780 | 128.250 | 1,126,035.000 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 4,650 | 200.500 | 932,325.000 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 3,980 | 272.790 | 1,085,704.200 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 3,030 | 209.350 | 634,330.500 | |
| | BID CORP LTD | 3,850 | 268.560 | 1,033,956.000 | |
| | NETCARE LTD | 22,830 | 26.300 | 600,429.000 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 20,180 | 180.150 | 3,635,427.000 | |
| | IMPERIAL HOLDINGS LTD | 4,220 | 64.810 | 273,498.200 | |
| | SASOL LTD | 13,330 | 421.070 | 5,612,863.100 | |
| | REMGRO LTD | 4,580 | 210.000 | 961,800.000 | |
| | EXXARO RESOURCES LTD | 3,480 | 132.500 | 461,100.000 | |
| | TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 5,940 | 88.920 | 528,184.800 | |
| | SANLAM LTD | 19,600 | 78.470 | 1,538,012.000 | |
| | TIGER BRANDS LTD | 1,250 | 270.430 | 338,037.500 | |
| | FIRSTRAND LTD | 34,960 | 70.070 | 2,449,647.200 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 14,760 | 56.640 | 836,006.400 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | THE FOSCHINI GROUP LTD | 2,590 | 180.600 | 467,754.000 | |
| | ABSA GROUP LTD | 15,560 | 158.800 | 2,470,928.000 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 720 | 2,820.000 | 2,030,400.000 | |
| | INVESTEC LTD | 4,440 | 86.400 | 383,616.000 | |
| | MTN GROUP LTD | 34,190 | 89.800 | 3,070,262.000 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 23,510 | 33.340 | 783,823.400 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 2,470 | 151.110 | 373,241.700 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 8,760 | 140.510 | 1,230,867.600 | |
| | BARLOWORLD LTD | 4,800 | 119.900 | 575,520.000 | |
| | SAPPI LIMITED | 10,720 | 78.250 | 838,840.000 | |
| | TELKOM SA SOC LTD | 8,670 | 56.900 | 493,323.000 | |
| | MONDI LTD | 1,320 | 312.010 | 411,853.200 | |
| | MMI HOLDINGS LTD | 16,600 | 18.200 | 302,120.000 | |
| | SPAR GROUP LIMITED/THE | 3,320 | 200.360 | 665,195.200 | |
| | MR PRICE GROUP LTD | 1,590 | 251.690 | 400,187.100 | |
| | LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN | 21,630 | 26.810 | 579,900.300 | |
| | SIBANYE GOLD LTD | 49,710 | 8.850 | 439,933.500 | |
| 南アフリカ・ランド　小計 | | | | 南アフリカ・ランド<br>38,967,795.900<br>(323,432,707) | |
| 合計 | | | | 5,197,515,682<br>[5,197,515,682] | |

(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 | 388,000 | アメリカ・ドル<br>7,992,800.000 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>7,992,800.000<br>(906,943,016) | |
| | メキシコ・ペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 46,800 | メキシコ・ペソ<br>979,992.000 | |
| | メキシコ・ペソ　小計 | | | メキシコ・ペソ<br>979,992.000<br>(5,497,755) | |
| | 南アフリカ・ランド | | | 南アフリカ・ランド | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | REDEFINE PROPERTIES LTD | 61,790 | 604,306.200 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 35,300 | 839,434.000 | |
| | 南アフリカ・ランド　小計 | | | 南アフリカ・ランド<br>1,443,740.200<br>(11,983,043) | |
| 投資証券　合計 | | | | 924,423,814<br>[924,423,814] | |
| 合計 | | | | 924,423,814<br>[924,423,814] | |

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　24銘柄<br>投資証券　1銘柄 | 37.4% | 62.6% | 23.7% |
| インド・ルピー | 株式　36銘柄 | 100% | -% | 6.4% |
| インドネシア・ルピア | 株式　9銘柄 | 100% | -% | 1.5% |
| シンガポール・ドル | 株式　1銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| タイ・バーツ | 株式　17銘柄 | 100% | -% | 3.4% |
| チリ・ペソ | 株式　10銘柄 | 100% | -% | 1.0% |
| トルコ・リラ | 株式　12銘柄 | 100% | -% | 1.2% |
| ブラジル・レアル | 株式　42銘柄 | 100% | -% | 12.6% |
| ポーランド・ズロチ | 株式　7銘柄 | 100% | -% | 1.3% |
| マレーシア・リンギット | 株式　13銘柄 | 100% | -% | 2.0% |
| メキシコ・ペソ | 株式　12銘柄<br>投資証券　1銘柄 | 97.1% | 2.9% | 3.1% |
| 香港・ドル | 株式　82銘柄 | 100% | -% | 25.8% |
| 台湾・ドル | 株式　55銘柄 | 100% | -% | 12.4% |
| 南アフリカ・ランド | 株式　35銘柄<br>投資証券　2銘柄 | 96.4% | 3.6% | 5.5% |

## 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 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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 1,489,774 |
| コール・ローン | 3,272,761 | 2,897,265 |
| 親投資信託受益証券 | 1,377,630,796 | 2,159,420,831 |
| 未収入金 | 918,341 | ― |
| 流動資産合計 | 1,381,821,898 | 2,163,807,870 |
| 資産合計 | 1,381,821,898 | 2,163,807,870 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 2,339,479 | 1,030,817 |
| 未払受託者報酬 | 45,334 | 114,339 |
| 未払委託者報酬 | 408,365 | 1,029,386 |
| その他未払費用 | 22,612 | 57,141 |
| 流動負債合計 | 2,815,790 | 2,231,683 |
| 負債合計 | 2,815,790 | 2,231,683 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 1,377,639,463 | ※1 2,156,165,819 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,366,645 | 5,410,368 |
| （分配準備積立金） | 2,665,999 | 3,138,560 |
| 元本等合計 | 1,379,006,108 | 2,161,576,187 |
| 純資産合計 | 1,379,006,108 | 2,161,576,187 |
| 負債純資産合計 | 1,381,821,898 | 2,163,807,870 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | ― | 1 |
| 有価証券売買等損益 | 3,401,894 | 2,962,270 |
| 営業収益合計 | 3,401,894 | 2,962,271 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 793 | 3,513 |
| 受託者報酬 | 60,121 | 197,945 |
| 委託者報酬 | 541,859 | 1,782,257 |
| その他費用 | 29,976 | 99,292 |
| 営業費用合計 | 632,749 | 2,083,007 |
| 営業利益 | 2,769,145 | 879,264 |
| 経常利益 | 2,769,145 | 879,264 |
| 当期純利益 | 2,769,145 | 879,264 |
| 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（△） | 103,907 | △ 353,647 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 1,366,645 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 164,222 | 3,867,833 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 164,222 | ― |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | ― | 3,867,833 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,462,815 | 1,057,021 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | ― | 1,057,021 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,462,815 | ― |
| 分配金 | ※1 ― | ※1 ― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,366,645 | 5,410,368 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 1,377,639,463円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,498,842,558円 | 1,389,815,832円 |
| 期中一部解約元本額 | 122,203,095円 | 611,289,476円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 1,377,639,463口 | 2,156,165,819口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,665,999円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は2,665,999円（1万口当たり19.35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（1,235,401円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,274,856円）及び分配準備積立金（1,903,159円）より分配対象額は5,413,416円（1万口当たり25.11円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 3,390,724 | 3,153,173 |
| 合計 | 3,390,724 | 3,153,173 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.0010円 | 1.0025円 |

| | | |
|---|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (10,010円) | (10,025円) |

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券 | 日本債券インデックスマザーファンド | 1,545,313,319 | 2,159,420,831 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 2,159,420,831 | |
| 合計 | | | 2,159,420,831 | |

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

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | － | 77,483,707 |
| コール・ローン | 328,217,271 | 150,687,784 |

| | | |
|---|---|---|
| 国債証券 | 56,883,147,780 | 67,198,735,300 |
| 地方債証券 | 4,405,150,700 | 4,305,812,600 |
| 特殊債券 | 3,211,257,800 | 3,325,811,500 |
| 社債券 | 3,212,890,300 | 3,306,672,600 |
| 未収入金 | ― | 202,835,000 |
| 未収利息 | 181,873,953 | 193,828,008 |
| 前払費用 | 5,395,389 | 4,802,646 |
| 流動資産合計 | 68,227,933,193 | 78,766,669,145 |
| 資産合計 | 68,227,933,193 | 78,766,669,145 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 88,741,204 | 276,774,272 |
| その他未払費用 | ― | 2,408 |
| 流動負債合計 | 88,741,204 | 276,776,680 |
| 負債合計 | 88,741,204 | 276,776,680 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 48,889,824,254 | 56,170,487,793 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 19,249,367,735 | 22,319,404,672 |
| 元本等合計 | 68,139,191,989 | 78,489,892,465 |
| 純資産合計 | 68,139,191,989 | 78,489,892,465 |
| 負債純資産合計 | 68,227,933,193 | 78,766,669,145 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 |

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

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 38,988,528,535円 | 48,889,824,254円 |
| 期中追加設定元本額 | 14,405,933,970円 | 15,940,542,707円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,504,638,251円 | 8,659,879,168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) | 158,413,208円 | 129,097,081円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 1,115,777,521円 | 795,274,382円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 129,471,630円 | 105,597,525円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 1,544,820,823円 | 1,111,264,823円 |
| Ｄ－Ｉ'ｓ 日本債券インデックス | 761,060円 | －円 |
| ＤＣダイワ日本債券インデックス | 5,048,119,641円 | 5,920,239,246円 |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 14,793,606,425円 | 13,051,578,465円 |
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 2,332,093,501円 | 2,124,813,517円 |
| ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 315,508,234円 | 293,362,664円 |
| ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用） | 427,330,074円 | 405,138,528円 |
| ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド | 56,164,883円 | 62,288,888円 |
| ダイワファンドラップ 日本債券インデックス | 13,311,941,351円 | 19,210,529,646円 |

| | | |
|---|---|---|
| ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 17,276,903円 | 2,623,576,618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 | 988,470,113円 | 1,545,313,319円 |
| ダイワ・インデックスセレクト日本債券 | 1,245,052,313円 | 1,266,064,865円 |
| ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス | 6,339,363,709円 | 6,443,095,280円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 451,259,183円 | 452,397,864円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 481,361,512円 | 492,380,016円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 133,032,170円 | 138,475,066円 |
| 計 | 48,889,824,254円 | 56,170,487,793円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 48,889,824,254口 | 56,170,487,793口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

| | |
|---|---|
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 国債証券 | △674,418,240 | △389,359,740 |
| 地方債証券 | △36,738,700 | △24,799,600 |
| 特殊債券 | △28,244,960 | △18,142,200 |
| 社債券 | △17,765,100 | △16,426,800 |
| 合計 | △757,167,000 | △448,728,340 |

（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（平成28年12月1日から平成29年11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.3937円<br>(13,937円) | 1.3974円<br>(13,974円) |

**附属明細表**

第１　有価証券明細表

(1)　株式

該当事項はありません。

(2)　株式以外の有価証券

| 種　類 | 銘　柄 | 券面総額（円） | 評価額（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | ３８３　２年国債 | 450,000,000 | 451,138,500 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３８５　２年国債 | 500,000,000 | 501,505,000 | |
| ３９１　２年国債 | 100,000,000 | 100,416,000 | |
| １２２　５年国債 | 630,000,000 | 631,581,300 | |
| １２３　５年国債 | 780,000,000 | 782,472,600 | |
| １２４　５年国債 | 1,340,000,000 | 1,345,078,600 | |
| １２５　５年国債 | 940,000,000 | 944,145,400 | |
| １２６　５年国債 | 890,000,000 | 894,467,800 | |
| １２７　５年国債 | 980,000,000 | 985,409,600 | |
| １２８　５年国債 | 1,000,000,000 | 1,006,000,000 | |
| １２９　５年国債 | 1,020,000,000 | 1,026,579,000 | |
| １３０　５年国債 | 880,000,000 | 886,186,400 | |
| １３１　５年国債 | 920,000,000 | 926,992,000 | |
| １３２　５年国債 | 580,000,000 | 584,645,800 | |
| １３３　５年国債 | 550,000,000 | 554,719,000 | |
| １３４　５年国債 | 510,000,000 | 514,666,500 | |
| １３５　５年国債 | 950,000,000 | 959,015,500 | |
| １３６　５年国債 | 700,000,000 | 706,874,000 | |
| １３７　５年国債 | 80,000,000 | 80,790,400 | |
| １　４０年国債 | 70,000,000 | 99,047,200 | |
| ２　４０年国債 | 186,000,000 | 254,459,160 | |
| ３　４０年国債 | 74,000,000 | 101,710,040 | |
| ４　４０年国債 | 107,000,000 | 147,717,780 | |
| ５　４０年国債 | 125,000,000 | 165,962,500 | |
| ６　４０年国債 | 105,000,000 | 136,632,300 | |
| ７　４０年国債 | 121,000,000 | 150,350,970 | |
| ８　４０年国債 | 230,000,000 | 264,718,500 | |
| ９　４０年国債 | 220,000,000 | 183,893,600 | |
| １０　４０年国債 | 375,000,000 | 371,298,750 | |
| １１　４０年国債 | 160,000,000 | 152,478,400 | |
| ３０５　１０年国債 | 500,000,000 | 507,490,000 | |
| ３０６　１０年国債 | 255,000,000 | 260,087,250 | |
| ３０７　１０年国債 | 400,000,000 | 407,460,000 | |
| ３０８　１０年国債 | 200,000,000 | 204,458,000 | |
| ３０９　１０年国債 | 90,000,000 | 91,728,000 | |
| ３１０　１０年国債 | 130,000,000 | 132,670,200 | |
| ３１１　１０年国債 | 150,000,000 | 152,539,500 | |
| ３１２　１０年国債 | 700,000,000 | 719,173,000 | |
| ３１３　１０年国債 | 200,000,000 | 206,600,000 | |
| ３１４　１０年国債 | 260,000,000 | 267,384,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３１５　１０年国債 | 221,000,000 | 228,505,160 | |
| ３１６　１０年国債 | 250,000,000 | 257,850,000 | |
| ３１７　１０年国債 | 214,000,000 | 221,357,320 | |
| ３１８　１０年国債 | 200,000,000 | 206,314,000 | |
| ３１９　１０年国債 | 100,000,000 | 103,746,000 | |
| ３２０　１０年国債 | 230,000,000 | 237,912,000 | |
| ３２１　１０年国債 | 175,000,000 | 181,510,000 | |
| ３２２　１０年国債 | 130,000,000 | 134,405,700 | |
| ３２４　１０年国債 | 410,000,000 | 423,427,500 | |
| ３２５　１０年国債 | 310,000,000 | 320,877,900 | |
| ３２６　１０年国債 | 30,000,000 | 31,000,200 | |
| ３２７　１０年国債 | 450,000,000 | 466,834,500 | |
| ３２８　１０年国債 | 350,000,000 | 360,874,500 | |
| ３２９　１０年国債 | 500,000,000 | 520,900,000 | |
| ３３０　１０年国債 | 612,000,000 | 638,854,560 | |
| ３３１　１０年国債 | 365,000,000 | 377,497,600 | |
| ３３２　１０年国債 | 310,000,000 | 321,085,600 | |
| ３３３　１０年国債 | 700,000,000 | 726,068,000 | |
| ３３４　１０年国債 | 800,000,000 | 830,992,000 | |
| ３３５　１０年国債 | 780,000,000 | 806,816,400 | |
| ３３６　１０年国債 | 275,000,000 | 284,691,000 | |
| ３３７　１０年国債 | 300,000,000 | 306,924,000 | |
| ３３８　１０年国債 | 490,000,000 | 504,714,700 | |
| ３３９　１０年国債 | 780,000,000 | 804,102,000 | |
| ３４０　１０年国債 | 770,000,000 | 794,170,300 | |
| ３４１　１０年国債 | 260,000,000 | 266,528,600 | |
| ３４２　１０年国債 | 830,000,000 | 839,105,100 | |
| ３４３　１０年国債 | 830,000,000 | 838,789,700 | |
| ３４４　１０年国債 | 640,000,000 | 646,246,400 | |
| ３４５　１０年国債 | 730,000,000 | 736,759,800 | |
| ３４６　１０年国債 | 800,000,000 | 806,968,000 | |
| ３４７　１０年国債 | 330,000,000 | 332,534,400 | |
| ３４８　１０年国債 | 600,000,000 | 604,212,000 | |
| ３４９　１０年国債 | 750,000,000 | 754,395,000 | |
| ３５０　１０年国債 | 810,000,000 | 813,742,200 | |
| ３５１　１０年国債 | 600,000,000 | 601,704,000 | |
| ３５２　１０年国債 | 210,000,000 | 210,304,500 | |
| １　３０年国債 | 16,000,000 | 20,515,840 | |
| ２　３０年国債 | 24,000,000 | 29,989,680 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ３　３０年国債 | 30,000,000 | 37,245,900 | |
| ４　３０年国債 | 36,000,000 | 47,523,960 | |
| ５　３０年国債 | 28,000,000 | 34,807,920 | |
| ６　３０年国債 | 24,000,000 | 30,594,720 | |
| ７　３０年国債 | 55,000,000 | 69,727,350 | |
| ８　３０年国債 | 27,000,000 | 32,539,050 | |
| ９　３０年国債 | 43,000,000 | 49,475,370 | |
| １０　３０年国債 | 45,000,000 | 49,933,800 | |
| １１　３０年国債 | 40,000,000 | 47,771,200 | |
| １２　３０年国債 | 60,000,000 | 75,195,000 | |
| １３　３０年国債 | 75,000,000 | 93,087,750 | |
| １４　３０年国債 | 82,000,000 | 106,788,600 | |
| １５　３０年国債 | 100,000,000 | 131,989,000 | |
| １６　３０年国債 | 100,000,000 | 132,283,000 | |
| １７　３０年国債 | 80,000,000 | 104,757,600 | |
| １８　３０年国債 | 80,000,000 | 103,725,600 | |
| １９　３０年国債 | 57,000,000 | 73,978,020 | |
| ２０　３０年国債 | 60,000,000 | 79,957,800 | |
| ２１　３０年国債 | 60,000,000 | 78,130,200 | |
| ２２　３０年国債 | 70,000,000 | 93,548,700 | |
| ２３　３０年国債 | 60,000,000 | 80,327,400 | |
| ２４　３０年国債 | 92,000,000 | 123,381,200 | |
| ２５　３０年国債 | 150,000,000 | 196,317,000 | |
| ２６　３０年国債 | 180,000,000 | 238,921,200 | |
| ２７　３０年国債 | 150,000,000 | 202,242,000 | |
| ２８　３０年国債 | 170,000,000 | 229,824,700 | |
| ２９　３０年国債 | 200,000,000 | 267,488,000 | |
| ３０　３０年国債 | 220,000,000 | 290,813,600 | |
| ３１　３０年国債 | 180,000,000 | 235,207,800 | |
| ３２　３０年国債 | 235,000,000 | 312,493,600 | |
| ３３　３０年国債 | 311,000,000 | 396,070,940 | |
| ３４　３０年国債 | 233,000,000 | 306,905,270 | |
| ３５　３０年国債 | 295,000,000 | 377,443,650 | |
| ３６　３０年国債 | 320,000,000 | 410,297,600 | |
| ３７　３０年国債 | 300,000,000 | 378,846,000 | |
| ３８　３０年国債 | 220,000,000 | 273,365,400 | |
| ３９　３０年国債 | 172,000,000 | 217,739,960 | |
| ４０　３０年国債 | 140,000,000 | 174,195,000 | |
| ４１　３０年国債 | 170,000,000 | 207,775,700 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ４２　３０年国債 | 176,000,000 | 215,205,760 | |
| ４３　３０年国債 | 170,000,000 | 207,964,400 | |
| ４４　３０年国債 | 165,000,000 | 201,936,900 | |
| ４５　３０年国債 | 200,000,000 | 235,506,000 | |
| ４６　３０年国債 | 180,000,000 | 211,975,200 | |
| ４７　３０年国債 | 190,000,000 | 228,533,900 | |
| ４８　３０年国債 | 250,000,000 | 288,510,000 | |
| ４９　３０年国債 | 93,000,000 | 107,315,490 | |
| ５０　３０年国債 | 215,000,000 | 216,453,400 | |
| ５１　３０年国債 | 240,000,000 | 211,718,400 | |
| ５２　３０年国債 | 235,000,000 | 218,470,100 | |
| ５３　３０年国債 | 185,000,000 | 176,321,650 | |
| ５４　３０年国債 | 218,000,000 | 218,503,580 | |
| ５５　３０年国債 | 200,000,000 | 200,232,000 | |
| ５６　３０年国債 | 210,000,000 | 210,000,000 | |
| ５７　３０年国債 | 250,000,000 | 249,705,000 | |
| ５８　３０年国債 | 300,000,000 | 299,289,000 | |
| ５９　３０年国債 | 200,000,000 | 194,060,000 | |
| ６０　３０年国債 | 35,000,000 | 35,756,000 | |
| ４４　２０年国債 | 85,000,000 | 87,912,100 | |
| ４５　２０年国債 | 148,000,000 | 152,879,560 | |
| ４６　２０年国債 | 73,000,000 | 75,654,280 | |
| ４７　２０年国債 | 89,000,000 | 92,757,580 | |
| ４８　２０年国債 | 54,000,000 | 56,929,500 | |
| ４９　２０年国債 | 64,000,000 | 67,297,920 | |
| ５０　２０年国債 | 107,000,000 | 112,020,440 | |
| ５１　２０年国債 | 82,000,000 | 86,464,900 | |
| ５２　２０年国債 | 52,000,000 | 55,250,520 | |
| ５３　２０年国債 | 66,000,000 | 70,490,640 | |
| ５４　２０年国債 | 65,000,000 | 69,621,500 | |
| ５５　２０年国債 | 140,000,000 | 149,844,800 | |
| ５８　２０年国債 | 200,000,000 | 215,410,000 | |
| ５９　２０年国債 | 45,000,000 | 48,330,000 | |
| ６０　２０年国債 | 10,000,000 | 10,618,000 | |
| ６１　２０年国債 | 100,000,000 | 104,810,000 | |
| ６２　２０年国債 | 95,000,000 | 98,948,200 | |
| ６３　２０年国債 | 130,000,000 | 141,341,200 | |
| ６４　２０年国債 | 90,000,000 | 98,700,300 | |
| ６５　２０年国債 | 175,000,000 | 192,752,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ６６　２０年国債 | 135,000,000 | 148,009,950 | |
| ６７　２０年国債 | 55,000,000 | 60,837,150 | |
| ６８　２０年国債 | 120,000,000 | 134,650,800 | |
| ６９　２０年国債 | 110,000,000 | 122,844,700 | |
| ７０　２０年国債 | 83,000,000 | 94,517,080 | |
| ７１　２０年国債 | 125,000,000 | 140,952,500 | |
| ７２　２０年国債 | 175,000,000 | 197,275,750 | |
| ７３　２０年国債 | 120,000,000 | 135,123,600 | |
| ７４　２０年国債 | 73,000,000 | 82,644,030 | |
| ７５　２０年国債 | 80,000,000 | 90,972,800 | |
| ７６　２０年国債 | 51,000,000 | 57,350,520 | |
| ７７　２０年国債 | 130,000,000 | 147,009,200 | |
| ７８　２０年国債 | 61,000,000 | 68,878,760 | |
| ７９　２０年国債 | 50,000,000 | 56,786,500 | |
| ８０　２０年国債 | 53,000,000 | 60,541,900 | |
| ８１　２０年国債 | 76,000,000 | 86,655,200 | |
| ８２　２０年国債 | 87,000,000 | 99,791,610 | |
| ８３　２０年国債 | 93,000,000 | 107,138,790 | |
| ８５　２０年国債 | 58,000,000 | 67,103,100 | |
| ８６　２０年国債 | 80,000,000 | 93,726,400 | |
| ８７　２０年国債 | 55,000,000 | 64,034,850 | |
| ８８　２０年国債 | 100,000,000 | 117,664,000 | |
| ８９　２０年国債 | 78,000,000 | 91,188,240 | |
| ９０　２０年国債 | 20,000,000 | 23,476,400 | |
| ９１　２０年国債 | 60,000,000 | 70,898,400 | |
| ９２　２０年国債 | 310,000,000 | 362,820,900 | |
| ９３　２０年国債 | 100,000,000 | 116,634,000 | |
| ９４　２０年国債 | 130,000,000 | 152,703,200 | |
| ９５　２０年国債 | 50,000,000 | 59,775,500 | |
| ９６　２０年国債 | 55,000,000 | 64,814,200 | |
| ９７　２０年国債 | 40,000,000 | 47,657,600 | |
| ９８　２０年国債 | 120,000,000 | 141,919,200 | |
| ９９　２０年国債 | 150,000,000 | 178,012,500 | |
| １００　２０年国債 | 155,000,000 | 185,911,650 | |
| １０１　２０年国債 | 75,000,000 | 91,345,500 | |
| １０２　２０年国債 | 80,000,000 | 97,720,000 | |
| １０３　２０年国債 | 170,000,000 | 206,041,700 | |
| １０４　２０年国債 | 10,000,000 | 11,930,400 | |
| １０５　２０年国債 | 126,000,000 | 150,741,360 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| １０６　２０年国債 | 150,000,000 | 180,912,000 | |
| １０７　２０年国債 | 90,000,000 | 108,010,800 | |
| １０８　２０年国債 | 177,000,000 | 208,897,170 | |
| １０９　２０年国債 | 55,000,000 | 65,085,900 | |
| １１０　２０年国債 | 130,000,000 | 156,488,800 | |
| １１１　２０年国債 | 80,000,000 | 97,428,800 | |
| １１２　２０年国債 | 130,000,000 | 156,967,200 | |
| １１３　２０年国債 | 150,000,000 | 181,560,000 | |
| １１４　２０年国債 | 70,000,000 | 84,970,900 | |
| １１５　２０年国債 | 180,000,000 | 220,455,000 | |
| １１６　２０年国債 | 140,000,000 | 171,966,200 | |
| １１７　２０年国債 | 215,000,000 | 261,702,300 | |
| １１８　２０年国債 | 95,000,000 | 114,814,150 | |
| １１９　２０年国債 | 93,000,000 | 110,288,700 | |
| １２０　２０年国債 | 210,000,000 | 244,278,300 | |
| １２１　２０年国債 | 170,000,000 | 204,011,900 | |
| １２２　２０年国債 | 160,000,000 | 190,161,600 | |
| １２３　２０年国債 | 200,000,000 | 245,276,000 | |
| １２４　２０年国債 | 193,000,000 | 234,415,870 | |
| １２５　２０年国債 | 85,000,000 | 105,523,250 | |
| １２６　２０年国債 | 110,000,000 | 133,835,900 | |
| １２７　２０年国債 | 165,000,000 | 198,773,850 | |
| １２８　２０年国債 | 119,000,000 | 143,668,700 | |
| １２９　２０年国債 | 230,000,000 | 274,866,100 | |
| １３０　２０年国債 | 140,000,000 | 167,531,000 | |
| １３１　２０年国債 | 80,000,000 | 94,736,800 | |
| １３２　２０年国債 | 150,000,000 | 177,928,500 | |
| １３３　２０年国債 | 250,000,000 | 299,715,000 | |
| １３４　２０年国債 | 80,000,000 | 96,014,400 | |
| １３５　２０年国債 | 92,000,000 | 109,232,520 | |
| １３６　２０年国債 | 185,000,000 | 217,271,400 | |
| １３７　２０年国債 | 70,000,000 | 83,243,300 | |
| １３８　２０年国債 | 87,000,000 | 101,181,000 | |
| １３９　２０年国債 | 235,000,000 | 276,383,500 | |
| １４０　２０年国債 | 335,000,000 | 398,985,000 | |
| １４１　２０年国債 | 220,000,000 | 262,220,200 | |
| １４２　２０年国債 | 200,000,000 | 241,084,000 | |
| １４３　２０年国債 | 210,000,000 | 247,583,700 | |
| １４４　２０年国債 | 200,000,000 | 233,052,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １４５　２０年国債 | 380,000,000 | 453,826,400 | |
| | １４６　２０年国債 | 230,000,000 | 275,036,300 | |
| | １４７　２０年国債 | 250,000,000 | 295,722,500 | |
| | １４８　２０年国債 | 300,000,000 | 350,589,000 | |
| | １４９　２０年国債 | 252,000,000 | 294,507,360 | |
| | １５０　２０年国債 | 250,000,000 | 288,645,000 | |
| | １５１　２０年国債 | 370,000,000 | 415,572,900 | |
| | １５２　２０年国債 | 350,000,000 | 393,127,000 | |
| | １５３　２０年国債 | 380,000,000 | 432,736,400 | |
| | １５４　２０年国債 | 360,000,000 | 404,056,800 | |
| | １５５　２０年国債 | 275,000,000 | 299,420,000 | |
| | １５６　２０年国債 | 330,000,000 | 326,043,300 | |
| | １５７　２０年国債 | 400,000,000 | 380,948,000 | |
| | １５８　２０年国債 | 100,000,000 | 100,081,000 | |
| | １５９　２０年国債 | 280,000,000 | 284,398,800 | |
| | １６０　２０年国債 | 270,000,000 | 278,348,400 | |
| | １６１　２０年国債 | 320,000,000 | 323,779,200 | |
| | １６２　２０年国債 | 300,000,000 | 302,811,000 | |
| | １６３　２０年国債 | 290,000,000 | 292,247,500 | |
| | １６４　２０年国債 | 400,000,000 | 394,788,000 | |
| | １６５　２０年国債 | 330,000,000 | 325,079,700 | |
| | １６６　２０年国債 | 35,000,000 | 35,714,000 | |
| | ２７　メキシコ国債 | 100,000,000 | 100,659,600 | |
| 国債証券　合計 | | | 67,198,735,300 | |
| 地方債証券 | ６８８　東京都公債 | 100,000,000 | 101,686,500 | |
| | ６９９　東京都公債 | 100,000,000 | 102,847,100 | |
| | ７１３　東京都公債 | 100,000,000 | 102,910,600 | |
| | ７５１　東京都公債 | 100,000,000 | 102,005,000 | |
| | １６　東京都２０年 | 100,000,000 | 117,573,800 | |
| | ２４－１　北海道公債 | 100,000,000 | 103,311,600 | |
| | ２４－６　北海道公債 | 100,000,000 | 103,061,600 | |
| | ３１　神奈川県２０年 | 100,000,000 | 106,831,100 | |
| | ３６１　大阪府公債 | 100,000,000 | 103,200,700 | |
| | ４２０　大阪府公債 | 200,000,000 | 199,836,000 | |
| | ２２－５　京都府公債 | 100,000,000 | 102,588,200 | |
| | ２４－５　京都府公債 | 100,000,000 | 103,081,200 | |
| | ２６－１７　兵庫県公債 | 100,000,000 | 102,277,200 | |
| | ３　兵庫県公債１２年 | 200,000,000 | 205,899,800 | |
| | １９兵庫県公債２０年 | 100,000,000 | 115,088,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ２６－１０　静岡県公債 | 100,000,000 | 102,710,300 | |
| | ２１－５　愛知県公債 | 100,000,000 | 120,885,100 | |
| | ２４－１６　愛知県公債 | 100,000,000 | 103,119,600 | |
| | ２９－５　広島県公債 | 100,000,000 | 100,413,500 | |
| | ４　埼玉県３０年 | 100,000,000 | 110,197,100 | |
| | ２９－１　福岡県公債 | 100,000,000 | 100,295,400 | |
| | １６　千葉県２０年 | 100,000,000 | 115,205,900 | |
| | ９０　共同発行地方 | 100,000,000 | 102,028,700 | |
| | １０８　共同発行地方 | 100,000,000 | 103,337,200 | |
| | １１７　共同発行地方 | 100,000,000 | 102,890,800 | |
| | １２６　共同発行地方 | 100,000,000 | 103,827,400 | |
| | １３１　共同発行地方 | 100,000,000 | 103,306,100 | |
| | ２３－２　島根県公債 | 100,000,000 | 103,057,400 | |
| | ２５－６　大阪市公債 | 200,000,000 | 206,709,800 | |
| | ４７１　名古屋市債 | 100,000,000 | 101,959,800 | |
| | ２１－５　京都市公債 | 100,000,000 | 101,782,100 | |
| | ２０－１　神戸市２０年 | 100,000,000 | 120,317,900 | |
| | ２４－１０　神戸市公債 | 100,000,000 | 103,060,600 | |
| | ２４－３　横浜市公債 | 100,000,000 | 102,918,900 | |
| | ２４－５　札幌市公債 | 100,000,000 | 102,912,700 | |
| | ２３－４　福岡市２０年 | 100,000,000 | 118,610,600 | |
| | ２４－４　福井県公債 | 100,000,000 | 101,971,300 | |
| | ２２－１　岡山県公債 | 100,000,000 | 102,095,900 | |
| 地方債証券　合計 | | | 4,305,812,600 | |
| 特殊債券 | １９　政保政策投資Ｃ | 100,000,000 | 103,044,400 | |
| | ６１　道路機構 | 100,000,000 | 101,889,600 | |
| | ８１　道路機構 | 100,000,000 | 103,058,200 | |
| | ８６　政保道路機構 | 100,000,000 | 118,832,100 | |
| | １１０　政保道路機構 | 100,000,000 | 102,168,100 | |
| | １６８　政保道路機構 | 100,000,000 | 103,225,800 | |
| | １７３　政保道路機構 | 100,000,000 | 103,297,400 | |
| | １７５　政保道路機構 | 100,000,000 | 103,256,700 | |
| | １８６　政保道路機構 | 100,000,000 | 103,044,300 | |
| | １９０　政保道路機構 | 100,000,000 | 102,879,400 | |
| | ２２３　政保道路機構 | 100,000,000 | 114,840,300 | |
| | ２３６　政保道路機構 | 100,000,000 | 102,005,800 | |
| | ２６１　政保道路機構 | 200,000,000 | 205,126,000 | |
| | ２８４　政保道路機構 | 200,000,000 | 186,665,800 | |
| | ３　公営企業１５年 | 100,000,000 | 105,595,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | １３　地方公共団体 | 100,000,000 | 101,969,400 | |
| | ２９　地方公共団体 | 100,000,000 | 102,898,400 | |
| | ３３　地方公共団体 | 100,000,000 | 103,259,600 | |
| | ３９政保地方公共団 | 100,000,000 | 103,125,900 | |
| | Ｆ１４３地方公共団体 | 100,000,000 | 110,078,900 | |
| | １　地方公共団１５年 | 100,000,000 | 110,154,700 | |
| | ４８　地方公共団体 | 100,000,000 | 103,434,700 | |
| | ５１　地方公共団体 | 100,000,000 | 103,756,100 | |
| | ３１　地方公共団２０ | 100,000,000 | 117,488,400 | |
| | １４政保地方公共６ | 100,000,000 | 100,419,900 | |
| | ６５　地方公共団体 | 100,000,000 | 102,700,300 | |
| | ７１　地方公共団体 | 100,000,000 | 102,351,400 | |
| | ２５　日本政策金融 | 100,000,000 | 103,310,900 | |
| | ２５　政保日本政策 | 100,000,000 | 103,630,600 | |
| | １９　利付商工債 | 100,000,000 | 98,303,300 | |
| 特殊債券　合計 | | | 3,325,811,500 | |
| 社債券 | ２０　成田国際空港 | 100,000,000 | 99,504,400 | |
| | １７　シテイグループ・インク | 100,000,000 | 103,327,000 | |
| | ９　ＡＵＳＴ・ＮＺ銀行 | 100,000,000 | 100,282,400 | |
| | ２９　東日本高速道 | 100,000,000 | 100,193,500 | |
| | ６３　中日本高速道 | 100,000,000 | 103,016,600 | |
| | ２１　西日本高速道 | 100,000,000 | 103,403,600 | |
| | １２　アサヒグループＨＤ | 100,000,000 | 100,394,700 | |
| | ５　野村不動産ＨＤ | 100,000,000 | 103,776,900 | |
| | １１　セブンアンドアイ | 100,000,000 | 101,552,200 | |
| | ４　ＪＸホールデイングス | 100,000,000 | 104,148,600 | |
| | １７　パナソニツク | 100,000,000 | 101,133,800 | |
| | １５　デンソー | 100,000,000 | 99,917,100 | |
| | ７　凸版印刷 | 100,000,000 | 107,302,700 | |
| | １　三菱ＵＦＪＦＧ　劣後 | 100,000,000 | 103,423,400 | |
| | ２０　東京三菱銀行 | 100,000,000 | 104,214,800 | |
| | ９三菱ＵＦＪ信託ＢＫ劣 | 100,000,000 | 103,810,500 | |
| | １１三菱ＵＦＪ信託ＢＫ | 100,000,000 | 104,310,900 | |
| | １５　トヨタフアイナンス | 100,000,000 | 103,016,700 | |
| | ７８　トヨタフアイナンス | 100,000,000 | 99,974,600 | |
| | ２　イオンＦＳ | 100,000,000 | 100,459,800 | |
| | １７５　オリックス | 100,000,000 | 104,250,400 | |
| | ４４　野村ホールデイング | 100,000,000 | 101,318,900 | |
| | １８　エヌテイテイ都市開 | 100,000,000 | 106,649,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ７２東日本旅客鉄道 | 100,000,000 | 102,548,400 | |
| | １０７東日本旅客鉄 | 100,000,000 | 110,940,600 | |
| | ４１　東海旅客鉄道 | 100,000,000 | 118,447,500 | |
| | ５０９　関西電力 | 100,000,000 | 100,585,800 | |
| | ３７２　中国電力 | 100,000,000 | 104,149,800 | |
| | ２６０　北陸電力 | 100,000,000 | 103,386,000 | |
| | １１　東京電力パワー | 100,000,000 | 100,817,500 | |
| | ３０　大阪瓦斯 | 100,000,000 | 102,720,800 | |
| | ４　フアーストリテイリング | 100,000,000 | 103,693,000 | |
| 社債券　合計 | | | 3,306,672,600 | |
| 合計 | | | 78,137,032,000 | |

**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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。**

## 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 3,423,469 |
| コール・ローン | 5,223,329 | 6,657,851 |
| 親投資信託受益証券 | 2,164,068,749 | 3,594,657,006 |
| 流動資産合計 | 2,169,292,078 | 3,604,738,326 |
| 資産合計 | 2,169,292,078 | 3,604,738,326 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 1,347,650 | 1,928,754 |
| 未払受託者報酬 | 141,731 | 374,934 |
| 未払委託者報酬 | 1,559,436 | 4,124,775 |
| その他未払費用 | 53,093 | 140,639 |
| 流動負債合計 | 3,101,910 | 6,569,102 |
| 負債合計 | 3,101,910 | 6,569,102 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 2,149,445,185 | ※1 3,649,169,243 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | ※2 16,744,983 | ※2 △ 51,000,019 |
| （分配準備積立金） | 7,012,455 | 5,571,385 |
| 元本等合計 | 2,166,190,168 | 3,598,169,224 |
| 純資産合計 | 2,166,190,168 | 3,598,169,224 |
| 負債純資産合計 | 2,169,292,078 | 3,604,738,326 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | ― | 1 |
| 有価証券売買等損益 | 9,885,781 | △ 52,412,750 |
| 営業収益合計 | 9,885,781 | △ 52,412,749 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 1,200 | 6,009 |
| 受託者報酬 | 189,108 | 646,323 |
| 委託者報酬 | 2,080,863 | 7,110,618 |
| その他費用 | 70,800 | 243,074 |
| 営業費用合計 | 2,341,971 | 8,006,024 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 7,543,810 | △ 60,418,773 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 7,543,810 | △ 60,418,773 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 7,543,810 | △ 60,418,773 |
| 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（△） | 532,517 | △ 7,767,985 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 16,744,983 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 10,184,757 | ― |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 10,184,757 | ― |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 451,067 | 15,094,214 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 451,067 | 2,628,040 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | ― | 12,466,174 |
| 分配金 | ※1 ― | ※1 ― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 16,744,983 | △ 51,000,019 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 2,149,445,185円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,296,791,192円 | 2,190,846,317円 |
| 期中一部解約元本額 | 148,346,007円 | 691,122,259円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 2,149,445,185口 | 3,649,169,243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51,000,019円であります。 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（7,012,455円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,734,422円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は16,746,877円（1万口当たり77.91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（6,330,968円）及び分配準備積立金（5,571,385円）より分配対象額は11,902,353円（1万口当たり32.62円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 9,865,122 | △50,558,145 |
| 合計 | 9,865,122 | △50,558,145 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0078円<br>(10,078円) | 0.9860円<br>(9,860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 | 3,783,849,481 | 3,594,657,006 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 3,594,657,006 | |
| 合計 | | | 3,594,657,006 | |

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**

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 269,693,660 | 525,511,903 |
| 金銭信託 | ― | 674,261,080 |

| | | |
|---|---|---|
| コール・ローン | 1,242,722,792 | 1,311,280,938 |
| 国債証券 | 45,230,726,041 | 79,129,977,347 |
| 派生商品評価勘定 | 301,763,161 | 12,141,994 |
| 未収利息 | 278,779,865 | 483,359,897 |
| 前払費用 | 45,800,853 | 49,374,496 |
| 差入委託証拠金 | 77,655,075 | 108,353,810 |
| 流動資産合計 | 47,447,141,447 | 82,294,261,465 |
| 資産合計 | 47,447,141,447 | 82,294,261,465 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 79,135,668 | 748,935,590 |
| 未払金 | 4,311,285 | 1,141,091 |
| 未払解約金 | ― | 45,595,786 |
| その他未払費用 | ― | 16,916 |
| 流動負債合計 | 83,446,953 | 795,689,383 |
| 負債合計 | 83,446,953 | 795,689,383 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 48,910,853,447 | 85,791,284,610 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △1,547,158,953 | △4,292,712,528 |
| 元本等合計 | 47,363,694,494 | 81,498,572,082 |
| 純資産合計 | 47,363,694,494 | 81,498,572,082 |
| 負債純資産合計 | 47,447,141,447 | 82,294,261,465 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |

| | |
|---|---|
| | 個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1．※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 14,982,462,184円 | 48,910,853,447円 |
| 期中追加設定元本額 | 36,481,106,171円 | 39,808,647,859円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,552,714,908円 | 2,928,216,696円 |

| | | |
|---|---|---|
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） | 46,655,393,282円 | 71,469,694,700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） | 2,234,684,789円 | 3,783,849,481円 |
| ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 20,775,376円 | 10,537,740,429円 |
| 計 | 48,910,853,447円 | 85,791,284,610円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 48,910,853,447口 | 85,791,284,610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1,547,158,953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4,292,712,528円であります。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>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。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 国債証券 | △468,344,243 | △742,384,479 |
| 合計 | △468,344,243 | △742,384,479 |

（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（平成29年6月16日から平成29年11月30日まで、及び平成30年6月16日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．債券関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引<br><br>債券先物取引<br><br>買　建 | 690,728,102 | － | 688,983,319 | △1,744,783 | 596,979,388 | － | 599,006,581 | 2,027,193 |
| 合計 | 690,728,102 | － | 688,983,319 | △1,744,783 | 596,979,388 | － | 599,006,581 | 2,027,193 |

（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 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>(円) | うち<br>1年超 | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円) | うち<br>1年超 | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |
| 市場取引以外の取引<br><br>為替予約取引<br><br>売　建 | 46,131,699,526 | － | 45,907,327,250 | 224,372,276 | 79,259,778,351 | － | 79,998,599,140 | △738,820,789 |
| アメリカ・ドル | 20,135,004,078 | － | 19,883,231,130 | 251,772,948 | 36,767,830,278 | － | 37,037,347,200 | △269,516,922 |
| イギリス・ポンド | 3,222,849,911 | － | 3,214,830,280 | 8,019,631 | 5,294,824,620 | － | 5,328,082,410 | △33,257,790 |
| オーストラリア・ドル | 984,111,157 | － | 960,954,240 | 23,156,917 | 1,668,408,091 | － | 1,735,702,080 | △67,293,989 |
| カナダ・ドル | 985,388,135 | － | 974,835,720 | 10,552,415 | 1,656,659,483 | － | 1,648,943,940 | 7,715,543 |
| シンガポール・ドル | 177,702,352 | － | 177,546,600 | 155,752 | 307,020,183 | － | 312,638,160 | △5,617,977 |
| スイス・フラン | 49,851,430 | － | 49,748,080 | 103,350 | － | － | － | － |
| スウェーデン・クローナ | 186,398,784 | － | 183,680,640 | 2,718,144 | 263,086,950 | － | 266,463,000 | △3,376,050 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| デンマーク・クローネ | 310,114,718 | － | 310,915,520 | △800,802 | 477,522,105 | － | 482,100,810 | △4,578,705 |
| ノルウェー・クローネ | 116,266,058 | － | 113,675,890 | 2,590,168 | 191,485,415 | － | 189,442,520 | 2,042,895 |
| ポーランド・ズロチ | 256,895,315 | － | 260,187,620 | △3,292,305 | 498,256,355 | － | 510,323,160 | △12,066,805 |
| マレーシア・リンギット | 159,231,875 | － | 159,217,300 | 14,575 | 275,906,593 | － | 276,010,980 | △104,387 |
| メキシコ・ペソ | 395,610,937 | － | 403,313,070 | △7,702,133 | 544,056,183 | － | 549,899,480 | △5,843,297 |
| ユーロ | 18,922,811,924 | － | 18,979,877,100 | △57,065,176 | 30,922,775,074 | － | 31,234,173,840 | △311,398,766 |
| 南アフリカ・ランド | 229,462,852 | － | 235,314,060 | △5,851,208 | 391,947,021 | － | 427,471,560 | △35,524,539 |
| 合計 | 46,131,699,526 | － | 45,907,327,250 | 224,372,276 | 79,259,778,351 | － | 79,998,599,140 | △738,820,789 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 0.9684円<br>(9,684円) | 0.9500円<br>(9,500円) |

**附属明細表**

## 第１ 有価証券明細表

### (1) 株式

該当事項はありません。

### (2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115 | 32,370,000.000 | 32,250,878.400 | |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215 | 10,040,000.000 | 10,213,692.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20211115 | 18,946,000.000 | 18,504,747.660 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115 | 7,700,000.000 | 7,345,954.000 | |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231 | 7,950,000.000 | 7,813,657.500 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515 | 11,020,000.000 | 10,505,145.600 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630 | 7,540,000.000 | 7,431,273.200 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815 | 6,310,000.000 | 6,208,409.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115 | 12,905,000.000 | 12,836,345.400 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215 | 5,000,000.000 | 4,966,750.000 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515 | 10,580,000.000 | 10,370,833.400 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630 | 13,990,000.000 | 13,749,511.900 | |
| | | 6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 5,250,000.000 | 6,521,025.000 | |
| | | 5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815 | 1,000,000.000 | 1,205,460.000 | |
| | | 5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 2,700,000.000 | 3,209,193.000 | |
| | | 6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 3,800,000.000 | 4,960,748.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 1,130,000.000 | 1,392,984.900 |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215 | 1,250,000.000 | 1,475,287.500 |
| | | 3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215 | 3,330,000.000 | 3,469,693.500 |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115 | 410,000.000 | 480,241.200 |
| | | 4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215 | 1,350,000.000 | 1,632,865.500 |
| | | 4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 670,000.000 | 825,929.100 |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215 | 2,970,000.000 | 2,884,137.300 |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515 | 9,600,000.000 | 8,880,672.000 |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815 | 1,100,000.000 | 1,156,023.000 |
| | | 3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115 | 2,532,000.000 | 2,715,949.800 |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215 | 1,500,000.000 | 1,576,980.000 |
| | | 3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515 | 2,600,000.000 | 2,624,362.000 |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815 | 3,190,000.000 | 3,081,827.100 |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031 | 17,440,000.000 | 17,249,904.000 |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115 | 11,810,000.000 | 11,382,714.200 |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228 | 15,450,000.000 | 14,927,326.500 |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20450515 | 1,570,000.000 | 1,480,698.400 |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20250815 | 12,320,000.000 | 11,613,448.000 |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930 | 16,720,000.000 | 16,048,524.800 |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115 | 6,900,000.000 | 6,595,365.000 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215 | 2,000,000.000 | 1,827,340.000 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515 | 1,165,000.000 | 1,060,604.350 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515 | 2,070,000.000 | 1,760,141.700 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815 | 2,500,000.000 | 2,247,850.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20261115 | 2,350,000.000 | 2,185,664.500 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115 | 2,480,000.000 | 2,275,201.600 | |
| | | 1% United States Treasury Note/Bond 20191115 | 10,500,000.000 | 10,329,690.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215 | 5,120,000.000 | 4,841,574.400 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315 | 5,500,000.000 | 5,418,545.000 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515 | 3,350,000.000 | 3,194,258.500 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20470515 | 2,250,000.000 | 2,113,582.500 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815 | 1,500,000.000 | 1,412,220.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731 | 3,200,000.000 | 3,069,728.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815 | 6,310,000.000 | 5,633,631.100 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515 | 5,300,000.000 | 5,094,625.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20480815 | 1,500,000.000 | 1,406,940.000 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>323,460,154.510<br>(36,703,023,732) | |
| | イギリス・ポンド | | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド | |
| | | 2% United Kingdom Gilt 20250907 | 750,000.000 | 796,875.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.5% United Kingdom Gilt 20210122 | 1,300,000.000 | 1,321,073.000 | |
| | | 2.5% United Kingdom Gilt 20650722 | 910,000.000 | 1,076,621.000 | |
| | | 1.5% United Kingdom Gilt 20260722 | 525,000.000 | 539,463.750 | |
| | | 0.5% United Kingdom Gilt 20220722 | 250,000.000 | 247,207.500 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20370907 | 420,000.000 | 411,054.000 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20570722 | 1,350,000.000 | 1,283,985.000 | |
| | | 1.25% United Kingdom Gilt 20270722 | 1,850,000.000 | 1,852,571.500 | |
| | | 6% United Kingdom Gilt 20281207 | 863,000.000 | 1,244,618.600 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20320607 | 700,000.000 | 925,680.000 | |
| | | 5% United Kingdom Gilt 20250307 | 675,000.000 | 838,039.500 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20360307 | 1,565,000.000 | 2,131,060.500 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20381207 | 200,000.000 | 295,760.000 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20200307 | 1,090,000.000 | 1,145,045.000 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20551207 | 450,000.000 | 723,195.000 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20461207 | 620,000.000 | 916,298.000 | |
| | | 4.5% United Kingdom Gilt 20421207 | 411,000.000 | 609,554.100 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20301207 | 907,500.000 | 1,235,833.500 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20491207 | 2,093,000.000 | 3,183,662.300 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20390907 | 1,430,000.000 | 2,000,570.000 | |
| | | 4% United Kingdom Gilt 20220307 | 1,040,000.000 | 1,147,577.600 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 4% United Kingdom Gilt 20600122 | 787,000.000 | 1,252,667.900 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20200907 | 810,000.000 | 852,784.200 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20210907 | 742,000.000 | 802,606.560 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20220907 | 1,380,000.000 | 1,426,699.200 | |
| | | 3.25% United Kingdom Gilt 20440122 | 1,425,000.000 | 1,772,700.000 | |
| | | 2.25% United Kingdom Gilt 20230907 | 2,290,000.000 | 2,433,125.000 | |
| | | 3.5% United Kingdom Gilt 20680722 | 748,900.000 | 1,127,918.290 | |
| | | 2.75% United Kingdom Gilt 20240907 | 300,000.000 | 329,625.000 | |
| | | 3.5% United Kingdom Gilt 20450122 | 1,290,000.000 | 1,676,871.000 | |
| | イギリス・ポンド　小計 | | | イギリス・ポンド<br>35,600,742.000<br>(5,162,463,598) | |
| | オーストラリア・ドル | | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | |
| | | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515 | 1,770,000.000 | 1,926,839.700 | |
| | | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415 | 800,000.000 | 826,872.000 | |
| | | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715 | 1,080,000.000 | 1,216,166.400 | |
| | | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421 | 1,383,000.000 | 1,572,567.810 | |
| | | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 1,089,000.000 | 1,270,928.340 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421 | 656,000.000 | 670,294.240 | |
| | | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421 | 920,000.000 | 973,691.200 | |
| | | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421 | 1,200,000.000 | 1,259,952.000 | |
| | | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421 | 859,000.000 | 1,035,567.450 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421 | 998,000.000 | 1,117,560.400 | |
| | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421 | 725,000.000 | 807,954.500 | |
| | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121 | 400,000.000 | 398,052.000 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621 | 684,000.000 | 709,054.920 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121 | 1,300,000.000 | 1,318,447.000 | |
| | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521 | 2,158,000.000 | 2,094,684.280 | |
| | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321 | 475,000.000 | 463,832.750 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121 | 500,000.000 | 506,355.000 | |
| | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121 | 2,300,000.000 | 2,307,176.000 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | オーストラリア・ドル<br>20,475,995.990<br>(1,701,145,747) | |
| カナダ・ドル | | カナダ・ドル | カナダ・ドル | |
| | 2.75% Canada Government International Bond 20641201 | 460,000.000 | 507,283.400 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 907,000.000 | 1,194,147.130 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 450,000.000 | 636,439.500 | |
| | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601 | 848,000.000 | 1,174,946.400 | |
| | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601 | 170,000.000 | 216,095.500 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601 | 5,820,000.000 | 5,935,992.600 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601 | 400,000.000 | 406,860.000 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201 | 1,040,000.000 | 1,260,771.200 | |
| | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601 | 1,238,000.000 | 1,199,386.780 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601 | 230,000.000 | 232,918.700 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201 | 300,000.000 | 321,180.000 | |
| | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601 | 592,000.000 | 591,372.480 | |
| | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601 | 320,000.000 | 302,828.800 | |
| | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901 | 1,959,000.000 | 1,882,971.210 | |
| | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 930,000.000 | 837,437.100 | |
| | 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301 | 1,240,000.000 | 1,173,052.400 | |
| | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301 | 300,000.000 | 294,150.000 | |
| | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301 | 1,000,000.000 | 1,000,300.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | カナダ・ドル<br>19,168,133.200<br>(1,637,341,939) | |
| シンガポール・ドル | | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | |
| | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301 | 203,000.000 | 221,473.000 | |
| | 3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901 | 1,000,000.000 | 1,038,200.000 | |
| | 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901 | 150,000.000 | 156,600.000 | |
| | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901 | 300,000.000 | 311,490.000 | |
| | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601 | 390,000.000 | 392,301.000 | |
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401 | 89,000.000 | 89,267.000 | |
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701 | 200,000.000 | 205,566.000 | |
| | 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901 | 120,000.000 | 130,984.800 | |
| | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601 | 400,000.000 | 403,600.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301 | 330,000.000 | 328,581.000 | |
| | 2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601 | 200,000.000 | 198,000.000 | |
| | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801 | 260,000.000 | 244,779.600 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | シンガポール・ドル<br>3,720,842.400<br>(308,420,626) | |
| スウェーデン・クローナ | | スウェーデン・クローナ | スウェーデン・クローナ | |
| | 5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201 | 2,780,000.000 | 3,084,827.000 | |
| | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330 | 1,920,000.000 | 2,719,257.600 | |
| | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601 | 2,950,000.000 | 3,336,922.000 | |
| | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113 | 4,150,000.000 | 4,468,554.000 | |
| | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512 | 2,020,000.000 | 2,324,373.600 | |
| | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112 | 2,280,000.000 | 2,401,888.800 | |
| | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512 | 2,550,000.000 | 2,611,302.000 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | | スウェーデン・クローナ<br>20,947,125.000<br>(262,048,534) | |
| デンマーク・クローネ | | デンマーク・クローネ | デンマーク・クローネ | |
| | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115 | 5,140,000.000 | 8,841,262.600 | |
| | 4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115 | 2,760,000.000 | 2,883,537.600 | |
| | 3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115 | 2,310,000.000 | 2,551,233.300 | |
| | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115 | 2,670,000.000 | 2,898,952.500 | |
| | 1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115 | 2,330,000.000 | 2,608,807.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115 | 5,200,000.000 | 5,303,272.000 | |
| | 0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115 | 2,200,000.000 | 2,237,664.000 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | | デンマーク・クローネ<br>27,324,729.800<br>(472,991,072) | |
| ノルウェー・クローネ | | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |
| | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525 | 2,620,000.000 | 2,784,247.800 | |
| | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524 | 1,150,000.000 | 1,178,692.500 | |
| | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314 | 1,300,000.000 | 1,397,890.000 | |
| | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313 | 150,000.000 | 151,236.000 | |
| | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219 | 1,430,000.000 | 1,412,897.200 | |
| | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217 | 3,000,000.000 | 2,999,520.000 | |
| | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426 | 4,000,000.000 | 4,061,520.000 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | | ノルウェー・クローネ<br>13,986,003.500<br>(185,734,127) | |
| ポーランド・ズロチ | | ポーランド・ズロチ | ポーランド・ズロチ | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20220923 | 1,200,000.000 | 1,356,480.000 | |
| | 1.5% Poland Government Bond 20200425 | 1,340,000.000 | 1,340,562.800 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20260725 | 640,000.000 | 622,304.000 | |
| | 2% Poland Government Bond 20210425 | 2,000,000.000 | 2,015,600.000 | |
| | 1.75% Poland Government Bond 20210725 | 1,520,000.000 | 1,521,672.000 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20270725 | 1,815,000.000 | 1,742,454.450 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2.25% Poland Government Bond 20220425 | 800,000.000 | 805,440.000 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20230125 | 3,000,000.000 | 3,026,700.000 | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20290425 | 600,000.000 | 740,040.000 | |
| | 4% Poland Government Bond 20231025 | 710,000.000 | 762,291.500 | |
| | 3.25% Poland Government Bond 20250725 | 1,430,000.000 | 1,472,914.300 | |
| ポーランド・ズロチ　小計 | | | ポーランド・ズロチ<br>15,406,459.050<br>(464,350,676) | |
| マレーシア・リンギット | | マレーシア・リンギット | マレーシア・リンギット | |
| | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415 | 1,760,000.000 | 1,777,406.400 | |
| | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315 | 1,250,000.000 | 1,221,787.500 | |
| | 3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331 | 1,050,000.000 | 1,049,737.500 | |
| | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415 | 600,000.000 | 553,326.000 | |
| | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915 | 1,150,000.000 | 1,140,225.000 | |
| | 3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930 | 1,100,000.000 | 1,098,669.000 | |
| | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817 | 600,000.000 | 596,472.000 | |
| | 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315 | 1,420,000.000 | 1,376,590.600 | |
| | 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130 | 400,000.000 | 399,156.000 | |
| | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 1,000,000.000 | 999,090.000 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | | マレーシア・リンギット<br>10,212,460.000<br>(276,859,791) | |
| メキシコ・ペソ | | メキシコ・ペソ | メキシコ・ペソ | |
| | 5% Mexican Bonos 20191211 | 5,400,000.000 | 5,216,940.000 | |
| | 5.75% Mexican Bonos 20260305 | 4,200,000.000 | 3,465,294.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 8% Mexican Bonos 20471107 | 11,450,000.000 | 9,564,414.000 | |
| | | 8% Mexican Bonos 20231207 | 6,740,000.000 | 6,494,192.200 | |
| | | 10% Mexican Bonos 20241205 | 6,340,000.000 | 6,635,380.600 | |
| | | 7.5% Mexican Bonos 20270603 | 4,800,000.000 | 4,343,808.000 | |
| | | 10% Mexican Bonos 20361120 | 2,750,000.000 | 2,832,885.000 | |
| | | 8.5% Mexican Bonos 20290531 | 6,500,000.000 | 6,172,400.000 | |
| | | 8.5% Mexican Bonos 20381118 | 5,000,000.000 | 4,480,650.000 | |
| | | 8% Mexican Bonos 20200611 | 5,500,000.000 | 5,469,310.000 | |
| | | 6.5% Mexican Bonos 20210610 | 13,700,000.000 | 13,063,909.000 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 2,700,000.000 | 2,370,870.000 | |
| | | 6.5% Mexican Bonos 20220609 | 8,900,000.000 | 8,287,502.000 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 4,750,000.000 | 3,899,845.000 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 10,300,000.000 | 8,792,389.000 | |
| | メキシコ・ペソ　小計 | | | メキシコ・ペソ<br>91,089,788.800<br>(511,013,715) | |
| | ユーロ | | ユーロ | ユーロ | |
| | | 0.75% Finland Government Bond 20310415 | 190,000.000 | 188,736.500 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20260415 | 180,000.000 | 182,797.200 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20270915 | 200,000.000 | 200,386.000 | |
| | | 1.125% Finland Government Bond 20340415 | 150,000.000 | 153,517.500 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20280915 | 500,000.000 | 495,170.000 | |
| | | 1.2% Austria Government Bond 20251020 | 840,000.000 | 896,834.400 | |
| | | 0.75% Austria Government Bond 20261020 | 490,000.000 | 504,175.700 | |
| | | 1.5% Austria Government Bond 20470220 | 120,000.000 | 122,514.000 | |
| | | 0.5% Austria Government Bond 20270420 | 400,000.000 | 401,364.000 | |
| | | 0.75% Austria Government Bond 20280220 | 300,000.000 | 305,148.000 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20250622 | 670,000.000 | 692,585.700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1% Belgium Government Bond 20310622 | 1,022,000.000 | 1,015,377.440 | |
| | | 1.9% Belgium Government Bond 20380622 | 610,000.000 | 650,125.800 | |
| | | 1% Belgium Government Bond 20260622 | 595,000.000 | 618,722.650 | |
| | | 1.6% Belgium Government Bond 20470622 | 564,000.000 | 541,338.480 | |
| | | 0.2% Belgium Government Bond 20231022 | 400,000.000 | 404,332.000 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20270622 | 1,730,000.000 | 1,755,967.300 | |
| | | 0.5% Belgium Government Bond 20241022 | 500,000.000 | 509,310.000 | |
| | | 2.25% Belgium Government Bond 20570622 | 310,000.000 | 329,784.200 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20280622 | 680,000.000 | 682,679.200 | |
| | | 1.25% Belgium Government Bond 20330422 | 500,000.000 | 503,105.000 | |
| | | 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704 | 855,000.000 | 1,320,795.450 | |
| | | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104 | 1,696,000.000 | 2,785,323.840 | |
| | | 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104 | 160,000.000 | 255,772.800 | |
| | | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704 | 970,000.000 | 1,565,192.000 | |
| | | 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104 | 890,000.000 | 1,384,047.900 | |
| | | 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704 | 720,000.000 | 1,192,989.600 | |
| | | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704 | 360,000.000 | 641,887.200 | |
| | | 3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704 | 1,500,000.000 | 1,587,990.000 | |
| | | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704 | 806,000.000 | 1,216,415.200 | |
| | | 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904 | 2,655,000.000 | 2,862,196.200 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704 | 1,542,000.000 | 1,665,329.160 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704 | 1,248,000.000 | 1,695,120.960 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215 | 1,150,000.000 | 1,241,586.000 | |
| | | 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815 | 1,460,000.000 | 1,620,220.400 | |
| | | 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215 | 500,000.000 | 552,215.000 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815 | 725,000.000 | 997,114.250 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515 | 990,000.000 | 1,082,664.000 | |
| | | 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815 | 200,000.000 | 213,464.000 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215 | 1,190,000.000 | 1,235,231.900 | |
| | | 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815 | 1,800,000.000 | 1,927,818.000 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215 | 883,000.000 | 914,302.350 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815 | 950,000.000 | 944,841.500 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 1,000,000.000 | 1,009,860.000 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815 | 1,900,000.000 | 1,950,996.000 | |
| | | 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815 | 580,000.000 | 618,755.600 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215 | 450,000.000 | 460,107.000 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815 | 100,000.000 | 99,353.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417 | 1,900,000.000 | 1,917,689.000 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016 | 3,440,000.000 | 3,497,792.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008 | 1,800,000.000 | 1,827,936.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408 | 1,500,000.000 | 1,524,660.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007 | 500,000.000 | 508,065.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414 | 150,000.000 | 152,278.500 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013 | 1,000,000.000 | 1,013,010.000 | |
| | | 6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025 | 2,415,000.000 | 3,371,581.500 | |
| | | 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425 | 1,000,000.000 | 1,485,850.000 | |
| | | 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025 | 1,700,000.000 | 2,761,021.000 | |
| | | 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425 | 1,310,000.000 | 2,024,696.700 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425 | 1,382,000.000 | 2,223,859.120 | |
| | | 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425 | 650,000.000 | 716,124.500 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025 | 1,065,000.000 | 1,572,461.850 | |
| | | 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025 | 1,200,000.000 | 1,457,220.000 | |
| | | 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425 | 1,043,000.000 | 1,665,983.900 | |
| | | 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425 | 3,000,000.000 | 3,171,870.000 | |
| | | 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425 | 1,040,000.000 | 1,287,197.600 | |
| | | 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025 | 4,270,000.000 | 4,519,282.600 | |
| | | 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025 | 3,314,000.000 | 3,668,233.460 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425 | 1,900,000.000 | 2,116,334.000 | |
| | | 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025 | 1,910,000.000 | 2,283,214.000 | |
| | | 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025 | 1,695,000.000 | 1,861,076.100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525 | 1,540,000.000 | 2,108,645.000 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525 | 1,530,000.000 | 1,661,274.000 | |
| | | 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525 | 1,400,000.000 | 1,572,242.000 | |
| | | 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525 | 2,486,000.000 | 2,943,299.700 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125 | 1,060,000.000 | 1,165,395.800 | |
| | | 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525 | 2,100,000.000 | 2,144,331.000 | |
| | | 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525 | 600,000.000 | 607,974.000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525 | 3,000,000.000 | 3,034,260.000 | |
| | | 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125 | 2,570,000.000 | 2,539,545.500 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625 | 1,300,000.000 | 1,389,219.000 | |
| | | 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525 | 1,300,000.000 | 1,406,288.000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325 | 1,200,000.000 | 1,207,752.000 | |
| | | 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525 | 1,300,000.000 | 1,315,067.000 | |
| | | 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525 | 1,400,000.000 | 1,423,870.000 | |
| | | 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125 | 1,150,000.000 | 1,156,796.500 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325 | 1,200,000.000 | 1,198,416.000 | |
| | | 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115 | 580,000.000 | 849,775.400 | |
| | | 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115 | 655,000.000 | 1,003,237.300 | |
| | | 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115 | 1,170,000.000 | 1,368,841.500 | |
| | | 3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715 | 175,000.000 | 186,849.250 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115 | 630,000.000 | 998,638.200 | |
| | | 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715 | 492,000.000 | 541,278.720 | |
| | | 2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715 | 500,000.000 | 548,260.000 | |
| | | 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115 | 590,000.000 | 730,467.200 | |
| | | 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115 | 540,000.000 | 764,202.600 | |
| | | 2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715 | 380,000.000 | 424,045.800 | |
| | | 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115 | 850,000.000 | 859,137.500 | |
| | | 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715 | 690,000.000 | 697,700.400 | |
| | | 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715 | 670,000.000 | 685,135.300 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115 | 420,000.000 | 425,825.400 | |
| | | 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715 | 470,000.000 | 486,182.100 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115 | 1,600,000.000 | 1,609,408.000 | |
| | | 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715 | 600,000.000 | 616,938.000 | |
| | | 7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101 | 1,600,000.000 | 2,087,152.000 | |
| | | 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 2,135,000.000 | 2,697,380.350 | |
| | | 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901 | 705,000.000 | 653,168.400 | |
| | | 1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601 | 920,000.000 | 855,572.400 | |
| | | 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201 | 500,000.000 | 476,175.000 | |
| | | 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915 | 800,000.000 | 785,032.000 | |
| | | 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901 | 750,000.000 | 631,515.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015 | 1,400,000.000 | 1,299,592.000 | |
| | | 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101 | 3,000,000.000 | 2,906,490.000 | |
| | | 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301 | 690,000.000 | 565,875.900 | |
| | | 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901 | 1,300,000.000 | 1,153,867.000 | |
| | | 2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 500,000.000 | 471,205.000 | |
| | | 1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401 | 1,500,000.000 | 1,471,185.000 | |
| | | 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301 | 350,000.000 | 329,633.500 | |
| | | 0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801 | 700,000.000 | 674,436.000 | |
| | | 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201 | 500,000.000 | 460,870.000 | |
| | | 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201 | 2,000,000.000 | 1,936,540.000 | |
| | | 5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101 | 740,000.000 | 874,147.200 | |
| | | 6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501 | 1,288,000.000 | 1,625,636.320 | |
| | | 5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201 | 1,000,000.000 | 1,243,070.000 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801 | 1,050,000.000 | 1,231,104.000 | |
| | | 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201 | 770,000.000 | 812,342.300 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801 | 1,702,000.000 | 1,801,192.560 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801 | 1,640,000.000 | 1,922,670.400 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801 | 2,170,000.000 | 2,409,980.300 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301 | 1,700,000.000 | 1,925,148.000 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901 | 664,000.000 | 776,089.840 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901 | 3,050,000.000 | 3,214,944.000 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301 | 1,850,000.000 | 2,051,150.500 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301 | 1,650,000.000 | 1,744,545.000 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901 | 1,320,000.000 | 1,431,975.600 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301 | 780,000.000 | 857,773.800 | |
| | | 5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101 | 2,770,000.000 | 3,122,454.800 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901 | 1,480,000.000 | 1,689,375.600 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901 | 1,075,000.000 | 1,232,702.500 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301 | 830,000.000 | 911,157.400 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901 | 2,110,000.000 | 2,238,351.300 | |
| | | 3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301 | 370,000.000 | 377,222.400 | |
| | | 2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215 | 700,000.000 | 711,578.000 | |
| | | 5% Belgium Government Bond 20350328 | 200,000.000 | 308,404.000 | |
| | | 4% Belgium Government Bond 20220328 | 550,000.000 | 630,234.000 | |
| | | 3.75% Belgium Government Bond 20200928 | 534,000.000 | 576,319.500 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20410328 | 665,000.000 | 997,746.050 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20210928 | 500,000.000 | 566,660.000 | |
| | | 4.5% Belgium Government Bond 20260328 | 300,000.000 | 388,812.000 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20220928 | 730,000.000 | 856,954.300 | |
| | | 4% Belgium Government Bond 20320328 | 300,000.000 | 408,735.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2.25% Belgium Government Bond 20230622 | 1,000,000.000 | 1,109,180.000 | |
| | | 3.75% Belgium Government Bond 20450622 | 340,000.000 | 488,376.000 | |
| | | 2.6% Belgium Government Bond 20240622 | 800,000.000 | 910,528.000 | |
| | | 3% Belgium Government Bond 20340622 | 300,000.000 | 372,651.000 | |
| | | 5.4% IRISH TREASURY 20250313 | 688,000.000 | 900,550.720 | |
| | | 5% IRISH TREASURY 20201018 | 910,000.000 | 1,004,303.300 | |
| | | 3.9% IRISH TREASURY 20230320 | 420,000.000 | 490,807.800 | |
| | | 3.4% IRISH TREASURY 20240318 | 600,000.000 | 700,728.000 | |
| | | 2.4% IRISH TREASURY 20300515 | 680,000.000 | 772,697.600 | |
| | | 2% IRISH TREASURY 20450218 | 310,000.000 | 323,550.100 | |
| | | 1% IRISH TREASURY 20260515 | 320,000.000 | 329,395.200 | |
| | | 1.7% IRISH TREASURY 20370515 | 170,000.000 | 173,015.800 | |
| | | 1.3% IRISH TREASURY 20330515 | 150,000.000 | 147,717.000 | |
| | | 4.5% IRISH TREASURY 20200418 | 190,000.000 | 203,149.900 | |
| | | 6.25% Austria Government Bond 20270715 | 380,000.000 | 566,872.600 | |
| | | 3.9% Austria Government Bond 20200715 | 480,000.000 | 515,116.800 | |
| | | 3.5% Austria Government Bond 20210915 | 660,000.000 | 733,755.000 | |
| | | 4.15% Austria Government Bond 20370315 | 510,000.000 | 765,453.900 | |
| | | 3.4% Austria Government Bond 20221122 | 860,000.000 | 986,772.600 | |
| | | 3.8% Austria Government Bond 20620126 | 520,000.000 | 893,755.200 | |
| | | 3.15% Austria Government Bond 20440620 | 380,000.000 | 532,148.200 | |
| | | 1.75% Austria Government Bond 20231020 | 680,000.000 | 742,655.200 | |
| | | 2.4% Austria Government Bond 20340523 | 280,000.000 | 335,160.000 | |
| | | 1.65% Austria Government Bond 20241021 | 280,000.000 | 306,502.000 | |
| | | 4% Finland Government Bond 20250704 | 200,000.000 | 250,418.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 3.375% Finland Government Bond 20200415 | 200,000.000 | 210,898.000 | |
| | | 2.75% Finland Government Bond 20280704 | 120,000.000 | 144,696.000 | |
| | | 1.625% Finland Government Bond 20220915 | 980,000.000 | 1,050,599.200 | |
| | | 2.625% Finland Government Bond 20420704 | 210,000.000 | 276,021.900 | |
| | | 2% Finland Government Bond 20240415 | 350,000.000 | 387,905.000 | |
| | | 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131 | 2,320,000.000 | 3,296,604.000 | |
| | | 1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430 | 500,000.000 | 523,455.000 | |
| | | 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730 | 610,000.000 | 623,853.100 | |
| | | 2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031 | 1,865,000.000 | 2,010,731.100 | |
| | | 1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730 | 1,000,000.000 | 1,023,440.000 | |
| | | 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430 | 1,000,000.000 | 1,060,580.000 | |
| | | 0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730 | 1,000,000.000 | 1,021,850.000 | |
| | | 2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031 | 889,000.000 | 936,232.570 | |
| | | 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730 | 480,000.000 | 536,601.600 | |
| | | 1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031 | 1,749,000.000 | 1,764,531.120 | |
| | | 0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430 | 1,250,000.000 | 1,262,675.000 | |
| | | 1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430 | 600,000.000 | 609,396.000 | |
| | | 2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730 | 1,320,000.000 | 1,370,397.600 | |
| | | 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031 | 670,000.000 | 674,696.700 | |
| | | 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430 | 950,000.000 | 946,950.500 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730 | 280,000.000 | 410,628.400 | |
| | | 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131 | 800,000.000 | 1,040,616.000 | |
| | | 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730 | 600,000.000 | 856,464.000 | |
| | | 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730 | 943,000.000 | 1,318,134.830 | |
| | | 4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031 | 1,600,000.000 | 1,754,048.000 | |
| | | 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430 | 724,000.000 | 821,740.000 | |
| | | 5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131 | 1,140,000.000 | 1,348,551.600 | |
| | | 5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131 | 2,310,000.000 | 2,797,548.600 | |
| | | 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031 | 1,588,000.000 | 1,886,861.600 | |
| | | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031 | 1,100,000.000 | 1,468,357.000 | |
| | | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031 | 590,000.000 | 880,728.400 | |
| | | 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430 | 700,000.000 | 816,396.000 | |
| | | 2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031 | 1,384,000.000 | 1,543,713.600 | |
| | ユーロ　小計 | | | ユーロ<br>240,118,623.940<br>(31,020,925,027) | |
| | 南アフリカ・ランド | | 南アフリカ・ランド | 南アフリカ・ランド | |
| | | 7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115 | 1,210,000.000 | 1,223,431.000 | |
| | | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221 | 8,010,000.000 | 8,722,089.000 | |
| | | 6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331 | 1,200,000.000 | 1,189,560.000 | |
| | | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228 | 2,610,000.000 | 1,836,657.000 | |
| | | 7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228 | 2,900,000.000 | 2,853,745.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228 | 15,900,000.000 | 14,298,711.000 | |
| | | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131 | 5,250,000.000 | 4,703,317.500 | |
| | | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131 | 2,850,000.000 | 2,587,800.000 | |
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131 | 2,300,000.000 | 2,069,448.000 | |
| | | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331 | 9,700,000.000 | 8,772,486.000 | |
| | | 9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131 | 3,000,000.000 | 2,785,980.000 | |
| | 南アフリカ・ランド　小計 | | | 南アフリカ・ランド<br>51,043,224.500<br>(423,658,763) | |
| 国債証券　合計 | | | | 79,129,977,347<br>[79,129,977,347] | |
| 合計 | | | | 79,129,977,347<br>[79,129,977,347] | |

（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 | 52銘柄 | 100% | 46.6% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 30銘柄 | 100% | 6.5% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 18銘柄 | 100% | 2.1% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 18銘柄 | 100% | 2.1% |
| 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 | 7銘柄 | 100% | 0.3% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 7銘柄 | 100% | 0.6% |
| 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 | 11銘柄 | 100% | 0.6% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 | 10銘柄 | 100% | 0.3% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 15銘柄 | 100% | 0.6% |
| ユーロ | 国債証券 | 209銘柄 | 100% | 39.2% |
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 | 11銘柄 | 100% | 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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。**

## 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 2,350,704 |
| コール・ローン | 3,483,762 | 4,571,573 |
| 親投資信託受益証券 | 1,405,426,157 | 2,439,965,325 |
| 流動資産合計 | 1,408,909,919 | 2,446,887,602 |
| 資産合計 | 1,408,909,919 | 2,446,887,602 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 931,271 | 1,343,977 |
| 未払受託者報酬 | 92,476 | 249,069 |
| 未払委託者報酬 | 1,063,859 | 2,864,799 |
| その他未払費用 | 34,627 | 93,385 |
| 流動負債合計 | 2,122,233 | 4,551,230 |
| 負債合計 | 2,122,233 | 4,551,230 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 1,342,783,335 | ※1 2,389,228,743 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 64,004,351 | 53,107,629 |
| （分配準備積立金） | 37,544,466 | 30,492,601 |
| 元本等合計 | 1,406,787,686 | 2,442,336,372 |
| 純資産合計 | 1,406,787,686 | 2,442,336,372 |
| 負債純資産合計 | 1,408,909,919 | 2,446,887,602 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 42,184,459 | △ 30,300,121 |
| 営業収益合計 | 42,184,459 | △ 30,300,121 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 719 | 3,861 |
| 受託者報酬 | 123,405 | 428,247 |
| 委託者報酬 | 1,420,100 | 4,925,834 |
| その他費用 | 46,181 | 160,981 |
| 営業費用合計 | 1,590,405 | 5,518,923 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 40,594,054 | △ 35,819,044 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 40,594,054 | △ 35,819,044 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 40,594,054 | △ 35,819,044 |
| 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（△） | 3,050,286 | △ 6,941,906 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | － | 64,004,351 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 27,341,817 | 34,337,355 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 27,341,817 | 34,337,355 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 881,234 | 16,356,939 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 881,234 | 16,356,939 |
| 分配金 | ※1 － | ※1 － |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 64,004,351 | 53,107,629 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 1,342,783,335円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,434,988,289円 | 1,446,419,314円 |
| 期中一部解約元本額 | 93,204,954円 | 399,973,906円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 1,342,783,335口 | 2,389,228,743口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（37,544,466円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,460,929円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は64,005,395円（1万口当たり476.66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（36,308,841円）及び分配準備積立金（30,492,601円）より分配対象額は66,801,442円（1万口当たり279.59円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 41,963,204 | △28,477,146 |
| 合計 | 41,963,204 | △28,477,146 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0477円<br>(10,477円) | 1.0222円<br>(10,222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<br>（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 | 368,899,713 | 491,079,297 | |
| | 外国債券インデックスマザーファンド | 706,169,298 | 1,948,886,028 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 親投資信託受益証券　合計 | | 2,439,965,325 | |
| 合計 | | 2,439,965,325 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 255,916,193 | 535,407,915 |
| 金銭信託 | ― | 434,501,630 |
| コール・ローン | 1,154,879,444 | 845,004,586 |
| 国債証券 | 164,124,972,994 | 166,684,616,502 |
| 派生商品評価勘定 | 1,144,512 | 4,699,833 |
| 未収入金 | 5,179,150 | 61,730,533 |
| 未収利息 | 1,273,446,527 | 1,269,292,926 |
| 前払費用 | 22,548,735 | 31,365,717 |
| 流動資産合計 | 166,838,087,555 | 169,866,619,642 |
| 資産合計 | 166,838,087,555 | 169,866,619,642 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 417,993 | 805,659 |

| | | |
|---|---|---|
| 未払金 | 9,443,661 | 170,363,464 |
| 未払解約金 | 107,164,056 | 115,688,147 |
| その他未払費用 | － | 8,906 |
| 流動負債合計 | 117,025,710 | 286,866,176 |
| 負債合計 | 117,025,710 | 286,866,176 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 59,383,778,765 | 61,445,933,589 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 107,337,283,080 | 108,133,819,877 |
| 元本等合計 | 166,721,061,845 | 169,579,753,466 |
| 純資産合計 | 166,721,061,845 | 169,579,753,466 |
| 負債純資産合計 | 166,838,087,555 | 169,866,619,642 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1．※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 58,821,711,450円 | 59,383,778,765円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,826,898,572円 | 6,447,535,619円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,264,831,257円 | 4,385,380,795円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ外国債券インデックスＶＡ | 938,947,637円 | 694,267,908円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 31,434,341円 | 26,063,629円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 236,831,181円 | 173,213,023円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 64,229,316円 | 53,368,772円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 766,547,584円 | 565,112,790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） | －円 | 2,177,730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） | 248,867,657円 | 365,893,917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） | 525,569,264円 | 1,077,780,230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） | 400,023,699円 | 706,169,298円 | |
| Ｄ－Ｉ'ｓ 外国債券インデックス | 880,097円 | 731,384円 | |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 22,820円 | 27,109円 | |
| ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス | 575,119,716円 | 496,757,292円 | |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 245,604,315円 | 484,130,513円 | |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | －円 | 4,278,927円 | |
| ＤＣダイワ外国債券インデックス | 40,005,557,043円 | 42,443,714,064円 | |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 631,956,912円 | 739,083,378円 | |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 299,143,351円 | 367,446,516円 | |
| ダイワ・ライフ・バランス７０ | 190,473,853円 | 237,136,801円 | |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） | 268,358,922円 | 329,247,490円 | |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース） | 217,548,839円 | 263,447,011円 | |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） | 67,378,321円 | 82,424,940円 | |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 11,337,304円 | 10,493,771円 | |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 17,901,368円 | 18,731,042円 | |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 1,288,876円 | 1,851,074円 | |
| ダイワつみたてインデックス外国債券 | －円 | 1,192,484円 | |
| ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 497,823,550円 | 249,101,467円 | |
| ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 166,073,932円 | 154,628,203円 | |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 6,394,036,947円 | 5,694,073,062円 | |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 359,421,809円 | 17,320,918円 | |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 142,269,988円 | 8,186,659円 | |

| | | |
|---|---|---|
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 353,656,108円 | 328,670,549円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国債券 | 126,558,233円 | 142,930,521円 |
| ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド | 21,849,007円 | 28,480,694円 |
| ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用） | 374,472円 | 27,731,702円 |
| ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス | 5,466,036,292円 | 5,534,667,082円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 34,455,585円 | 35,273,760円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 59,697,716円 | 62,560,835円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 16,502,710円 | 17,567,044円 |
| 計 | 59,383,778,765円 | 61,445,933,589円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 59,383,778,765口 | 61,445,933,589口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>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。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |

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

II 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 国債証券 | △1,109,186,102 | △4,928,875,517 |
| 合計 | △1,109,186,102 | △4,928,875,517 |

（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（平成28年12月1日から平成29年11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>(円) | うち1年超 | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円) | うち1年超 | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売　建 | － | － | － | － | 69,008,100 | － | 69,079,500 | △71,400 |
| マレーシア・リンギット | － | － | － | － | 69,008,100 | － | 69,079,500 | △71,400 |
| 買　建 | 1,028,003,581 | － | 1,028,730,100 | 726,519 | 1,116,303,096 | － | 1,120,268,670 | 3,965,574 |
| アメリカ・ドル | 430,810,849 | － | 431,366,020 | 555,171 | 420,678,874 | － | 421,248,390 | 569,516 |
| イギリス・ポンド | 101,665,514 | － | 101,563,620 | △101,894 | 54,194,703 | － | 54,223,290 | 28,587 |
| オーストラリア・ドル | 11,529,794 | － | 11,515,120 | △14,674 | 24,749,923 | － | 25,413,300 | 663,377 |
| カナダ・ドル | 22,700,658 | － | 22,708,170 | 7,512 | 65,526,746 | － | 65,238,610 | △288,136 |
| シンガポール・ドル | 8,296,250 | － | 8,304,000 | 7,750 | 12,449,089 | － | 12,677,580 | 228,491 |
| デンマーク・クローネ | 21,733,295 | － | 21,769,780 | 36,485 | 28,512,966 | － | 28,786,530 | 273,564 |
| ポーランド・ズロチ | － | － | － | － | 10,559,159 | － | 10,816,670 | 257,511 |
| マレーシア・リンギット | 8,149,680 | － | 8,137,800 | △11,880 | － | － | － | － |
| ユーロ | 423,117,541 | － | 423,365,590 | 248,049 | 499,631,636 | － | 501,864,300 | 2,232,664 |
| 合計 | 1,028,003,581 | － | 1,028,730,100 | 726,519 | 1,185,311,196 | － | 1,189,348,170 | 3,894,174 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.8075円<br>(28,075円) | 2.7598円<br>(27,598円) |

## 附属明細表

### 第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種　類 | 通　貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | | アメリカ・ドル | アメリカ・ドル | |
| | | 3.375% United States Treasury Note/Bond 20191115 | 4,020,000.000 | 4,044,321.000 | |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20200215 | 4,280,000.000 | 4,322,286.400 | |
| | | 3.5% United States Treasury Note/Bond 20200515 | 3,073,000.000 | 3,103,730.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815 | 2,854,000.000 | 2,845,409.460 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115 | 4,509,000.000 | 4,492,406.880 | |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215 | 4,076,000.000 | 4,146,514.800 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515 | 2,551,000.000 | 2,570,030.460 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815 | 2,534,000.000 | 2,487,475.760 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20211115 | 2,153,000.000 | 2,102,856.630 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20220215 | 3,224,000.000 | 3,141,884.720 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515 | 2,459,000.000 | 2,370,623.540 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815 | 2,543,000.000 | 2,433,116.970 | |
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20191031 | 884,000.000 | 872,499.160 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115 | 3,168,000.000 | 3,022,335.360 | |
| | | 1% United States Treasury Note/Bond 20191130 | 1,353,000.000 | 1,329,741.930 | |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20191231 | 1,894,000.000 | 1,861,517.900 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200131 | 1,366,000.000 | 1,344,430.860 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20230215 | 4,350,000.000 | 4,201,143.000 | |
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20200229 | 1,968,000.000 | 1,931,237.760 | |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20200331 | 1,160,000.000 | 1,134,851.200 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515 | 4,685,000.000 | 4,466,116.800 | |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20200430 | 1,451,000.000 | 1,417,772.100 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531 | 2,461,000.000 | 2,410,623.330 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630 | 2,131,000.000 | 2,100,270.980 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20200731 | 2,827,000.000 | 2,789,881.490 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815 | 4,568,000.000 | 4,494,455.200 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831 | 1,993,000.000 | 1,969,482.600 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20200930 | 1,885,000.000 | 1,857,592.100 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031 | 2,345,000.000 | 2,298,264.150 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115 | 5,021,000.000 | 4,994,288.280 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20201130 | 2,501,000.000 | 2,461,334.140 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231 | 2,006,000.000 | 1,988,287.020 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215 | 5,229,000.000 | 5,194,227.150 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131 | 1,647,000.000 | 1,623,052.620 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20210228 | 1,734,000.000 | 1,703,238.840 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331 | 2,821,000.000 | 2,784,609.100 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515 | 3,912,000.000 | 3,834,659.760 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430 | 2,407,000.000 | 2,375,781.210 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20210531 | 2,732,000.000 | 2,677,660.520 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630 | 3,485,000.000 | 3,425,092.850 | |
| | | 8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815 | 642,000.000 | 704,864.640 | |
| | | 8% United States Treasury Note/Bond 20211115 | 2,106,000.000 | 2,413,244.340 | |
| | | 6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815 | 654,000.000 | 751,230.180 | |
| | | 6% United States Treasury Note/Bond 20260215 | 855,000.000 | 1,023,657.300 | |
| | | 6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115 | 630,000.000 | 787,298.400 | |
| | | 6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 709,000.000 | 880,648.900 | |
| | | 5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815 | 700,000.000 | 843,822.000 | |
| | | 5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 738,000.000 | 877,179.420 | |
| | | 5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215 | 473,000.000 | 563,645.720 | |
| | | 6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 964,000.000 | 1,258,463.440 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 991,000.000 | 1,221,635.430 |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215 | 1,626,000.000 | 1,919,053.980 |
| | | 5% United States Treasury Note/Bond 20370515 | 547,000.000 | 687,294.560 |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215 | 548,000.000 | 641,242.200 |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515 | 519,000.000 | 616,919.730 |
| | | 3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215 | 1,249,000.000 | 1,301,395.550 |
| | | 4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515 | 1,121,000.000 | 1,292,030.970 |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815 | 1,060,000.000 | 1,261,315.200 |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115 | 1,210,000.000 | 1,417,297.200 |
| | | 4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215 | 1,710,000.000 | 2,068,296.300 |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 1,478,000.000 | 1,730,752.780 |
| | | 3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 1,591,000.000 | 1,740,156.250 |
| | | 4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115 | 1,469,000.000 | 1,691,861.990 |
| | | 4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 1,754,000.000 | 2,162,208.420 |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 1,365,000.000 | 1,601,090.400 |
| | | 3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815 | 1,367,000.000 | 1,466,955.040 |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115 | 1,450,000.000 | 1,409,443.500 |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215 | 1,623,000.000 | 1,576,079.070 |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20420515 | 1,353,000.000 | 1,284,917.040 |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815 | 1,731,000.000 | 1,570,467.060 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115 | 2,630,000.000 | 2,381,175.700 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215 | 2,326,000.000 | 2,249,660.680 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515 | 3,798,000.000 | 3,513,415.860 | |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815 | 3,064,000.000 | 3,220,049.520 | |
| | | 3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115 | 3,581,000.000 | 3,841,159.650 | |
| | | 3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215 | 3,617,000.000 | 3,802,624.440 | |
| | | 3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515 | 3,657,000.000 | 3,691,266.090 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731 | 2,834,000.000 | 2,791,688.380 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815 | 5,162,000.000 | 5,019,219.080 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815 | 3,329,000.000 | 3,216,113.610 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20210831 | 1,301,000.000 | 1,272,482.080 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930 | 3,625,000.000 | 3,555,581.250 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031 | 3,190,000.000 | 3,155,229.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20211031 | 2,163,000.000 | 2,112,969.810 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115 | 5,921,000.000 | 5,706,778.220 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20441115 | 3,696,000.000 | 3,488,654.400 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130 | 2,886,000.000 | 2,807,529.660 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20191130 | 4,325,000.000 | 4,272,105.250 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231 | 3,169,000.000 | 3,101,405.230 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20191231 | 2,204,000.000 | 2,177,728.320 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20200131 | 3,963,000.000 | 3,894,717.510 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131 | 2,427,000.000 | 2,328,779.310 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20250215 | 5,743,000.000 | 5,439,654.740 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215 | 3,763,000.000 | 3,218,531.530 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200229 | 2,788,000.000 | 2,740,297.320 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228 | 1,809,000.000 | 1,747,801.530 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200331 | 2,792,000.000 | 2,740,515.520 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331 | 2,891,000.000 | 2,791,144.860 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515 | 5,788,000.000 | 5,512,143.920 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20450515 | 3,835,000.000 | 3,616,865.200 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200430 | 2,607,000.000 | 2,555,668.170 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430 | 2,612,000.000 | 2,519,143.400 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531 | 2,826,000.000 | 2,734,352.820 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531 | 3,013,000.000 | 2,955,301.050 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630 | 3,001,000.000 | 2,945,901.640 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630 | 2,821,000.000 | 2,750,898.150 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731 | 3,135,000.000 | 3,074,745.300 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20220731 | 2,179,000.000 | 2,114,131.170 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20250815 | 5,743,000.000 | 5,413,638.950 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815 | 3,573,000.000 | 3,286,016.640 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831 | 2,445,000.000 | 2,359,791.750 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831 | 2,868,000.000 | 2,798,307.600 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930 | 2,472,000.000 | 2,372,724.480 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930 | 2,876,000.000 | 2,803,179.680 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115 | 5,840,000.000 | 5,582,164.000 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031 | 3,116,000.000 | 3,032,740.480 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20451115 | 3,709,000.000 | 3,494,842.340 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031 | 2,558,000.000 | 2,464,863.220 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130 | 3,096,000.000 | 3,024,637.200 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20221130 | 6,287,000.000 | 6,084,621.470 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231 | 3,043,000.000 | 2,978,792.700 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231 | 3,492,000.000 | 3,393,211.320 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131 | 3,126,000.000 | 3,031,469.760 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215 | 5,366,000.000 | 4,902,753.220 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131 | 2,561,000.000 | 2,449,135.520 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215 | 3,428,000.000 | 2,917,536.520 | |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228 | 3,309,000.000 | 3,187,493.520 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228 | 4,262,000.000 | 4,029,550.520 | |
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331 | 3,002,000.000 | 2,897,620.460 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331 | 2,123,000.000 | 2,005,237.190 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515 | 5,029,000.000 | 4,578,351.310 |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430 | 2,450,000.000 | 2,367,680.000 |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430 | 2,070,000.000 | 1,963,912.500 |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515 | 3,423,000.000 | 2,910,611.130 |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531 | 2,700,000.000 | 2,605,905.000 |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531 | 2,500,000.000 | 2,369,325.000 |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630 | 2,500,000.000 | 2,395,700.000 |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630 | 3,000,000.000 | 2,808,270.000 |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815 | 5,600,000.000 | 5,035,184.000 |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815 | 3,480,000.000 | 2,800,286.400 |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831 | 3,700,000.000 | 3,534,055.000 |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731 | 3,700,000.000 | 3,538,680.000 |
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731 | 2,780,000.000 | 2,584,288.000 |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831 | 2,400,000.000 | 2,240,616.000 |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930 | 2,505,000.000 | 2,335,912.500 |
| | | 1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930 | 3,042,000.000 | 2,902,706.820 |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20261115 | 5,500,000.000 | 5,115,385.000 |
| | | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031 | 3,000,000.000 | 2,867,340.000 |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031 | 2,500,000.000 | 2,357,025.000 |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115 | 3,350,000.000 | 3,073,357.000 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1% United States Treasury Note/Bond 20191115 | 1,400,000.000 | 1,377,292.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130 | 2,490,000.000 | 2,403,223.500 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130 | 2,400,000.000 | 2,325,360.000 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20191215 | 1,440,000.000 | 1,419,912.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20211231 | 2,000,000.000 | 1,951,080.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231 | 2,500,000.000 | 2,425,975.000 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200115 | 1,500,000.000 | 1,477,200.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215 | 5,340,000.000 | 5,049,610.800 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131 | 3,010,000.000 | 2,922,047.800 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131 | 2,480,000.000 | 2,405,972.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20470215 | 3,545,000.000 | 3,333,115.350 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200215 | 2,130,000.000 | 2,094,620.700 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228 | 3,010,000.000 | 2,919,910.700 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229 | 2,300,000.000 | 2,214,808.000 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20200315 | 1,900,000.000 | 1,871,861.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331 | 2,550,000.000 | 2,453,967.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331 | 2,900,000.000 | 2,811,173.000 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200415 | 850,000.000 | 835,354.500 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515 | 5,700,000.000 | 5,435,007.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20470515 | 3,500,000.000 | 3,287,795.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430 | 3,000,000.000 | 2,905,770.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20240430 | 3,000,000.000 | 2,865,690.000 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200515 | 4,000,000.000 | 3,926,680.000 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531 | 3,000,000.000 | 2,891,010.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20240531 | 2,000,000.000 | 1,909,060.000 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615 | 2,700,000.000 | 2,647,134.000 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630 | 3,000,000.000 | 2,888,670.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20240630 | 2,400,000.000 | 2,290,104.000 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715 | 2,000,000.000 | 1,958,660.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815 | 5,900,000.000 | 5,554,732.000 | |
| | | 1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815 | 1,300,000.000 | 1,272,011.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731 | 2,900,000.000 | 2,801,661.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731 | 3,000,000.000 | 2,877,870.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815 | 3,800,000.000 | 3,392,678.000 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831 | 3,200,000.000 | 3,060,480.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831 | 2,000,000.000 | 1,892,180.000 | |
| | | 1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915 | 2,500,000.000 | 2,438,375.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930 | 2,500,000.000 | 2,411,325.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930 | 3,400,000.000 | 3,257,064.000 | |
| | | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015 | 1,000,000.000 | 978,390.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20221031 | 2,500,000.000 | 2,421,075.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 5,500,000.000 | 5,166,975.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115 | 3,100,000.000 | 2,764,797.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031 | 3,500,000.000 | 3,374,210.000 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115 | 3,600,000.000 | 3,526,992.000 | |
| | | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20191130 | 2,800,000.000 | 2,772,532.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215 | 2,000,000.000 | 1,963,660.000 | |
| | | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130 | 3,200,000.000 | 3,060,224.000 | |
| | | 1.875% United States Treasury Note/Bond 20191231 | 1,000,000.000 | 990,660.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231 | 1,300,000.000 | 1,251,445.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20210115 | 2,300,000.000 | 2,261,452.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20200131 | 2,300,000.000 | 2,280,128.000 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131 | 3,500,000.000 | 3,433,815.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215 | 6,300,000.000 | 6,158,691.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20200229 | 1,800,000.000 | 1,788,534.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215 | 2,500,000.000 | 2,469,625.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228 | 3,300,000.000 | 3,269,805.000 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131 | 2,600,000.000 | 2,538,250.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228 | 2,700,000.000 | 2,673,189.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20480215 | 3,600,000.000 | 3,376,944.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315 | 3,200,000.000 | 3,168,352.000 | |
| | | 2.25% United States Treasury Note/Bond 20200331 | 1,500,000.000 | 1,489,380.000 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331 | 2,900,000.000 | 2,857,834.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331 | 2,900,000.000 | 2,849,018.000 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415 | 2,500,000.000 | 2,474,300.000 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515 | 3,900,000.000 | 3,748,875.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515 | 5,500,000.000 | 5,428,225.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515 | 3,000,000.000 | 2,985,810.000 | |
| | | 2.375% United States Treasury Note/Bond 20200430 | 1,200,000.000 | 1,193,004.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430 | 2,500,000.000 | 2,489,050.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430 | 1,900,000.000 | 1,893,616.000 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531 | 1,400,000.000 | 1,393,756.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531 | 1,900,000.000 | 1,892,875.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531 | 2,500,000.000 | 2,489,250.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615 | 5,000,000.000 | 4,975,150.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630 | 2,500,000.000 | 2,475,000.000 | |
| | | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630 | 3,300,000.000 | 3,284,127.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630 | 3,000,000.000 | 2,966,700.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715 | 3,300,000.000 | 3,282,840.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731 | 3,300,000.000 | 3,289,803.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731 | 2,500,000.000 | 2,487,875.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815 | 6,000,000.000 | 5,918,400.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20480815 | 4,200,000.000 | 3,939,432.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815 | 2,500,000.000 | 2,494,425.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731 | 2,500,000.000 | 2,490,425.000 | |
| | | 2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831 | 2,500,000.000 | 2,491,875.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831 | 3,600,000.000 | 3,583,656.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831 | 3,600,000.000 | 3,557,520.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915 | 3,500,000.000 | 3,491,915.000 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930 | 3,300,000.000 | 3,295,974.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20250930 | 2,500,000.000 | 2,509,375.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930 | 3,000,000.000 | 3,001,380.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015 | 3,000,000.000 | 3,002,910.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20251031 | 2,500,000.000 | 2,509,375.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031 | 3,300,000.000 | 3,303,201.000 | |
| | | 2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031 | 3,000,000.000 | 3,001,860.000 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>675,826,314.960<br>(76,686,011,959) | |
| | イギリス・ポンド | | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド | |
| | | 2% United Kingdom Gilt 20200722 | 2,280,000.000 | 2,327,196.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2% United Kingdom Gilt 20250907 | 1,821,000.000 | 1,934,812.500 | |
| | | 1.5% United Kingdom Gilt 20210122 | 2,477,000.000 | 2,517,152.170 | |
| | | 2.5% United Kingdom Gilt 20650722 | 1,582,000.000 | 1,871,664.200 | |
| | | 1.5% United Kingdom Gilt 20260722 | 1,465,000.000 | 1,505,360.750 | |
| | | 0.5% United Kingdom Gilt 20220722 | 1,300,000.000 | 1,285,479.000 | |
| | | 1.5% United Kingdom Gilt 20470722 | 1,210,000.000 | 1,077,021.000 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20370907 | 800,000.000 | 782,960.000 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20570722 | 1,330,000.000 | 1,264,963.000 | |
| | | 1.25% United Kingdom Gilt 20270722 | 2,110,000.000 | 2,112,932.900 | |
| | | 0.75% United Kingdom Gilt 20230722 | 1,500,000.000 | 1,488,600.000 | |
| | | 1.625% United Kingdom Gilt 20281022 | 1,200,000.000 | 1,231,404.000 | |
| | | 1.625% United Kingdom Gilt 20711022 | 930,000.000 | 844,440.000 | |
| | | 1% United Kingdom Gilt 20240422 | 200,000.000 | 200,030.000 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20490122 | 70,000.000 | 65,877.000 | |
| | | 8% United Kingdom Gilt 20210607 | 1,102,000.000 | 1,302,167.280 | |
| | | 6% United Kingdom Gilt 20281207 | 949,000.000 | 1,368,647.800 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20320607 | 1,340,000.000 | 1,772,016.000 | |
| | | 5% United Kingdom Gilt 20250307 | 1,472,000.000 | 1,827,546.880 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20360307 | 2,032,000.000 | 2,766,974.400 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20381207 | 1,457,000.000 | 2,154,611.600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20200307 | 1,724,000.000 | 1,811,062.000 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20551207 | 1,708,000.000 | 2,744,926.800 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20461207 | 2,086,000.000 | 3,082,899.400 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20271207 | 1,232,000.000 | 1,552,800.480 | |
| | | 4.5% United Kingdom Gilt 20421207 | 1,596,000.000 | 2,367,027.600 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20301207 | 1,480,000.000 | 2,015,464.000 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20491207 | 1,523,000.000 | 2,316,635.300 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20390907 | 1,246,000.000 | 1,743,154.000 | |
| | | 4% United Kingdom Gilt 20220307 | 1,382,000.000 | 1,524,954.080 | |
| | | 4.5% United Kingdom Gilt 20340907 | 1,620,000.000 | 2,238,354.000 | |
| | | 4% United Kingdom Gilt 20600122 | 1,244,000.000 | 1,980,074.800 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20200907 | 1,795,000.000 | 1,889,811.900 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20401207 | 1,577,000.000 | 2,227,670.200 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20210907 | 803,000.000 | 868,589.040 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20520722 | 1,352,000.000 | 1,945,933.600 | |
| | | 1.75% United Kingdom Gilt 20220907 | 2,242,000.000 | 2,317,869.280 | |
| | | 3.25% United Kingdom Gilt 20440122 | 1,966,000.000 | 2,445,704.000 | |
| | | 2.25% United Kingdom Gilt 20230907 | 1,942,000.000 | 2,063,375.000 | |
| | | 3.5% United Kingdom Gilt 20680722 | 1,621,000.000 | 2,441,388.100 | |
| | | 2.75% United Kingdom Gilt 20240907 | 1,392,000.000 | 1,529,460.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 3.5% United Kingdom Gilt 20450122 | 2,124,000.000 | 2,760,987.600 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | イギリス・ポンド<br>75,569,997.660<br>(10,958,405,361) | |
| オーストラリア・ドル | | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル | |
| | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515 | 2,420,000.000 | 2,634,436.200 | |
| | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415 | 2,409,000.000 | 2,489,918.310 | |
| | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715 | 2,162,000.000 | 2,434,584.960 | |
| | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421 | 2,068,000.000 | 2,351,460.760 | |
| | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 2,589,000.000 | 3,021,518.340 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421 | 2,473,000.000 | 2,526,886.670 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421 | 2,074,000.000 | 2,195,038.640 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421 | 2,398,000.000 | 2,517,804.080 | |
| | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421 | 1,358,000.000 | 1,637,136.900 | |
| | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421 | 2,848,000.000 | 3,189,190.400 | |
| | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421 | 1,113,000.000 | 1,240,349.460 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621 | 557,000.000 | 547,180.090 | |
| | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121 | 2,195,000.000 | 2,184,310.350 | |
| | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621 | 712,000.000 | 738,080.560 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121 | 2,522,000.000 | 2,557,787.180 | |
| | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521 | 2,078,000.000 | 2,017,031.480 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321 | 1,132,000.000 | 1,105,386.680 | |
| | 2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221 | 1,800,000.000 | 1,795,842.000 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121 | 2,200,000.000 | 2,227,962.000 | |
| | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121 | 750,000.000 | 752,340.000 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121 | 1,500,000.000 | 1,517,955.000 | |
| | 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521 | 600,000.000 | 591,402.000 | |
| | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521 | 290,000.000 | 275,259.300 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | オーストラリア・ドル<br>42,548,861.360<br>(3,534,959,402) | |
| カナダ・ドル | | カナダ・ドル | カナダ・ドル | |
| | 2.75% Canada Government International Bond 20641201 | 425,000.000 | 468,685.750 | |
| | 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 386,000.000 | 555,091.160 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 983,000.000 | 1,294,207.970 | |
| | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 1,127,000.000 | 1,593,927.370 | |
| | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601 | 1,112,000.000 | 1,540,731.600 | |
| | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601 | 1,363,000.000 | 1,732,577.450 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601 | 1,876,000.000 | 1,913,388.680 | |
| | 3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601 | 956,000.000 | 979,938.240 | |
| | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601 | 1,751,000.000 | 1,781,029.650 | |
| | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201 | 1,561,000.000 | 1,892,369.080 | |
| | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601 | 1,253,000.000 | 1,213,918.930 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601 | 1,405,000.000 | 1,422,829.450 |
| | | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201 | 1,197,000.000 | 1,281,508.200 |
| | | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601 | 1,156,000.000 | 1,154,774.640 |
| | | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200301 | 1,719,000.000 | 1,706,210.640 |
| | | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901 | 1,831,000.000 | 1,786,579.940 |
| | | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601 | 1,129,000.000 | 1,068,417.860 |
| | | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301 | 1,237,000.000 | 1,197,811.840 |
| | | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901 | 1,480,000.000 | 1,422,561.200 |
| | | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 1,240,000.000 | 1,116,582.800 |
| | | 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301 | 840,000.000 | 794,648.400 |
| | | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901 | 1,400,000.000 | 1,338,414.000 |
| | | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20191101 | 500,000.000 | 496,420.000 |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601 | 1,200,000.000 | 1,168,860.000 |
| | | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301 | 1,600,000.000 | 1,568,800.000 |
| | | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200201 | 1,600,000.000 | 1,584,672.000 |
| | | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200501 | 700,000.000 | 696,255.000 |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901 | 600,000.000 | 593,610.000 |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201 | 300,000.000 | 272,016.000 |
| | | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801 | 300,000.000 | 297,930.000 |
| | | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 300,000.000 | 298,131.000 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101 | 2,200,000.000 | 2,192,190.000 | |
| | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301 | 600,000.000 | 600,180.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | カナダ・ドル<br>39,025,268.850<br>(3,333,538,465) | |
| シンガポール・ドル | | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル | |
| | 3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901 | 696,000.000 | 710,762.160 | |
| | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301 | 772,000.000 | 842,252.000 | |
| | 3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901 | 438,000.000 | 454,731.600 | |
| | 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901 | 623,000.000 | 650,412.000 | |
| | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901 | 359,000.000 | 372,749.700 | |
| | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601 | 495,000.000 | 497,920.500 | |
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401 | 400,000.000 | 401,200.000 | |
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701 | 491,000.000 | 504,664.530 | |
| | 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901 | 368,000.000 | 401,686.720 | |
| | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701 | 125,000.000 | 130,187.500 | |
| | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601 | 524,000.000 | 528,716.000 | |
| | 2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701 | 224,000.000 | 223,997.760 | |
| | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301 | 568,000.000 | 565,557.600 | |
| | 2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601 | 250,000.000 | 247,500.000 | |
| | 1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001 | 460,000.000 | 450,432.000 | |
| | 1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401 | 200,000.000 | 198,200.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801 | 150,000.000 | 141,219.000 | |
| | 1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201 | 200,000.000 | 197,580.000 | |
| | 2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501 | 300,000.000 | 306,930.000 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | シンガポール・ドル<br>7,826,699.070<br>(648,755,086) | |
| スウェーデン・クローナ | | スウェーデン・クローナ | スウェーデン・クローナ | |
| | 5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201 | 9,095,000.000 | 10,092,266.750 | |
| | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330 | 4,155,000.000 | 5,884,643.400 | |
| | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601 | 8,465,000.000 | 9,575,269.400 | |
| | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113 | 7,025,000.000 | 7,564,239.000 | |
| | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512 | 5,095,000.000 | 5,862,714.600 | |
| | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112 | 5,680,000.000 | 5,983,652.800 | |
| | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512 | 4,550,000.000 | 4,659,382.000 | |
| スウェーデン・クローナ　小計 | | | スウェーデン・クローナ<br>49,622,167.950<br>(620,773,321) | |
| デンマーク・クローネ | | デンマーク・クローネ | デンマーク・クローネ | |
| | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115 | 11,512,000.000 | 19,801,676.080 | |
| | 4% DANISH GOVERNMENT BOND 20191115 | 8,601,000.000 | 8,985,980.760 | |
| | 3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115 | 5,550,000.000 | 6,129,586.500 | |
| | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115 | 4,846,000.000 | 5,261,544.500 | |
| | 1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115 | 8,363,000.000 | 9,363,716.580 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115 | 6,900,000.000 | 7,037,034.000 | |
| | 0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115 | 1,500,000.000 | 1,525,680.000 | |
| デンマーク・クローネ　小計 | | | デンマーク・クローネ<br>58,105,218.420<br>(1,005,801,331) | |
| ノルウェー・クローネ | | ノルウェー・クローネ | ノルウェー・クローネ | |
| | 3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525 | 6,998,000.000 | 7,436,704.620 | |
| | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524 | 5,204,000.000 | 5,333,839.800 | |
| | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314 | 4,095,000.000 | 4,403,353.500 | |
| | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313 | 3,395,000.000 | 3,422,974.800 | |
| | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219 | 3,340,000.000 | 3,300,053.600 | |
| | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217 | 3,450,000.000 | 3,449,448.000 | |
| | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426 | 2,400,000.000 | 2,436,912.000 | |
| ノルウェー・クローネ　小計 | | | ノルウェー・クローネ<br>29,783,286.320<br>(395,522,042) | |
| ポーランド・ズロチ | | ポーランド・ズロチ | ポーランド・ズロチ | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20220923 | 2,309,000.000 | 2,610,093.600 | |
| | 1.5% Poland Government Bond 20200425 | 2,478,000.000 | 2,479,040.760 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20260725 | 3,377,000.000 | 3,283,625.950 | |
| | 2% Poland Government Bond 20210425 | 2,127,000.000 | 2,143,590.600 | |
| | 1.75% Poland Government Bond 20210725 | 3,051,000.000 | 3,054,356.100 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20270725 | 2,370,000.000 | 2,275,271.100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 2.25% Poland Government Bond 20220425 | 2,320,000.000 | 2,335,776.000 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20230125 | 2,150,000.000 | 2,169,135.000 | |
| | Poland Government Bond 20200725 | 300,000.000 | 292,980.000 | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20290425 | 827,000.000 | 1,020,021.800 | |
| | 5.25% Poland Government Bond 20201025 | 2,256,000.000 | 2,412,115.200 | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20211025 | 1,084,000.000 | 1,203,077.400 | |
| | 4% Poland Government Bond 20231025 | 2,225,000.000 | 2,388,871.250 | |
| | 2.75% Poland Government Bond 20280425 | 1,800,000.000 | 1,749,870.000 | |
| | 3.25% Poland Government Bond 20250725 | 2,591,000.000 | 2,668,755.910 | |
| ポーランド・ズロチ　小計 | | | ポーランド・ズロチ<br>32,086,580.670<br>(967,089,541) | |
| マレーシア・リンギット | | マレーシア・リンギット | マレーシア・リンギット | |
| | 3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531 | 573,000.000 | 544,768.290 | |
| | 5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915 | 738,000.000 | 794,589.840 | |
| | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415 | 1,178,000.000 | 1,189,650.420 | |
| | 4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715 | 1,916,000.000 | 1,940,237.400 | |
| | 4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415 | 1,514,000.000 | 1,538,632.780 | |
| | 4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630 | 1,300,000.000 | 1,270,594.000 | |
| | 3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815 | 875,000.000 | 863,441.250 | |
| | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315 | 731,000.000 | 714,501.330 | |
| | 4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415 | 618,000.000 | 593,718.780 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331 | 1,044,000.000 | 1,043,739.000 | |
| | | 3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315 | 1,001,000.000 | 983,432.450 | |
| | | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415 | 927,000.000 | 854,888.670 | |
| | | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615 | 586,000.000 | 567,119.080 | |
| | | 3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731 | 656,000.000 | 659,778.560 | |
| | | 4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930 | 600,000.000 | 598,218.000 | |
| | | 4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715 | 1,057,000.000 | 1,064,198.170 | |
| | | 4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930 | 857,000.000 | 865,381.460 | |
| | | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915 | 737,000.000 | 730,735.500 | |
| | | 3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015 | 700,000.000 | 701,498.000 | |
| | | 3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930 | 1,161,000.000 | 1,159,595.190 | |
| | | 4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531 | 820,000.000 | 775,793.800 | |
| | | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817 | 702,000.000 | 697,872.240 | |
| | | 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315 | 930,000.000 | 901,569.900 | |
| | | 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130 | 650,000.000 | 638,254.500 | |
| | | 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130 | 352,000.000 | 351,257.280 | |
| | | 3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310 | 500,000.000 | 502,115.000 | |
| | | 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930 | 750,000.000 | 751,380.000 | |
| | | 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116 | 590,000.000 | 576,589.300 | |
| | | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 1,050,000.000 | 1,049,044.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314 | 1,200,000.000 | 1,188,192.000 | |
| | 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420 | 500,000.000 | 497,620.000 | |
| | 4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107 | 700,000.000 | 707,658.000 | |
| | 4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608 | 400,000.000 | 406,452.000 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | | マレーシア・リンギット<br>27,722,516.690<br>(751,557,427) | |
| メキシコ・ペソ | | メキシコ・ペソ | メキシコ・ペソ | |
| | 5% Mexican Bonos 20191211 | 21,447,000.000 | 20,719,946.700 | |
| | 5.75% Mexican Bonos 20260305 | 13,290,000.000 | 10,965,180.300 | |
| | 8% Mexican Bonos 20471107 | 7,000,000.000 | 5,847,240.000 | |
| | 7.25% Mexican Bonos 20211209 | 10,000,000.000 | 9,615,800.000 | |
| | 8% Mexican Bonos 20231207 | 13,133,000.000 | 12,654,039.490 | |
| | 10% Mexican Bonos 20241205 | 22,119,000.000 | 23,149,524.210 | |
| | 7.5% Mexican Bonos 20270603 | 22,668,000.000 | 20,513,633.280 | |
| | 10% Mexican Bonos 20361120 | 8,874,000.000 | 9,141,462.360 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20290531 | 8,844,000.000 | 8,398,262.400 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20381118 | 9,694,000.000 | 8,687,084.220 | |
| | 8% Mexican Bonos 20200611 | 18,928,000.000 | 18,822,381.760 | |
| | 6.5% Mexican Bonos 20210610 | 27,826,000.000 | 26,534,038.820 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 13,015,000.000 | 11,428,471.500 | |
| | 6.5% Mexican Bonos 20220609 | 24,599,000.000 | 22,906,096.820 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 18,654,000.000 | 15,315,307.080 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 6,944,000.000 | 5,927,606.720 | |
| メキシコ・ペソ　小計 | | | メキシコ・ペソ<br>230,626,075.660<br>(1,293,812,284) | |
| ユーロ | | ユーロ | ユーロ | |
| | 0.375% Finland Government Bond 20200915 | 432,000.000 | 439,236.000 | |
| | 0.75% Finland Government Bond 20310415 | 414,000.000 | 411,246.900 | |
| | 0.875% Finland Government Bond 20250915 | 279,000.000 | 292,009.770 | |
| | 0.5% Finland Government Bond 20260415 | 411,000.000 | 417,386.940 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | Finland Government Bond 20230915 | 200,000.000 | 200,938.000 | |
| | | Finland Government Bond 20220415 | 770,000.000 | 778,554.700 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20270915 | 300,000.000 | 300,579.000 | |
| | | 1.125% Finland Government Bond 20340415 | 370,000.000 | 378,676.500 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20280915 | 500,000.000 | 495,170.000 | |
| | | 1.2% Austria Government Bond 20251020 | 873,000.000 | 932,067.180 | |
| | | 0.75% Austria Government Bond 20261020 | 1,126,000.000 | 1,158,575.180 | |
| | | 1.5% Austria Government Bond 20470220 | 734,000.000 | 749,377.300 | |
| | | 1.5% Austria Government Bond 20861102 | 150,000.000 | 137,848.500 | |
| | | Austria Government Bond 20230715 | 900,000.000 | 905,580.000 | |
| | | 0.5% Austria Government Bond 20270420 | 580,000.000 | 581,977.800 | |
| | | 2.1% Austria Government Bond 21170920 | 340,000.000 | 381,327.000 | |
| | | Austria Government Bond 20220920 | 400,000.000 | 404,240.000 | |
| | | 0.75% Austria Government Bond 20280220 | 1,000,000.000 | 1,017,160.000 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20250622 | 1,399,000.000 | 1,446,160.290 | |
| | | 1% Belgium Government Bond 20310622 | 924,000.000 | 918,012.480 | |
| | | 1.9% Belgium Government Bond 20380622 | 558,000.000 | 594,705.240 | |
| | | 1% Belgium Government Bond 20260622 | 1,283,000.000 | 1,334,153.210 | |
| | | 1.6% Belgium Government Bond 20470622 | 944,000.000 | 906,070.080 | |
| | | 2.15% Belgium Government Bond 20660622 | 340,000.000 | 346,368.200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 0.2% Belgium Government Bond 20231022 | 490,000.000 | 495,306.700 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20270622 | 1,400,000.000 | 1,421,014.000 | |
| | | 0.5% Belgium Government Bond 20241022 | 650,000.000 | 662,103.000 | |
| | | 2.25% Belgium Government Bond 20570622 | 460,000.000 | 489,357.200 | |
| | | 1.45% Belgium Government Bond 20370622 | 300,000.000 | 298,542.000 | |
| | | 0.8% Belgium Government Bond 20280622 | 940,000.000 | 943,703.600 | |
| | | 1.25% Belgium Government Bond 20330422 | 550,000.000 | 553,415.500 | |
| | | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104 | 974,000.000 | 1,298,624.460 | |
| | | 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704 | 1,367,000.000 | 2,111,727.930 | |
| | | 5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104 | 1,362,000.000 | 2,029,339.140 | |
| | | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704 | 1,250,000.000 | 1,783,287.500 | |
| | | 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104 | 951,000.000 | 1,561,817.790 | |
| | | 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104 | 1,448,000.000 | 2,314,743.840 | |
| | | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704 | 1,775,000.000 | 2,864,140.000 | |
| | | 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104 | 2,071,000.000 | 3,220,632.810 | |
| | | 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704 | 1,225,000.000 | 2,029,739.250 | |
| | | 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704 | 1,399,000.000 | 2,494,444.980 | |
| | | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200104 | 2,075,000.000 | 2,165,760.500 | |
| | | 3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704 | 1,928,000.000 | 2,041,096.480 | |
| | | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704 | 1,474,000.000 | 2,224,560.800 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904 | 1,444,000.000 | 1,518,452.640 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104 | 2,333,000.000 | 2,487,117.980 | |
| | | 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704 | 1,674,000.000 | 1,841,215.860 | |
| | | 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904 | 1,415,000.000 | 1,525,426.600 | |
| | | 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104 | 2,807,000.000 | 3,027,321.430 | |
| | | 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704 | 2,222,000.000 | 2,399,715.560 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704 | 2,038,000.000 | 2,768,154.260 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904 | 1,644,000.000 | 1,764,669.600 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215 | 1,410,000.000 | 1,522,292.400 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515 | 1,817,000.000 | 1,967,629.300 | |
| | | 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815 | 1,599,000.000 | 1,774,474.260 | |
| | | 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215 | 1,561,000.000 | 1,724,015.230 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815 | 2,409,000.000 | 3,313,169.970 | |
| | | 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515 | 1,594,000.000 | 1,743,198.400 | |
| | | 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815 | 1,542,000.000 | 1,645,807.440 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215 | 2,194,000.000 | 2,277,393.940 | |
| | | 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815 | 2,134,000.000 | 2,285,535.340 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215 | 2,168,000.000 | 2,244,855.600 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815 | 2,850,000.000 | 2,834,524.500 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 1,600,000.000 | 1,615,776.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815 | 2,300,000.000 | 2,361,732.000 | |
| | | 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815 | 800,000.000 | 853,456.000 | |
| | | 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215 | 1,200,000.000 | 1,226,952.000 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815 | 1,200,000.000 | 1,192,236.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20191213 | 1,000,000.000 | 1,006,930.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20200313 | 700,000.000 | 705,957.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612 | 800,000.000 | 808,232.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911 | 350,000.000 | 353,986.500 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20200417 | 1,731,000.000 | 1,747,115.610 | |
| | | 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016 | 1,448,000.000 | 1,472,326.400 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409 | 1,578,000.000 | 1,600,407.600 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008 | 1,400,000.000 | 1,421,728.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408 | 360,000.000 | 365,918.400 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007 | 2,100,000.000 | 2,133,873.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414 | 500,000.000 | 507,595.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013 | 900,000.000 | 911,709.000 | |
| | | 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425 | 985,000.000 | 1,362,649.000 | |
| | | 6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025 | 3,025,000.000 | 4,223,202.500 | |
| | | 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425 | 3,023,000.000 | 4,491,724.550 | |
| | | 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025 | 2,807,000.000 | 4,558,932.910 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425 | 2,209,000.000 | 3,414,164.130 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425 | 1,364,000.000 | 2,194,894.240 | |
| | | 3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425 | 3,230,000.000 | 3,558,587.900 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025 | 2,624,000.000 | 3,874,309.760 | |
| | | 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025 | 3,697,000.000 | 4,489,451.950 | |
| | | 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425 | 3,084,000.000 | 4,926,073.200 | |
| | | 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20200425 | 3,380,000.000 | 3,573,640.200 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425 | 1,167,000.000 | 1,923,414.390 | |
| | | 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425 | 3,146,000.000 | 3,893,772.740 | |
| | | 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025 | 3,113,000.000 | 3,294,736.940 | |
| | | 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025 | 3,550,000.000 | 3,929,459.500 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425 | 3,630,000.000 | 4,043,311.800 | |
| | | 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025 | 3,199,000.000 | 3,824,084.600 | |
| | | 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025 | 2,694,000.000 | 2,957,958.120 | |
| | | 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525 | 2,238,000.000 | 3,064,381.500 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525 | 3,347,000.000 | 3,634,172.600 | |
| | | 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525 | 3,086,000.000 | 3,465,670.580 | |
| | | 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525 | 2,787,000.000 | 3,299,668.650 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125 | 3,399,000.000 | 3,736,962.570 | |
| | | 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20191125 | 2,322,000.000 | 2,346,706.080 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525 | 3,292,000.000 | 3,361,494.120 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20200525 | 3,070,000.000 | 3,096,954.600 | |
| | | 1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125 | 2,601,000.000 | 2,735,653.770 | |
| | | 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125 | 2,193,000.000 | 2,227,649.400 | |
| | | 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525 | 3,920,000.000 | 4,186,481.600 | |
| | | 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525 | 2,737,000.000 | 2,773,374.730 | |
| | | 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525 | 2,269,000.000 | 2,266,935.210 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525 | 887,000.000 | 857,950.750 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525 | 2,770,000.000 | 2,801,633.400 | |
| | | 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125 | 2,800,000.000 | 2,766,820.000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525 | 2,000,000.000 | 2,021,040.000 | |
| | | 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625 | 1,120,000.000 | 1,196,865.600 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20200225 | 700,000.000 | 705,250.000 | |
| | | 1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525 | 2,500,000.000 | 2,607,000.000 | |
| | | 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525 | 1,950,000.000 | 2,109,432.000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325 | 2,400,000.000 | 2,415,504.000 | |
| | | 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525 | 4,100,000.000 | 4,147,519.000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225 | 2,400,000.000 | 2,424,888.000 | |
| | | 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525 | 950,000.000 | 966,197.500 | |
| | | 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125 | 1,100,000.000 | 1,106,501.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325 | 1,100,000.000 | 1,098,548.000 | |
| | | 7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115 | 548,000.000 | 726,072.600 | |
| | | 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115 | 1,239,000.000 | 1,815,296.070 | |
| | | 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115 | 1,355,000.000 | 2,075,399.300 | |
| | | 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115 | 791,000.000 | 925,430.450 | |
| | | 3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715 | 1,146,000.000 | 1,223,595.660 | |
| | | 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115 | 1,349,000.000 | 2,138,353.860 | |
| | | 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715 | 1,463,000.000 | 1,609,534.080 | |
| | | 2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715 | 1,438,000.000 | 1,576,795.760 | |
| | | 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115 | 1,168,000.000 | 1,446,077.440 | |
| | | 1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715 | 1,385,000.000 | 1,513,223.300 | |
| | | 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115 | 1,249,000.000 | 1,767,572.310 | |
| | | 2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715 | 1,514,000.000 | 1,689,487.740 | |
| | | 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200115 | 1,374,000.000 | 1,388,770.500 | |
| | | 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715 | 1,291,000.000 | 1,305,407.560 | |
| | | 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715 | 1,338,000.000 | 1,368,225.420 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115 | 1,200,000.000 | 1,216,644.000 | |
| | | 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715 | 1,200,000.000 | 1,241,316.000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115 | 800,000.000 | 804,704.000 | |
| | | 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715 | 950,000.000 | 976,818.500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101 | 1,106,000.000 | 1,446,172.420 | |
| | | 7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101 | 1,110,000.000 | 1,447,961.700 | |
| | | 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 2,392,000.000 | 3,022,076.720 | |
| | | 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201 | 1,814,000.000 | 1,806,326.780 | |
| | | 1.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20191201 | 1,445,000.000 | 1,454,898.250 | |
| | | 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901 | 1,429,000.000 | 1,323,939.920 | |
| | | 1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415 | 1,629,000.000 | 1,604,222.910 | |
| | | 1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601 | 1,687,000.000 | 1,568,859.390 | |
| | | 1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301 | 1,765,000.000 | 1,452,400.850 | |
| | | 0.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200501 | 1,511,000.000 | 1,512,828.310 | |
| | | 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201 | 1,591,000.000 | 1,515,188.850 | |
| | | 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915 | 1,504,000.000 | 1,475,860.160 | |
| | | 0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101 | 774,000.000 | 770,904.000 | |
| | | 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301 | 1,440,000.000 | 1,213,502.400 | |
| | | 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315 | 2,359,000.000 | 2,248,645.980 | |
| | | 1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601 | 1,286,000.000 | 1,184,521.740 | |
| | | 0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601 | 1,674,000.000 | 1,641,909.420 | |
| | | 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901 | 924,000.000 | 778,026.480 | |
| | | 1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201 | 1,568,000.000 | 1,396,272.640 | |
| | | 0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015 | 700,000.000 | 649,796.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101 | 1,358,000.000 | 1,315,671.140 | |
| | | 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301 | 648,000.000 | 531,431.280 | |
| | | 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901 | 1,200,000.000 | 1,065,108.000 | |
| | | 2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 2,010,000.000 | 1,894,244.100 | |
| | | 1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515 | 1,300,000.000 | 1,257,659.000 | |
| | | 1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401 | 1,250,000.000 | 1,225,987.500 | |
| | | 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615 | 970,000.000 | 965,955.100 | |
| | | 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301 | 1,450,000.000 | 1,365,624.500 | |
| | | 2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801 | 1,300,000.000 | 1,206,244.000 | |
| | | 0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801 | 700,000.000 | 674,436.000 | |
| | | 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115 | 1,200,000.000 | 1,125,072.000 | |
| | | 0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015 | 1,900,000.000 | 1,877,637.000 | |
| | | 2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901 | 800,000.000 | 719,560.000 | |
| | | 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201 | 1,500,000.000 | 1,382,610.000 | |
| | | 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301 | 900,000.000 | 857,367.000 | |
| | | 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515 | 1,300,000.000 | 1,204,723.000 | |
| | | 0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415 | 500,000.000 | 486,780.000 | |
| | | 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201 | 550,000.000 | 532,548.500 | |
| | | 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001 | 400,000.000 | 402,572.000 | |
| | | 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115 | 600,000.000 | 588,396.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015 | 200,000.000 | 203,854.000 | |
| | | 5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101 | 2,454,000.000 | 2,898,861.120 | |
| | | 6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501 | 2,849,000.000 | 3,595,836.860 | |
| | | 5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201 | 1,655,000.000 | 2,057,280.850 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200201 | 1,921,000.000 | 2,008,616.810 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801 | 2,498,000.000 | 2,928,855.040 | |
| | | 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201 | 2,790,000.000 | 2,943,422.100 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801 | 2,734,000.000 | 2,893,337.520 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801 | 2,034,000.000 | 2,384,580.240 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801 | 2,251,000.000 | 2,499,938.090 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301 | 2,118,000.000 | 2,398,507.920 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901 | 2,043,000.000 | 2,387,878.830 | |
| | | 4.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200301 | 2,560,000.000 | 2,675,302.400 | |
| | | 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901 | 2,214,000.000 | 2,333,733.120 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301 | 2,070,000.000 | 2,295,071.100 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301 | 2,144,000.000 | 2,266,851.200 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901 | 2,281,000.000 | 2,474,497.230 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301 | 2,012,000.000 | 2,212,616.520 | |
| | | 5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901 | 1,657,000.000 | 1,864,854.080 | |
| | | 5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101 | 1,910,000.000 | 2,153,028.400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901 | 2,410,000.000 | 2,750,942.700 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501 | 1,894,000.000 | 2,076,846.760 | |
| | | 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901 | 1,413,000.000 | 1,620,287.100 | |
| | | 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301 | 2,194,000.000 | 2,408,529.320 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501 | 1,729,000.000 | 1,828,884.330 | |
| | | 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901 | 2,201,000.000 | 2,334,886.830 | |
| | | 3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301 | 1,938,000.000 | 1,975,829.760 | |
| | | 2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215 | 1,593,000.000 | 1,619,348.220 | |
| | | 5.5% Belgium Government Bond 20280328 | 1,706,000.000 | 2,449,474.800 | |
| | | 5% Belgium Government Bond 20350328 | 1,704,000.000 | 2,627,602.080 | |
| | | 4% Belgium Government Bond 20220328 | 877,000.000 | 1,004,936.760 | |
| | | 3.75% Belgium Government Bond 20200928 | 1,736,000.000 | 1,873,578.000 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20410328 | 1,674,000.000 | 2,511,619.380 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20210928 | 1,446,000.000 | 1,638,780.720 | |
| | | 4.5% Belgium Government Bond 20260328 | 1,001,000.000 | 1,297,336.040 | |
| | | 4.25% Belgium Government Bond 20220928 | 1,316,000.000 | 1,544,865.560 | |
| | | 4% Belgium Government Bond 20320328 | 680,000.000 | 926,466.000 | |
| | | 2.25% Belgium Government Bond 20230622 | 1,338,000.000 | 1,484,082.840 | |
| | | 3.75% Belgium Government Bond 20450622 | 753,000.000 | 1,081,609.200 | |
| | | 2.6% Belgium Government Bond 20240622 | 1,505,000.000 | 1,712,930.800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 3% Belgium Government Bond 20340622 | 597,000.000 | 741,575.490 |
| | | 5.4% IRISH TREASURY 20250313 | 1,131,000.000 | 1,480,411.140 |
| | | 5% IRISH TREASURY 20201018 | 765,000.000 | 844,276.950 |
| | | 3.9% IRISH TREASURY 20230320 | 504,000.000 | 588,969.360 |
| | | 3.4% IRISH TREASURY 20240318 | 607,000.000 | 708,903.160 |
| | | 2.4% IRISH TREASURY 20300515 | 761,000.000 | 864,739.520 |
| | | 0.8% IRISH TREASURY 20220315 | 516,000.000 | 532,383.000 |
| | | 2% IRISH TREASURY 20450218 | 781,000.000 | 815,137.510 |
| | | 1% IRISH TREASURY 20260515 | 1,073,000.000 | 1,104,503.280 |
| | | 1.7% IRISH TREASURY 20370515 | 350,000.000 | 356,209.000 |
| | | IRISH TREASURY 20221018 | 50,000.000 | 50,112.000 |
| | | 0.9% IRISH TREASURY 20280515 | 500,000.000 | 499,600.000 |
| | | 1.3% IRISH TREASURY 20330515 | 700,000.000 | 689,346.000 |
| | | 1.35% IRISH TREASURY 20310318 | 200,000.000 | 202,602.000 |
| | | 4.5% IRISH TREASURY 20200418 | 735,000.000 | 785,869.350 |
| | | 6.25% Austria Government Bond 20270715 | 825,000.000 | 1,230,710.250 |
| | | 3.9% Austria Government Bond 20200715 | 1,248,000.000 | 1,339,303.680 |
| | | 3.5% Austria Government Bond 20210915 | 1,337,000.000 | 1,486,409.750 |
| | | 4.15% Austria Government Bond 20370315 | 1,073,000.000 | 1,610,454.970 |
| | | 4.85% Austria Government Bond 20260315 | 875,000.000 | 1,165,377.500 |
| | | 3.65% Austria Government Bond 20220420 | 797,000.000 | 906,021.630 |
| | | 3.4% Austria Government Bond 20221122 | 872,000.000 | 1,000,541.520 |
| | | 3.8% Austria Government Bond 20620126 | 318,000.000 | 546,565.680 |
| | | 3.15% Austria Government Bond 20440620 | 623,000.000 | 872,442.970 |
| | | 1.75% Austria Government Bond 20231020 | 959,000.000 | 1,047,362.260 |
| | | 2.4% Austria Government Bond 20340523 | 621,000.000 | 743,337.000 |
| | | 1.65% Austria Government Bond 20241021 | 932,000.000 | 1,020,213.800 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 4% Finland Government Bond 20250704 | 667,000.000 | 835,144.030 | |
| | | 3.375% Finland Government Bond 20200415 | 632,000.000 | 666,437.680 | |
| | | 3.5% Finland Government Bond 20210415 | 459,000.000 | 502,531.560 | |
| | | 2.75% Finland Government Bond 20280704 | 389,000.000 | 469,056.200 | |
| | | 1.625% Finland Government Bond 20220915 | 612,000.000 | 656,088.480 | |
| | | 1.5% Finland Government Bond 20230415 | 446,000.000 | 478,825.600 | |
| | | 2.625% Finland Government Bond 20420704 | 407,000.000 | 534,956.730 | |
| | | 2% Finland Government Bond 20240415 | 529,000.000 | 586,290.700 | |
| | | 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131 | 2,352,000.000 | 3,342,074.400 | |
| | | 1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430 | 1,745,000.000 | 1,826,857.950 | |
| | | 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730 | 2,052,000.000 | 2,098,600.920 | |
| | | 2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031 | 1,792,000.000 | 1,932,026.880 | |
| | | 1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730 | 1,650,000.000 | 1,688,676.000 | |
| | | 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430 | 1,733,000.000 | 1,837,985.140 | |
| | | 0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730 | 1,747,000.000 | 1,785,171.950 | |
| | | 2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031 | 1,452,000.000 | 1,529,144.760 | |
| | | 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730 | 850,000.000 | 950,232.000 | |
| | | 1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031 | 1,730,000.000 | 1,745,362.400 | |
| | | 0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430 | 1,380,000.000 | 1,393,993.200 | |
| | | 1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430 | 1,800,000.000 | 1,828,188.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730 | 1,450,000.000 | 1,505,361.000 | |
| | | 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031 | 1,800,000.000 | 1,812,618.000 | |
| | | 0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131 | 1,300,000.000 | 1,304,771.000 | |
| | | 0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031 | 1,000,000.000 | 1,009,570.000 | |
| | | 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430 | 2,100,000.000 | 2,093,259.000 | |
| | | 2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031 | 650,000.000 | 650,227.500 | |
| | | 0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730 | 700,000.000 | 697,172.000 | |
| | | 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730 | 700,000.000 | 693,693.000 | |
| | | 0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031 | 200,000.000 | 200,074.000 | |
| | | 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730 | 1,979,000.000 | 2,902,262.870 | |
| | | 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131 | 1,654,000.000 | 2,151,473.580 | |
| | | 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730 | 1,308,000.000 | 1,867,091.520 | |
| | | 4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131 | 1,682,000.000 | 2,041,510.680 | |
| | | 4.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20191031 | 1,775,000.000 | 1,850,881.250 | |
| | | 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730 | 1,873,000.000 | 2,618,098.130 | |
| | | 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200430 | 2,101,000.000 | 2,229,749.280 | |
| | | 4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730 | 2,189,000.000 | 2,716,089.310 | |
| | | 4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031 | 1,681,000.000 | 1,842,846.680 | |
| | | 5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430 | 2,515,000.000 | 2,854,525.000 | |
| | | 5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730 | 1,965,000.000 | 2,649,114.750 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131 | 1,978,000.000 | 2,339,855.320 | |
| | 5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131 | 2,608,000.000 | 3,158,444.480 | |
| | 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031 | 1,601,000.000 | 1,902,308.200 | |
| | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031 | 1,770,000.000 | 2,362,719.900 | |
| | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031 | 1,499,000.000 | 2,237,647.240 | |
| | 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430 | 1,970,000.000 | 2,297,571.600 | |
| | 2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031 | 2,097,000.000 | 2,338,993.800 | |
| | 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200131 | 1,900,000.000 | 1,939,824.000 | |
| ユーロ　小計 | | | ユーロ<br>506,874,504.320<br>(65,483,117,213) | |
| 南アフリカ・ランド | | 南アフリカ・ランド | 南アフリカ・ランド | |
| | 7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115 | 5,768,000.000 | 5,832,024.800 | |
| | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221 | 16,434,000.000 | 17,894,982.600 | |
| | 6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331 | 11,612,000.000 | 8,352,859.960 | |
| | 6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331 | 4,622,000.000 | 4,581,788.600 | |
| | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228 | 8,904,000.000 | 6,265,744.800 | |
| | 7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228 | 8,999,000.000 | 7,441,723.050 | |
| | 7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228 | 5,539,000.000 | 5,450,652.950 | |
| | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228 | 17,652,000.000 | 15,874,267.080 | |
| | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131 | 11,021,000.000 | 9,873,383.270 | |
| | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131 | 11,862,000.000 | 10,770,696.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131 | 11,944,000.000 | 10,746,733.440 | |
| | | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331 | 8,243,000.000 | 7,454,804.340 | |
| | | 8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228 | 6,166,000.000 | 5,768,046.360 | |
| | | 9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131 | 5,179,000.000 | 4,809,530.140 | |
| | 南アフリカ・ランド　小計 | | | 南アフリカ・ランド<br>121,117,237.390<br>(1,005,273,070) | |
| 国債証券　合計 | | | | 166,684,616,502<br>[166,684,616,502] | |
| 合計 | | | | 166,684,616,502<br>[166,684,616,502] | |

（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 | 246銘柄 | 100% | 45.9% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 | 42銘柄 | 100% | 6.6% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 | 23銘柄 | 100% | 2.1% |
| カナダ・ドル | 国債証券 | 33銘柄 | 100% | 2.0% |
| シンガポール・ドル | 国債証券 | 19銘柄 | 100% | 0.4% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 | 7銘柄 | 100% | 0.4% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 | 7銘柄 | 100% | 0.6% |
| 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 | 15銘柄 | 100% | 0.6% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 | 33銘柄 | 100% | 0.5% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 16銘柄 | 100% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券 | 299銘柄 | 100% | 39.3% |
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 | 14銘柄 | 100% | 0.6% |

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

**「ダイワ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**

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 40,956,855 | 74,737,500 |
| 金銭信託 | ― | 78,032,547 |
| コール・ローン | 126,929,831 | 151,755,151 |
| 国債証券 | 7,007,813,394 | 10,060,492,591 |
| 派生商品評価勘定 | 383,140 | 4,216,740 |
| 未収入金 | 334,140 | 146,142,201 |
| 未収利息 | 113,719,522 | 181,535,563 |
| 前払費用 | 14,626,640 | 18,186,368 |
| 流動資産合計 | 7,304,763,522 | 10,715,098,661 |
| 資産合計 | 7,304,763,522 | 10,715,098,661 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 711,621 | 68,331 |
| 未払金 | 37,899,434 | 27,400,077 |
| 未払解約金 | 947,428 | 1,299,646 |
| その他未払費用 | ― | 1,088 |
| 流動負債合計 | 39,558,483 | 28,769,142 |
| 負債合計 | 39,558,483 | 28,769,142 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本　※1 | 5,227,992,401 | 8,027,339,497 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,037,212,638 | 2,658,990,022 |
| 元本等合計 | 7,265,205,039 | 10,686,329,519 |
| 純資産合計 | 7,265,205,039 | 10,686,329,519 |
| 負債純資産合計 | 7,304,763,522 | 10,715,098,661 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 3,005,160,489円 | 5,227,992,401円 |

| | | |
|---|---|---|
| 期中追加設定元本額 | 2,553,055,931円 | 3,153,540,693円 |
| 期中一部解約元本額 | 330,224,019円 | 354,193,597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（FOFs用）（適格機関投資家専用） | －円 | 1,275,649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） | 126,317,396円 | 190,979,446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） | 203,180,272円 | 368,899,713円 |
| Ｄ－Ｉ'ｓ 新興国債券インデックス | 42,880,459円 | 50,491,474円 |
| ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス | 817,985,977円 | 1,662,774,236円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 499,018,052円 | 1,010,520,671円 |
| ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド | 3,333,098,334円 | 4,525,482,673円 |
| ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券 | 180,119,978円 | 186,442,653円 |
| ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド | 25,391,933円 | 30,472,982円 |
| 計 | 5,227,992,401円 | 8,027,339,497円 |
| | | |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 5,227,992,401口 | 8,027,339,497口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

| | |
|---|---|
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 国債証券 | △42,745,813 | △19,307,971 |
| 合計 | △42,745,813 | △19,307,971 |

（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（平成29年7月6日から平成29年11月30日まで、及び平成30年7月6日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | 81,232,931 | － | 80,904,450 | △328,481 | 180,283,137 | － | 184,431,546 | 4,148,409 |
| チェコ･コルナ | 5,991,980 | － | 6,001,500 | 9,520 | 13,884,990 | － | 13,968,900 | 83,910 |
| トルコ･リラ | 22,470,780 | － | 21,878,250 | △592,530 | 17,473,405 | － | 18,703,600 | 1,230,195 |
| ハンガリー･フォリント | 8,546,303 | － | 8,508,000 | △38,303 | 10,781,457 | － | 10,819,916 | 38,459 |
| ポーランド･ズロチ | 9,117,218 | － | 9,161,100 | 43,882 | 40,549,425 | － | 40,936,080 | 386,655 |
| メキシコ･ペソ | 17,947,650 | － | 18,030,000 | 82,350 | 34,002,659 | － | 34,361,730 | 359,071 |
| ルーマニア･レイ | 11,459,015 | － | 11,436,000 | △23,015 | 33,721,442 | － | 33,846,120 | 124,678 |
| 南アフリカ･ランド | 5,699,985 | － | 5,889,600 | 189,615 | 29,869,759 | － | 31,795,200 | 1,925,441 |
| 合計 | 81,232,931 | － | 80,904,450 | △328,481 | 180,283,137 | － | 184,431,546 | 4,148,409 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.3897円<br>(13,897円) | 1.3312円<br>(13,312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 | アルゼンチン・ペソ | | アルゼンチン・ペソ | アルゼンチン・ペソ | |
| | | 18.2% REPUBLIC OF ARGENTINA 20211003 | 4,700,000.000 | 3,687,902.000 | |
| | | 16% REPUBLIC OF ARGENTINA 20231017 | 1,400,000.000 | 1,133,370.000 | |
| | | 15.5% REPUBLIC OF ARGENTINA 20261017 | 16,800,000.000 | 12,561,192.000 | |
| | アルゼンチン・ペソ　小計 | | | アルゼンチン・ペソ<br>17,382,464.000<br>(52,147,392) | |
| | インドネシア・ルピア | | インドネシア・ルピア | インドネシア・ルピア | |
| | | 8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515 | 5,750,000,000.000 | 5,742,525,000.000 | |
| | | 8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515 | 4,000,000,000.000 | 4,189,040,000.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815 | 2,800,000,000.000 | 2,635,836,000.000 | |
| | | 7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515 | 7,300,000,000.000 | 6,813,674,000.000 | |
| | | 11% Indonesia Treasury Bond 20201115 | 2,400,000,000.000 | 2,563,704,000.000 | |
| | | 12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615 | 1,600,000,000.000 | 1,792,576,000.000 | |
| | | 11% Indonesia Treasury Bond 20250915 | 1,700,000,000.000 | 1,959,165,000.000 | |
| | | 10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815 | 4,180,000,000.000 | 4,893,149,800.000 | |
| | | 8.25% Indonesia Treasury Bond 20210715 | 7,210,000,000.000 | 7,320,240,900.000 | |
| | | 9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715 | 2,970,000,000.000 | 3,272,435,100.000 | |
| | | 8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915 | 10,224,000,000.000 | 10,426,128,480.000 | |
| | | 8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615 | 4,750,000,000.000 | 4,756,935,000.000 | |
| | | 7% Indonesia Treasury Bond 20270515 | 10,330,000,000.000 | 9,713,918,800.000 | |
| | | 7% Indonesia Treasury Bond 20220515 | 8,660,000,000.000 | 8,451,900,200.000 | |
| | | 5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515 | 8,910,000,000.000 | 8,192,388,600.000 | |
| | | 6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515 | 8,700,000,000.000 | 7,719,771,000.000 | |
| | | 6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515 | 4,975,000,000.000 | 4,363,373,500.000 | |
| | | 8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315 | 10,020,000,000.000 | 10,107,374,400.000 | |
| | | 8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315 | 11,150,000,000.000 | 11,354,268,000.000 | |
| | | 9% Indonesia Treasury Bond 20290315 | 7,820,000,000.000 | 8,328,456,400.000 | |
| | インドネシア・ルピア　小計 | | | インドネシア・ルピア<br>124,596,860,180.000<br>(984,315,196) | |
| | ウルグアイ・ペソ | | ウルグアイ・ペソ | ウルグアイ・ペソ | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 9.875% Uruguay Government International Bond 20220620 | 5,300,000.000 | 5,220,500.000 | |
| | 8.5% Uruguay Government International Bond 20280315 | 2,800,000.000 | 2,394,000.000 | |
| ウルグアイ・ペソ　小計 | | | ウルグアイ・ペソ<br>7,614,500.000<br>(26,879,185) | |
| コロンビア・ペソ | | コロンビア・ペソ | コロンビア・ペソ | |
| | 9.85% Colombia Government International Bond 20270628 | 90,000,000.000 | 112,743,900.000 | |
| | 7.75% Colombia Government International Bond 20210414 | 95,000,000.000 | 99,272,150.000 | |
| | 4.375% Colombia Government International Bond 20230321 | 45,000,000.000 | 43,247,250.000 | |
| | 11% Colombian TES 20200724 | 2,265,000,000.000 | 2,476,052,700.000 | |
| | 7% Colombian TES 20220504 | 2,935,000,000.000 | 3,054,777,350.000 | |
| | 10% Colombian TES 20240724 | 3,050,000,000.000 | 3,569,598,000.000 | |
| | 6% Colombian TES 20280428 | 3,590,000,000.000 | 3,352,701,000.000 | |
| | 7.5% Colombian TES 20260826 | 3,310,000,000.000 | 3,460,207,800.000 | |
| | 7.75% Colombian TES 20300918 | 2,000,000,000.000 | 2,094,220,000.000 | |
| | 7% Colombian TES 20320630 | 1,800,000,000.000 | 1,749,186,000.000 | |
| | 6.25% Colombian TES 20251126 | 1,500,000,000.000 | 1,471,515,000.000 | |
| コロンビア・ペソ　小計 | | | コロンビア・ペソ<br>21,483,521,150.000<br>(751,923,241) | |
| タイ・バーツ | | タイ・バーツ | タイ・バーツ | |
| | 4.875% Thailand Government Bond 20290622 | 23,050,000.000 | 27,293,505.000 | |
| | 3.625% Thailand Government Bond 20230616 | 19,300,000.000 | 20,421,330.000 | |
| | 3.85% Thailand Government Bond 20251212 | 17,610,000.000 | 19,104,912.900 | |
| | 3.65% Thailand Government Bond 20211217 | 26,600,000.000 | 27,885,312.000 | |
| | 3.65% Thailand Government Bond 20310620 | 18,700,000.000 | 19,953,835.000 | |
| | 2.55% Thailand Government Bond 20200626 | 10,000,000.000 | 10,110,800.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 1.875% Thailand Government Bond 20220617 | 21,200,000.000 | 20,999,024.000 | |
| | 3.4% Thailand Government Bond 20360617 | 19,100,000.000 | 19,827,328.000 | |
| | 2.125% Thailand Government Bond 20261217 | 23,400,000.000 | 22,567,428.000 | |
| | 2% Thailand Government Bond 20221217 | 20,000,000.000 | 19,840,600.000 | |
| | 3.775% Thailand Government Bond 20320625 | 15,000,000.000 | 16,206,600.000 | |
| | 2.875% Thailand Government Bond 20460617 | 15,000,000.000 | 13,924,950.000 | |
| | 2.4% Thailand Government Bond 20231217 | 6,000,000.000 | 6,022,980.000 | |
| | 2.875% Thailand Government Bond 20281217 | 7,000,000.000 | 7,101,220.000 | |
| タイ・バーツ　小計 | | | タイ・バーツ<br>251,259,824.900<br>(864,333,798) | |
| チェコ・コルナ | | チェコ・コルナ | チェコ・コルナ | |
| | 3.75% Czech Republic Government Bond 20200912 | 6,500,000.000 | 6,754,410.000 | |
| | 3.85% Czech Republic Government Bond 20210929 | 8,200,000.000 | 8,710,040.000 | |
| | 2.5% Czech Republic Government Bond 20280825 | 10,600,000.000 | 11,030,890.000 | |
| | 5.7% Czech Republic Government Bond 20240525 | 8,600,000.000 | 10,444,700.000 | |
| | 4.7% Czech Republic Government Bond 20220912 | 10,200,000.000 | 11,327,100.000 | |
| | 2.4% Czech Republic Government Bond 20250917 | 10,100,000.000 | 10,392,092.000 | |
| | 1% Czech Republic Government Bond 20260626 | 10,900,000.000 | 10,160,217.000 | |
| | 0.95% Czech Republic Government Bond 20300515 | 10,000,000.000 | 8,749,500.000 | |
| | Czech Republic Government Bond 20200210 | 1,900,000.000 | 1,875,281.000 | |
| | 0.45% Czech Republic Government Bond 20231025 | 2,900,000.000 | 2,720,345.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 0.25% Czech Republic Government Bond 20270210 | 3,000,000.000 | 2,611,800.000 | |
| チェコ・コルナ　小計 | | | チェコ・コルナ<br>84,776,375.000<br>(422,186,347) | |
| チリ・ペソ | | チリ・ペソ | チリ・ペソ | |
| | 4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301 | 325,000,000.000 | 330,157,750.000 | |
| | 4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301 | 470,000,000.000 | 474,873,900.000 | |
| | 5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301 | 400,000,000.000 | 411,460,000.000 | |
| | 6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101 | 260,000,000.000 | 299,460,200.000 | |
| | 4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901 | 100,000,000.000 | 101,008,000.000 | |
| | 5.5% Chile Government International Bond 20200805 | 50,000,000.000 | 51,478,500.000 | |
| チリ・ペソ　小計 | | | チリ・ペソ<br>1,668,438,350.000<br>(282,633,456) | |
| トルコ・リラ | | トルコ・リラ | トルコ・リラ | |
| | 10.5% Turkey Government Bond 20200115 | 680,000.000 | 626,273.200 | |
| | 9.5% Turkey Government Bond 20220112 | 1,660,000.000 | 1,338,624.000 | |
| | 8.5% Turkey Government Bond 20220914 | 790,000.000 | 622,085.500 | |
| | 7.1% Turkey Government Bond 20230308 | 2,780,000.000 | 1,992,537.200 | |
| | 8.8% Turkey Government Bond 20230927 | 1,390,000.000 | 1,051,048.500 | |
| | 10.4% Turkey Government Bond 20240320 | 680,000.000 | 542,708.000 | |
| | 9% Turkey Government Bond 20240724 | 1,630,000.000 | 1,216,632.000 | |
| | 7.4% Turkey Government Bond 20200205 | 2,070,000.000 | 1,828,886.400 | |
| | 8% Turkey Government Bond 20250312 | 1,490,000.000 | 1,013,766.200 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 9.4% Turkey Government Bond 20200708 | 1,180,000.000 | 1,034,742.000 | |
| | | 10.7% Turkey Government Bond 20210217 | 1,610,000.000 | 1,393,406.700 | |
| | | 10.6% Turkey Government Bond 20260211 | 2,570,000.000 | 1,999,331.500 | |
| | | 9.2% Turkey Government Bond 20210922 | 1,010,000.000 | 836,492.100 | |
| | | 11% Turkey Government Bond 20220302 | 1,400,000.000 | 1,187,032.000 | |
| | | 11% Turkey Government Bond 20270224 | 1,470,000.000 | 1,139,940.900 | |
| | | 10.7% Turkey Government Bond 20220817 | 1,900,000.000 | 1,581,389.000 | |
| | | 10.5% Turkey Government Bond 20270811 | 1,700,000.000 | 1,268,387.000 | |
| | | 12.2% Turkey Government Bond 20230118 | 1,400,000.000 | 1,223,278.000 | |
| | | 12.4% Turkey Government Bond 20280308 | 2,000,000.000 | 1,671,440.000 | |
| | | 16.2% Turkey Government Bond 20230614 | 2,000,000.000 | 1,977,220.000 | |
| | トルコ・リラ　小計 | | | トルコ・リラ<br>25,545,220.200<br>(561,228,488) | |
| | ハンガリー・フォリント | | ハンガリー・フォリント | ハンガリー・フォリント | |
| | | 3.5% Hungary Government Bond 20200624 | 66,300,000.000 | 69,339,192.000 | |
| | | 3% Hungary Government Bond 20240626 | 98,500,000.000 | 101,146,695.000 | |
| | | 3% Hungary Government Bond 20271027 | 128,000,000.000 | 125,516,800.000 | |
| | | 2.5% Hungary Government Bond 20211027 | 39,000,000.000 | 40,318,200.000 | |
| | | 1% Hungary Government Bond 20200923 | 14,000,000.000 | 14,149,660.000 | |
| | | 1.75% Hungary Government Bond 20221026 | 140,000,000.000 | 139,358,800.000 | |
| | | 2.75% Hungary Government Bond 20261222 | 40,000,000.000 | 38,740,800.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 0.5% Hungary Government Bond 20210421 | 60,000,000.000 | 58,940,400.000 | |
| | 6.75% Hungary Government Bond 20281022 | 50,000,000.000 | 64,380,000.000 | |
| | 7.5% Hungary Government Bond 20201112 | 99,500,000.000 | 113,009,115.000 | |
| | 6% Hungary Government Bond 20231124 | 131,800,000.000 | 156,090,740.000 | |
| | 7% Hungary Government Bond 20220624 | 125,000,000.000 | 147,340,000.000 | |
| | 5.5% Hungary Government Bond 20250624 | 142,500,000.000 | 166,019,625.000 | |
| ハンガリー・フォリント　小計 | | | ハンガリー・フォリント<br>1,234,350,027.000<br>(492,752,532) | |
| フィリピン・ペソ | | フィリピン・ペソ | フィリピン・ペソ | |
| | 4.95% Philippine Government International Bond 20210115 | 15,000,000.000 | 14,874,450.000 | |
| フィリピン・ペソ　小計 | | | フィリピン・ペソ<br>14,874,450.000<br>(32,128,812) | |
| ブラジル・レアル | | ブラジル・レアル | ブラジル・レアル | |
| | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20210101 | 3,030,000.000 | 3,143,534.100 | |
| | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101 | 4,410,000.000 | 4,542,741.000 | |
| | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101 | 3,990,000.000 | 4,070,797.500 | |
| | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101 | 2,750,000.000 | 2,774,200.000 | |
| | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101 | 500,000.000 | 500,620.000 | |
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200701 | 3,640,000.000 | 3,249,355.200 | |
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701 | 5,030,000.000 | 4,091,351.700 | |
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101 | 3,400,000.000 | 2,631,362.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200401 | 2,300,000.000 | 2,095,645.000 | |
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701 | 3,500,000.000 | 2,577,400.000 | |
| ブラジル・レアル　小計 | | | ブラジル・レアル<br>29,677,006.500<br>(873,691,071) | |
| ペルー・ソル | | ペルー・ソル | ペルー・ソル | |
| | 5.7% Peru Government Bond 20240812 | 1,130,000.000 | 1,175,200.000 | |
| | 6.35% Peru Government Bond 20280812 | 1,470,000.000 | 1,546,293.000 | |
| | 6.15% Peru Government Bond 20320812 | 1,450,000.000 | 1,481,494.000 | |
| | 8.2% Peru Government Bond 20260812 | 1,565,000.000 | 1,844,696.800 | |
| | 7.84% Peru Government Bond 20200812 | 310,000.000 | 335,553.300 | |
| | 6.9% Peru Government Bond 20370812 | 1,165,000.000 | 1,245,792.750 | |
| | 6.95% Peru Government Bond 20310812 | 1,520,000.000 | 1,656,541.600 | |
| ペルー・ソル　小計 | | | ペルー・ソル<br>9,285,571.450<br>(311,438,066) | |
| ポーランド・ズロチ | | ポーランド・ズロチ | ポーランド・ズロチ | |
| | 5.75% Poland Government Bond 20220923 | 2,210,000.000 | 2,498,184.000 | |
| | 1.5% Poland Government Bond 20200425 | 2,210,000.000 | 2,210,928.200 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20260725 | 2,640,000.000 | 2,567,004.000 | |
| | 2% Poland Government Bond 20210425 | 2,260,000.000 | 2,277,628.000 | |
| | 1.75% Poland Government Bond 20210725 | 2,230,000.000 | 2,232,453.000 | |
| | 2.5% Poland Government Bond 20270725 | 2,890,000.000 | 2,774,486.700 | |
| | 2.25% Poland Government Bond 20220425 | 2,300,000.000 | 2,315,640.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 2.5% Poland Government Bond 20230125 | 3,000,000.000 | 3,026,700.000 | |
| | | Poland Government Bond 20200725 | 1,000,000.000 | 976,600.000 | |
| | | 5.25% Poland Government Bond 20201025 | 1,720,000.000 | 1,839,024.000 | |
| | | 5.75% Poland Government Bond 20211025 | 1,820,000.000 | 2,019,927.000 | |
| | | 4% Poland Government Bond 20231025 | 2,530,000.000 | 2,716,334.500 | |
| | | 2.75% Poland Government Bond 20280425 | 1,300,000.000 | 1,263,795.000 | |
| | | 3.25% Poland Government Bond 20250725 | 1,850,000.000 | 1,905,518.500 | |
| | ポーランド・ズロチ　小計 | | | ポーランド・ズロチ<br>30,624,222.900<br>(923,014,078) | |
| | マレーシア・リンギット | | マレーシア・リンギット | マレーシア・リンギット | |
| | | 3.226% Malaysia Government Investment Issue 20200415 | 530,000.000 | 527,641.500 | |
| | | 3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414 | 800,000.000 | 803,496.000 | |
| | | 4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726 | 1,200,000.000 | 1,203,924.000 | |
| | | 4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031 | 1,000,000.000 | 1,010,020.000 | |
| | | 4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715 | 1,350,000.000 | 1,367,077.500 | |
| | | 3.492% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200331 | 1,510,000.000 | 1,509,622.500 | |
| | | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615 | 2,500,000.000 | 2,419,450.000 | |
| | | 4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715 | 1,740,000.000 | 1,751,849.400 | |
| | | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915 | 1,350,000.000 | 1,338,525.000 | |
| | | 3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015 | 1,740,000.000 | 1,743,723.600 | |
| | | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817 | 900,000.000 | 894,708.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130 | 1,300,000.000 | 1,276,509.000 | |
| | 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130 | 1,200,000.000 | 1,197,468.000 | |
| | 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930 | 1,420,000.000 | 1,422,612.800 | |
| | 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116 | 2,120,000.000 | 2,071,812.400 | |
| | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 1,100,000.000 | 1,098,999.000 | |
| マレーシア・リンギット　小計 | | | マレーシア・リンギット<br>21,637,438.700<br>(586,590,964) | |
| メキシコ・ペソ | | メキシコ・ペソ | メキシコ・ペソ | |
| | 5.75% Mexican Bonos 20260305 | 10,400,000.000 | 8,580,728.000 | |
| | 8% Mexican Bonos 20471107 | 4,500,000.000 | 3,758,940.000 | |
| | 7.25% Mexican Bonos 20211209 | 5,000,000.000 | 4,807,900.000 | |
| | 8% Mexican Bonos 20231207 | 11,250,000.000 | 10,839,712.500 | |
| | 10% Mexican Bonos 20241205 | 18,350,000.000 | 19,204,926.500 | |
| | 7.5% Mexican Bonos 20270603 | 23,230,000.000 | 21,022,220.800 | |
| | 10% Mexican Bonos 20361120 | 7,390,000.000 | 7,612,734.600 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20290531 | 7,230,000.000 | 6,865,608.000 | |
| | 8.5% Mexican Bonos 20381118 | 4,100,000.000 | 3,674,133.000 | |
| | 8% Mexican Bonos 20200611 | 16,990,000.000 | 16,895,195.800 | |
| | 6.5% Mexican Bonos 20210610 | 21,950,000.000 | 20,930,861.500 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 7,950,000.000 | 6,980,895.000 | |
| | 6.5% Mexican Bonos 20220609 | 19,450,000.000 | 18,111,451.000 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 11,320,000.000 | 9,293,946.400 | |
| | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 7,130,000.000 | 6,086,381.900 | |
| メキシコ・ペソ　小計 | | | メキシコ・ペソ<br>164,665,635.000<br>(923,774,213) | |
| ルーマニア・レイ | | ルーマニア・レイ | ルーマニア・レイ | |
| | 5.85% Romania Government Bond 20230426 | 1,430,000.000 | 1,519,575.200 | |
| | 5.95% Romania Government Bond 20210611 | 940,000.000 | 987,000.000 | |
| | 5.75% Romania Government Bond 20200429 | 770,000.000 | 795,702.600 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 4.75% Romania Government Bond 20250224 | 1,150,000.000 | 1,163,880.500 | |
| | | 3.25% Romania Government Bond 20210322 | 630,000.000 | 624,462.300 | |
| | | 5.8% Romania Government Bond 20270726 | 700,000.000 | 750,414.000 | |
| | | 2.25% Romania Government Bond 20200226 | 700,000.000 | 691,621.000 | |
| | | 3.5% Romania Government Bond 20221219 | 1,090,000.000 | 1,064,483.100 | |
| | | 3.25% Romania Government Bond 20240429 | 800,000.000 | 753,560.000 | |
| | | 3.4% Romania Government Bond 20220308 | 800,000.000 | 785,728.000 | |
| | | 4.25% Romania Government Bond 20230628 | 1,500,000.000 | 1,493,580.000 | |
| | ルーマニア・レイ　小計 | | | ルーマニア・レイ<br>10,630,006.700<br>(294,876,385) | |
| | ロシア・ルーブル | | ロシア・ルーブル | ロシア・ルーブル | |
| | | 7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20210414 | 14,880,000.000 | 14,800,392.000 | |
| | | 8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203 | 41,760,000.000 | 40,888,886.400 | |
| | | 7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720 | 21,910,000.000 | 21,597,563.400 | |
| | | 6.8% Russian Federal Bond - OFZ 20191211 | 10,800,000.000 | 10,724,616.000 | |
| | | 7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125 | 14,400,000.000 | 13,819,680.000 | |
| | | 7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119 | 36,160,000.000 | 32,816,646.400 | |
| | | 6.4% Russian Federal Bond - OFZ 20200527 | 22,100,000.000 | 21,718,554.000 | |
| | | 7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816 | 24,300,000.000 | 23,200,425.000 | |
| | | 7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818 | 29,300,000.000 | 28,955,725.000 | |
| | | 8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917 | 24,000,000.000 | 23,820,240.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916 | 36,100,000.000 | 34,683,436.000 | |
| | | 7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207 | 39,000,000.000 | 38,142,000.000 | |
| | | 7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323 | 47,000,000.000 | 43,559,600.000 | |
| | | 7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016 | 35,600,000.000 | 33,538,404.000 | |
| | | 7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215 | 34,000,000.000 | 33,099,000.000 | |
| | | 6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228 | 21,000,000.000 | 19,376,700.000 | |
| | | 7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510 | 10,000,000.000 | 8,833,300.000 | |
| | | 6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523 | 7,000,000.000 | 6,186,250.000 | |
| | ロシア・ルーブル　小計 | | | ロシア・ルーブル<br>449,761,418.200<br>(769,092,025) | |
| | 南アフリカ・ランド | | 南アフリカ・ランド | 南アフリカ・ランド | |
| | | 7.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20200115 | 4,190,000.000 | 4,236,509.000 | |
| | | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221 | 19,050,000.000 | 20,743,545.000 | |
| | | 6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331 | 10,220,000.000 | 7,351,552.600 | |
| | | 6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331 | 3,760,000.000 | 3,727,288.000 | |
| | | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228 | 5,280,000.000 | 3,715,536.000 | |
| | | 7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228 | 8,440,000.000 | 6,979,458.000 | |
| | | 7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228 | 5,880,000.000 | 5,786,214.000 | |
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228 | 14,020,000.000 | 12,608,045.800 | |
| | | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131 | 8,000,000.000 | 7,166,960.000 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131 | 7,100,000.000 | 6,446,800.000 | |
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131 | 11,100,000.000 | 9,987,336.000 | |
| | | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331 | 10,300,000.000 | 9,315,114.000 | |
| | | 8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228 | 5,100,000.000 | 4,770,846.000 | |
| | | 9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131 | 7,000,000.000 | 6,500,620.000 | |
| | 南アフリカ・ランド　小計 | | | 南アフリカ・ランド<br>109,335,824.400<br>(907,487,342) | |
| 国債証券　合計 | | | | 10,060,492,591<br>[10,060,492,591] | |
| 合計 | | | | 10,060,492,591<br>[10,060,492,591] | |

（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 |
|---|---|---|---|
| アルゼンチン・ペソ | 国債証券　3銘柄 | 100% | 0.5% |
| インドネシア・ルピア | 国債証券　20銘柄 | 100% | 9.8% |
| ウルグアイ・ペソ | 国債証券　2銘柄 | 100% | 0.3% |
| コロンビア・ペソ | 国債証券　11銘柄 | 100% | 7.5% |
| タイ・バーツ | 国債証券　14銘柄 | 100% | 8.6% |
| チェコ・コルナ | 国債証券　11銘柄 | 100% | 4.2% |
| チリ・ペソ | 国債証券　6銘柄 | 100% | 2.8% |
| トルコ・リラ | 国債証券　20銘柄 | 100% | 5.6% |
| ハンガリー・フォリント | 国債証券　13銘柄 | 100% | 4.9% |
| フィリピン・ペソ | 国債証券　1銘柄 | 100% | 0.3% |
| ブラジル・レアル | 国債証券　10銘柄 | 100% | 8.7% |
| ペルー・ソル | 国債証券　7銘柄 | 100% | 3.1% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券　14銘柄 | 100% | 9.2% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券　16銘柄 | 100% | 5.8% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券　15銘柄 | 100% | 9.2% |
| ルーマニア・レイ | 国債証券　11銘柄 | 100% | 2.9% |
| ロシア・ルーブル | 国債証券　18銘柄 | 100% | 7.6% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 | 14銘柄 | 100% | 9.0% |

**第２　信用取引契約残高明細表**

**該当事項はありません。**

**第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表**

**「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。**

## 【ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1　【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | － | 1,459,042 |
| コール・ローン | 2,171,031 | 2,837,498 |
| 親投資信託受益証券 | 563,190,012 | 1,025,366,135 |
| 流動資産合計 | 565,361,043 | 1,029,662,675 |
| 資産合計 | 565,361,043 | 1,029,662,675 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 661,383 | 1,166,092 |
| 未払受託者報酬 | 36,057 | 101,674 |
| 未払委託者報酬 | 342,835 | 966,233 |
| その他未払費用 | 8,953 | 25,371 |
| 流動負債合計 | 1,049,228 | 2,259,370 |
| 負債合計 | 1,049,228 | 2,259,370 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 602,124,068 | ※1 970,641,025 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | ※2 △ 37,812,253 | ※2 56,762,280 |
| （分配準備積立金） | － | 89,774,534 |
| 元本等合計 | 564,311,815 | 1,027,403,305 |
| 純資産合計 | 564,311,815 | 1,027,403,305 |
| 負債純資産合計 | 565,361,043 | 1,029,662,675 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | ― | 1 |
| 有価証券売買等損益 | △ 4,035,088 | 103,220,323 |
| その他収益 | 193 | ― |
| 営業収益合計 | △ 4,034,895 | 103,220,324 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 383 | 2,419 |
| 受託者報酬 | 48,377 | 177,238 |
| 委託者報酬 | 460,332 | 1,684,440 |
| その他費用 | 11,983 | 44,495 |
| 営業費用合計 | 521,075 | 1,908,592 |
| 営業利益又は営業損失（△） | △ 4,555,970 | 101,311,732 |
| 経常利益又は経常損失（△） | △ 4,555,970 | 101,311,732 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | △ 4,555,970 | 101,311,732 |
| 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（△） | △ 938,411 | 8,771,068 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | △ 37,812,253 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,830,056 | 11,136,017 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,830,056 | 11,136,017 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 36,024,750 | 9,102,148 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 36,024,750 | 9,102,148 |
| 分配金 | ※1 ― | ※1 ― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | △ 37,812,253 | 56,762,280 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,000,000円 | 602,124,068円 |
| 期中追加設定元本額 | 639,909,329円 | 587,481,644円 |
| 期中一部解約元本額 | 38,785,261円 | 218,964,687円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 602,124,068口 | 970,641,025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37,812,253円であります。 | ―――――― |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。 | 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（89,774,534円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は89,774,534円（1万口当たり924.90円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | △4,003,797 | 100,652,357 |
| 合計 | △4,003,797 | 100,652,357 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 0.9372円<br>(9,372円) | 1.0585円<br>(10,585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 | 382,670,698 | 1,025,366,135 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 1,025,366,135 | |
| 合計 | | | 1,025,366,135 | |

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**

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | － | 930,972,475 |
| コール・ローン | 3,256,036,732 | 1,810,524,878 |
| 投資証券　※2 | 220,601,199,850 | 221,256,748,710 |

| | | |
|---|---|---|
| 派生商品評価勘定 | 28,600,256 | 153,885,600 |
| 未収配当金 | 1,674,794,349 | 1,524,687,143 |
| 流動資産合計 | 225,560,631,187 | 225,676,818,806 |
| 資産合計 | 225,560,631,187 | 225,676,818,806 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | 26,666,400 | 129,780,000 |
| 未払金 | 709,901,156 | 502,899,564 |
| 未払解約金 | 76,203,100 | 211,997,000 |
| その他未払費用 | ― | 20,427 |
| 流動負債合計 | 812,770,656 | 844,696,991 |
| 負債合計 | 812,770,656 | 844,696,991 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 ※1 | 94,976,472,865 | 83,907,324,720 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 129,771,387,666 | 140,924,797,095 |
| 元本等合計 | 224,747,860,531 | 224,832,121,815 |
| 純資産合計 | 224,747,860,531 | 224,832,121,815 |
| 負債純資産合計 | 225,560,631,187 | 225,676,818,806 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

| | |
|---|---|
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3.　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 109,972,543,684円 | 94,976,472,865円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,496,496,276円 | 7,744,165,481円 |
| 期中一部解約元本額 | 25,492,567,095円 | 18,813,313,626円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン | 10,069,596,175円 | 7,602,467,792円 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型） | 77,995,068,044円 | 68,239,398,796円 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型） | 385,830,421円 | 370,958,894円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 27,123円 | 28,858円 |
| ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 120,896,774円 | 124,544,351円 |
| ｉＦｒｅｅ　８資産バランス | 295,219,675円 | 500,694,886円 |
| ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン | 3,559,834,969円 | 3,857,471,973円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 3,351,750円 | 2,735,943円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 5,804,659円 | 5,374,188円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 1,249,762円 | 1,385,927円 |
| ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド | 58,823,633円 | 49,054,528円 |
| ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 733,859,154円 | 1,004,070,064円 |

| | | |
|---|---|---|
| ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 1,417,849円 | 382,997,468円 |
| ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 237,994,427円 | 382,670,698円 |
| ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ | 1,507,498,450円 | 1,383,470,354円 |
| 計 | 94,976,472,865円 | 83,907,324,720円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 94,976,472,865口 | 83,907,324,720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。<br>投資証券 337,800,000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。<br>投資証券 424,200,000円 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

| | |
|---|---|
| | |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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 | 平成29年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 平成30年11月30日現在<br>当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 投資証券 | 73,034,407 | 7,188,688,571 |
| 合計 | 73,034,407 | 7,188,688,571 |

（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（平成29年9月16日から平成29年11月30日まで、及び平成30年9月19日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引<br><br>不動産投信指数先物取引 | | | | | | | | |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 買　建 | 3,594,977,600 | － | 3,623,812,000 | 28,834,400 | 3,116,520,000 | － | 3,270,600,000 | 154,080,000 |
| 合計 | 3,594,977,600 | － | 3,623,812,000 | 28,834,400 | 3,116,520,000 | － | 3,270,600,000 | 154,080,000 |

（注）　1．　時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．　不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.3664円<br>(23,664円) | 2.6795円<br>(26,795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<br>（円） | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 8,306 | 4,576,606,000 | |
| | ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人 | 28,167 | 2,526,579,900 | |
| | 森ヒルズリート | 28,667 | 4,030,580,200 | |
| | 産業ファンド | 29,122 | 3,232,542,000 | |
| | アドバンス・レジデンス | 24,360 | 7,636,860,000 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 14,829 | 2,538,724,800 | |
| | ＡＰＩ投資法人 | 11,978 | 5,713,506,000 | |
| | ＧＬＰ投資法人 | 61,938 | 7,073,319,600 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル | 9,533 | 2,714,045,100 | |
| | 日本プロロジスリート | 33,528 | 7,882,432,800 | |
| | 星野リゾート・リート | 3,803 | 2,019,393,000 | |
| | ＯＮＥリート投資法人 | 3,643 | 928,600,700 | |
| | イオンリート投資 | 25,657 | 3,255,873,300 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| ヒューリックリート投資法 | 20,206 | 3,354,196,000 | |
| 日本リート投資法人 | 8,069 | 2,997,633,500 | |
| インベスコ・オフィス・Jリート | 148,169 | 2,443,306,810 | |
| 日本ヘルスケア投資法 | 1,145 | 195,680,500 | |
| 積水ハウス・リート投資 | 64,492 | 4,507,990,800 | |
| トーセイ・リート投資法人 | 4,812 | 525,470,400 | |
| ケネディクス商業リート | 9,161 | 2,233,451,800 | |
| ヘルスケア&メディカル投資 | 3,310 | 374,692,000 | |
| サムティ・レジデンシャル | 5,003 | 458,775,100 | |
| 野村不動産マスターF | 74,087 | 11,231,589,200 | |
| いちごホテルリート投資 | 4,371 | 597,078,600 | |
| ラサールロジポート投資 | 18,857 | 2,034,670,300 | |
| スターアジア不動産投 | 7,759 | 820,902,200 | |
| マリモ地方創生リート | 2,149 | 237,034,700 | |
| 三井不ロジパーク | 4,268 | 1,397,770,000 | |
| 大江戸温泉リート | 4,034 | 339,662,800 | |
| さくら総合リート | 5,408 | 470,496,000 | |
| 投資法人みらい | 6,732 | 1,232,629,200 | |
| 森トラスト・ホテルリート投 | 5,865 | 785,910,000 | |
| 三菱地所物流REIT | 2,645 | 656,224,500 | |
| CREロジスティクスファンド | 2,503 | 266,068,900 | |
| ザイマックス・リート | 2,305 | 263,231,000 | |
| タカラレーベン不動産投 | 3,741 | 329,956,200 | |
| 伊藤忠アドバンスロジ | 3,867 | 342,616,200 | |
| 日本ビルファンド | 24,205 | 17,112,935,000 | ※ |
| ジャパンリアルエステイト | 24,996 | 15,672,492,000 | |
| 日本リテールファンド | 47,242 | 10,284,583,400 | |
| オリックス不動産投資 | 49,804 | 9,198,798,800 | |
| 日本プライムリアルティ | 15,823 | 7,017,500,500 | |
| プレミア投資法人 | 23,765 | 2,920,718,500 | |
| 東急リアル・エステート | 16,759 | 2,803,780,700 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 15,982 | 1,901,858,000 | |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 55,128 | 9,961,629,600 | |
| 森トラスト総合リート | 17,864 | 2,940,414,400 | |
| インヴィンシブル投資法人 | 87,471 | 4,119,884,100 | |
| フロンティア不動産投資 | 8,503 | 3,754,074,500 | |
| 平和不動産リート | 15,566 | 1,813,439,000 | |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 16,493 | 3,737,313,800 | |
| 福岡リート投資法人 | 12,927 | 2,179,492,200 | |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 7,732 | 5,760,340,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | いちごオフィスリート投資法人 | 20,737 | 1,924,393,600 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 5,769 | 4,049,838,000 | |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 10,369 | 1,527,353,700 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 3,938 | 659,615,000 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 31,295 | 8,052,203,500 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 72,375 | 5,717,625,000 | |
| | 日本賃貸住宅投資法人 | 28,115 | 2,437,570,500 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 22,383 | 3,482,794,800 | |
| 投資証券　合計 | | | 221,256,748,710 | |
| 合計 | | | 221,256,748,710 | |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド　600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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 635,689 |
| コール・ローン | 873,830 | 1,236,266 |
| 親投資信託受益証券 | 445,227,867 | 774,541,523 |
| 派生商品評価勘定 | 5,898,524 | 47,328 |
| 流動資産合計 | 452,000,221 | 776,460,806 |
| 資産合計 | 452,000,221 | 776,460,806 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 80,029 | 7,659,337 |
| 未払金 | 6,279 | 11,549 |
| 未払解約金 | 215,748 | 447,186 |
| 未払受託者報酬 | 29,767 | 79,356 |
| 未払委託者報酬 | 409,790 | 1,091,750 |
| その他未払費用 | 7,375 | 19,764 |
| 流動負債合計 | 748,988 | 9,308,942 |
| 負債合計 | 748,988 | 9,308,942 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 438,056,631 | ※1 743,572,984 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 13,194,602 | 23,578,880 |
| （分配準備積立金） | 8,842,602 | 20,053,234 |
| 元本等合計 | 451,251,233 | 767,151,864 |
| 純資産合計 | 451,251,233 | 767,151,864 |
| 負債純資産合計 | 452,000,221 | 776,460,806 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 15,172,867 | 36,734,656 |
| 為替差損益 | △ 5,433,438 | △ 21,878,563 |
| その他収益 | ― | 159 |
| 営業収益合計 | 9,739,429 | 14,856,252 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 333 | 1,189 |
| 受託者報酬 | 40,531 | 136,198 |
| 委託者報酬 | 558,350 | 1,873,907 |
| その他費用 | 31,585 | 44,783 |
| 営業費用合計 | 630,799 | 2,056,077 |
| 営業利益 | 9,108,630 | 12,800,175 |
| 経常利益 | 9,108,630 | 12,800,175 |
| 当期純利益 | 9,108,630 | 12,800,175 |
| 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（△） | 266,347 | △ 346,512 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 13,194,602 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,623,122 | ― |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,623,122 | ― |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 270,803 | 2,762,409 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 270,803 | 2,448,573 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | ― | 313,836 |
| 分配金 | ※1 ― | ※1 ― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 13,194,602 | 23,578,880 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 10,000,000円 | 438,056,631円 |
| 期中追加設定元本額 | 464,575,492円 | 460,818,025円 |
| 期中一部解約元本額 | 36,518,861円 | 155,301,672円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 438,056,631口 | 743,572,984口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（8,842,602円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,352,540円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は13,195,142円（1万口当たり301.22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（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（13,147,359円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,103,192円）及び分配準備積立金（6,905,875円）より分配対象額は28,156,426円（1万口当たり378.66円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。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。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>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。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 14,875,360 | 35,423,409 |
| 合計 | 14,875,360 | 35,423,409 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日 現在 | | | | 第2期<br>平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>(円) | うち | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円) | うち | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |

| | | 1年超 | | | | 1年超 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売　建 | 438,499,960 | － | 432,681,465 | 5,818,495 | 751,624,829 | － | 759,236,838 | △7,612,009 |
| アメリカ・ドル | 315,179,817 | － | 310,598,400 | 4,581,417 | 545,769,764 | － | 550,066,229 | △4,296,465 |
| イギリス・ポンド | 23,833,404 | － | 23,718,918 | 114,486 | 41,312,553 | － | 41,357,088 | △44,535 |
| イスラエル・シュケル | 239,677 | － | 236,578 | 3,099 | 447,012 | － | 449,673 | △2,661 |
| オーストラリア・ドル | 34,329,994 | － | 33,499,367 | 830,627 | 51,218,192 | － | 53,122,594 | △1,904,402 |
| カナダ・ドル | 8,177,060 | － | 8,071,389 | 105,671 | 14,072,788 | － | 14,045,010 | 27,778 |
| シンガポール・ドル | 14,333,387 | － | 14,286,888 | 46,499 | 24,958,412 | － | 25,415,312 | △456,900 |
| ニュージーランド・ドル | 1,831,723 | － | 1,793,376 | 38,347 | 3,175,957 | － | 3,354,042 | △178,085 |
| ユーロ | 31,195,793 | － | 31,250,193 | △54,400 | 54,043,038 | － | 54,643,140 | △600,102 |
| 香港・ドル | 9,379,105 | － | 9,226,356 | 152,749 | 16,627,113 | － | 16,783,750 | △156,637 |
| 合計 | 438,499,960 | － | 432,681,465 | 5,818,495 | 751,624,829 | － | 759,236,838 | △7,612,009 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0301円<br>(10,301円) | 1.0317円<br>(10,317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<br>（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 | 335,779,045 | 774,541,523 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 774,541,523 | |
| 合計 | | | 774,541,523 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」受益証券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**

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 金　額（円） | 金　額（円） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 73,767,605 | 89,993,568 |
| 金銭信託 | ― | 38,116,856 |
| コール・ローン | 54,866,041 | 74,128,418 |
| 投資信託受益証券 | 45,318,398 | 156,653,278 |
| 投資証券 | 13,189,304,705 | 19,473,164,421 |
| 派生商品評価勘定 | 443,146 | 1,468,386 |
| 未収入金 | 99,816 | 85,262 |
| 未収配当金 | 29,756,258 | 35,496,598 |
| 差入委託証拠金 | 13,429,193 | 49,021,064 |
| 流動資産合計 | 13,406,985,162 | 19,918,127,851 |
| 資産合計 | 13,406,985,162 | 19,918,127,851 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 85,036 | 2,938,332 |
| 未払金 | 63,915,030 | 29,739,082 |
| 未払解約金 | 5,310,000 | 4,078,000 |
| その他未払費用 | ― | 1,470 |
| 流動負債合計 | 69,310,066 | 36,756,884 |
| 負債合計 | 69,310,066 | 36,756,884 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本　※1 | 5,927,845,320 | 8,618,915,071 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 7,409,829,776 | 11,262,455,896 |
| 元本等合計 | 13,337,675,096 | 19,881,370,967 |
| 純資産合計 | 13,337,675,096 | 19,881,370,967 |
| 負債純資産合計 | 13,406,985,162 | 19,918,127,851 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)出資証券<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(3)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、出資証券、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1．　※1　期首 | 平成29年1月11日 | 平成29年12月1日 |
| 期首元本額 | 2,939,665,813円 | 5,927,845,320円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,304,824,139円 | 3,311,357,547円 |
| 期中一部解約元本額 | 316,644,632円 | 620,287,796円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） | 3,020,027,986円 | 4,302,051,362円 |
| ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | 385,272,511円 | 603,629,393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） | 197,879,052円 | 335,779,045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） | 138,768,817円 | 243,291,029円 |
| Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス | 1,191,716円 | 1,218,954円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 28,535円 | 33,252円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス | 61,854,354円 | 76,659,750円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 305,935,202円 | 582,998,251円 |
| ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド | 1,494,626,508円 | 1,729,141,932円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 3,528,717円 | 3,185,268円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 6,075,115円 | 6,196,103円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 1,124,043円 | 1,417,273円 |
| ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ | 280,050,632円 | 263,443,683円 |
| ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド | 22,439,317円 | 26,470,390円 |
| ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 4,479,909円 | 222,841,400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） | 4,562,906円 | 220,557,986円 |
| 計 | 5,927,845,320円 | 8,618,915,071円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 5,927,845,320口 | 8,618,915,071口 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2．　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>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

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|

| 種　類 | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | 255,922 | 1,813,818 |
| 投資証券 | 390,390,351 | △97,930,653 |
| 合計 | 390,646,273 | △96,116,835 |

（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（平成28年12月1日から平成29年11月30日まで、及び平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

| 種　類 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 不動産投信指数先物取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | 72,064,957 | － | 72,473,939 | 408,982 | 190,645,204 | － | 188,822,713 | △1,822,491 |
| 合計 | 72,064,957 | － | 72,473,939 | 408,982 | 190,645,204 | － | 188,822,713 | △1,822,491 |

（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 | 平成29年11月30日 現在 | | | | 平成30年11月30日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | | | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 買　建 | 27,306,772 | － | 27,255,900 | △50,872 | 74,778,455 | － | 75,131,000 | 352,545 |
| アメリカ･ドル | 24,693,829 | － | 24,643,200 | △50,629 | 72,214,130 | － | 72,569,600 | 355,470 |
| カナダ･ドル | 2,612,943 | － | 2,612,700 | △243 | 2,564,325 | － | 2,561,400 | △2,925 |
| 合計 | 27,306,772 | － | 27,255,900 | △50,872 | 74,778,455 | － | 75,131,000 | 352,545 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 平成29年11月30日現在 | 平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.2500円<br>(22,500円) | 2.3067円<br>(23,067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 | | | アメリカ・ドル | |
| | | VANGUARD REAL ESTATE ETF | 17,000.000 | 1,380,570.000 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>1,380,570.000<br>(156,653,278) | |
| 投資信託受益証券　合計 | | | | 156,653,278<br>[156,653,278] | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | | | アメリカ・ドル | |
| | | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 21,000 | 738,780.000 | |
| | | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 10,100 | 52,520.000 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 16,782 | 328,255.920 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 16,500 | 337,260.000 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 21,100 | 3,968,277.000 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 47,247 | 8,721,796.200 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 23,500 | 3,050,770.000 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 24,055 | 1,110,138.250 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 26,364 | 1,860,771.120 | |
| | | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 8,600 | 155,746.000 | |
| | | NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 8,300 | 227,835.000 | |
| | | NEXPOINT RESIDENTIAL | 3,100 | 112,964.000 | |
| | | QTS REALTY TRUST INC-CL A | 7,800 | 317,460.000 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 56,100 | 3,942,147.000 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 32,100 | 511,032.000 | |
| | | EPR PROPERTIES | 11,300 | 797,667.000 | |
| | | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 3,500 | 31,815.000 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 5,300 | 57,346.000 | |
| | | GLOBAL NET LEASE INC | 10,133 | 203,977.290 | |
| | | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 9,829 | 272,361.590 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 6,300 | 125,055.000 | |
| | | CHESAPEAKE LODGING TRUST | 9,200 | 270,296.000 | |
| | | SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 4,100 | 157,932.000 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 7,600 | 567,112.000 | |
| | | FOREST CITY REALTY TRUST- A | 40,800 | 1,031,832.000 | |
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 17,200 | 305,128.000 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 2,300 | 71,231.000 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 4,113 | 40,060.620 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 112,900 | 2,178,970.000 |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 39,108 | 800,540.760 |
| | | CORESITE REALTY CORP | 5,600 | 538,608.000 |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 23,900 | 739,944.000 |
| | | RLJ LODGING TRUST | 26,671 | 538,754.200 |
| | | FARMLAND PARTNERS INC | 2,900 | 18,444.000 |
| | | PHYSICIANS REALTY TRUST | 27,200 | 477,904.000 |
| | | CYRUSONE INC | 15,900 | 887,856.000 |
| | | KIMCO REALTY CORP | 64,400 | 1,025,892.000 |
| | | GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1,800 | 17,136.000 |
| | | HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 31,550 | 880,560.500 |
| | | WHITESTONE REIT | 5,800 | 81,084.000 |
| | | TIER REIT INC | 8,100 | 187,677.000 |
| | | MEDEQUITIES REALTY TRUST INC | 3,000 | 21,090.000 |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 30,600 | 1,049,886.000 |
| | | PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 18,700 | 340,153.000 |
| | | PARK HOTELS & RESORTS INC | 30,700 | 938,806.000 |
| | | COLONY CAPITAL INC | 72,211 | 433,988.110 |
| | | INVITATION HOMES INC | 45,397 | 971,041.830 |
| | | JBG SMITH PROPERTIES | 16,532 | 653,675.280 |
| | | CLIPPER REALTY INC | 1,400 | 18,228.000 |
| | | GLADSTONE LAND CORP | 900 | 11,826.000 |
| | | INFRAREIT INC | 5,600 | 126,448.000 |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 8,500 | 229,160.000 |
| | | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 2,500 | 54,375.000 |
| | | VICI PROPERTIES INC | 53,600 | 1,182,952.000 |
| | | SPIRIT MTA REIT | 5,870 | 57,115.100 |
| | | RETAIL VALUE INC | 1,957 | 56,753.000 |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 1,300 | 14,781.000 |
| | | FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 7,300 | 63,437.000 |
| | | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 1,400 | 69,776.000 |
| | | SAFETY INCOME & GROWTH INC | 1,300 | 25,675.000 |
| | | WASHINGTON PRIME GROUP INC | 26,560 | 169,984.000 |
| | | CORECIVIC INC | 18,024 | 396,708.240 |
| | | STORE CAPITAL CORP | 27,800 | 826,772.000 |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 15,700 | 174,113.000 |
| | | LIFE STORAGE INC | 7,000 | 676,410.000 |
| | | SELECT INCOME REIT | 13,300 | 258,020.000 |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5,900 | 240,484.000 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 11,882 | 116,443.600 |
| | | PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 5,300 | 79,341.000 |
| | | PARAMOUNT GROUP INC | 30,500 | 430,355.000 |
| | | EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 20,200 | 320,372.000 |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 13,900 | 456,198.000 |
| | | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 17,300 | 369,009.000 |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 15,900 | 422,622.000 |
| | | VENTAS INC | 54,279 | 3,389,723.550 |
| | | CARETRUST REIT INC | 12,103 | 240,607.640 |
| | | GEO GROUP INC/THE | 18,500 | 429,015.000 |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 46,100 | 731,146.000 |
| | | GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 14,400 | 124,992.000 |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 27,187 | 524,437.230 |
| | | UMH PROPERTIES INC | 4,200 | 53,928.000 |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 43,600 | 1,471,500.000 |
| | | TERRENO REALTY CORP | 8,800 | 343,816.000 |
| | | VEREIT INC | 147,308 | 1,123,960.040 |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 63,600 | 468,096.000 |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 13,100 | 1,346,680.000 |
| | | ACADIA REALTY TRUST | 11,911 | 338,034.180 |
| | | ALEXANDER'S INC | 600 | 184,680.000 |
| | | PROLOGIS INC | 96,202 | 6,462,850.360 |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 16,100 | 1,970,318.000 |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 26,800 | 377,076.000 |
| | | SAUL CENTERS INC | 1,700 | 88,043.000 |
| | | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 22,945 | 59,657.000 |
| | | MACK-CALI REALTY CORP | 13,500 | 288,495.000 |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 14,100 | 1,321,452.000 |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 62,407 | 523,594.730 |
| | | SITE CENTERS CORP | 22,278 | 260,429.820 |
| | | DUKE REALTY CORP | 54,400 | 1,527,008.000 |
| | | EASTGROUP PROPERTIES INC | 5,500 | 551,265.000 |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 10,067 | 2,610,775.780 |
| | | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 18,900 | 600,075.000 |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 11,200 | 1,465,968.000 |
| | | GETTY REALTY CORP | 4,903 | 148,021.570 |
| | | WELLTOWER INC | 56,900 | 4,064,367.000 |
| | | HCP INC | 71,500 | 2,059,200.000 |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 15,700 | 675,414.000 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 25,000 | 665,500.000 |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 18,600 | 568,230.000 |
| | | EQUITY COMMONWEALTH | 18,075 | 566,289.750 |
| | | KILROY REALTY CORP | 15,400 | 1,070,300.000 |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 22,600 | 1,003,666.000 |
| | | LTC PROPERTIES INC | 6,000 | 271,560.000 |
| | | LEXINGTON REALTY TRUST | 32,000 | 276,800.000 |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 17,328 | 1,771,268.160 |
| | | MACERICH CO/THE | 15,900 | 795,954.000 |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 13,600 | 1,324,776.000 |
| | | NATL HEALTH INVESTORS INC | 6,500 | 500,890.000 |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 23,900 | 1,182,333.000 |
| | | REALTY INCOME CORP | 44,117 | 2,817,311.620 |
| | | CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 16,400 | 402,456.000 |
| | | PENN REAL ESTATE INVEST TST | 8,600 | 72,756.000 |
| | | PUBLIC STORAGE | 22,900 | 4,851,594.000 |
| | | PS BUSINESS PARKS INC/CA | 3,100 | 430,156.000 |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 25,820 | 1,622,012.400 |
| | | RPT REALTY | 11,700 | 164,736.000 |
| | | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 14,300 | 335,192.000 |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 13,200 | 1,238,424.000 |
| | | SENIOR HOUSING PROP TRUST | 36,200 | 487,252.000 |
| | | TAUBMAN CENTERS INC | 9,100 | 476,021.000 |
| | | URSTADT BIDDLE - CLASS A | 4,400 | 89,364.000 |
| | | UDR INC | 40,700 | 1,704,923.000 |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1,900 | 129,998.000 |
| | | WP CAREY INC | 24,600 | 1,667,634.000 |
| | | WASHINGTON REIT | 12,000 | 325,920.000 |
| | | WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 17,700 | 502,503.000 |
| | | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 11,300 | 56,839.000 |
| | | AGREE REALTY CORP | 5,200 | 307,216.000 |
| | | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 30,450 | 1,135,785.000 |
| | | CUBESMART | 28,300 | 869,942.000 |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 34,126 | 528,270.480 |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 31,378 | 3,567,364.820 |
| | | CEDAR REALTY TRUST INC | 10,800 | 38,880.000 |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 19,300 | 1,821,727.000 |
| | | HERSHA HOSPITALITY TRUST | 5,275 | 99,908.500 |
| | | INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 16,600 | 87,316.000 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | KITE REALTY GROUP TRUST | 11,950 | 192,992.500 | |
| | | MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 13,400 | 185,992.000 | |
| | | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2,200 | 58,036.000 | |
| | | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 21,000 | 912,660.000 | |
| | | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 3,600 | 68,760.000 | |
| | | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 31,042 | 331,218.140 | |
| | | NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 6,849 | 110,542.860 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 55,700 | 955,255.000 | |
| | | FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 16,300 | 124,206.000 | |
| | | DOUGLAS EMMETT INC | 24,600 | 891,750.000 | |
| | | RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 32,900 | 401,051.000 | |
| | | MANULIFE US REAL ESTATE INV | 168,727 | 129,919.790 | |
| | アメリカ・ドル　小計 | | | アメリカ・ドル<br>125,013,012.530<br>(14,185,226,532) | |
| | イギリス・ポンド | | | イギリス・ポンド | |
| | | ASSURA PLC | 354,050 | 191,187.000 | |
| | | CAPITAL & REGIONAL PLC | 59,270 | 21,870.630 | |
| | | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 86,570 | 81,635.510 | |
| | | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 97,170 | 80,262.420 | |
| | | REGIONAL REIT LTD | 46,310 | 45,383.800 | |
| | | NEWRIVER REIT PLC | 46,330 | 106,559.000 | |
| | | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 22,490 | 24,064.300 | |
| | | LXI REIT PLC | 54,038 | 64,035.030 | |
| | | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 54,330 | 55,959.900 | |
| | | RDI REIT PLC | 205,180 | 65,657.600 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 116,581 | 970,420.240 | |
| | | HANSTEEN HOLDINGS PLC | 60,790 | 57,568.130 | |
| | | SEGRO PLC | 156,630 | 963,274.500 | |
| | | HAMMERSON PLC | 122,640 | 477,192.240 | |
| | | UNITE GROUP PLC | 40,160 | 338,147.200 | |
| | | BRITISH LAND CO PLC | 154,220 | 879,054.000 | |
| | | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 43,551 | 306,032.870 | |
| | | INTU PROPERTIES PLC | 130,670 | 149,617.150 | |
| | | DERWENT LONDON PLC | 17,130 | 499,168.200 | |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 107,560 | 117,240.400 | |
| | | WORKSPACE GROUP PLC | 19,360 | 165,528.000 | |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 30,810 | 163,755.150 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SHAFTESBURY PLC | 35,630 | 315,325.500 | |
| | BIG YELLOW GROUP PLC | 23,730 | 206,925.600 | |
| | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 107,440 | 195,540.800 | |
| | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 76,600 | 42,130.000 | |
| | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 224,960 | 310,669.760 | |
| イギリス・ポンド　小計 | | | イギリス・ポンド<br>6,894,204.930<br>(999,728,657) | |
| イスラエル・シュケル | | | イスラエル・シュケル | |
| | REIT 1 LTD | 9,340 | 131,880.800 | |
| イスラエル・シュケル　小計 | | | イスラエル・シュケル<br>131,880.800<br>(4,035,552) | |
| オーストラリア・ドル | | | オーストラリア・ドル | |
| | CHARTER HALL EDUCATION TRUST | 29,900 | 85,514.000 | |
| | CROMWELL PROPERTY GROUP | 241,180 | 248,415.400 | |
| | RURAL FUNDS GROUP | 50,595 | 113,332.800 | |
| | VIVA ENERGY REIT | 65,550 | 140,932.500 | |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 27,820 | 118,235.000 | |
| | PROPERTYLINK GROUP | 65,670 | 77,490.600 | |
| | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 136,260 | 367,902.000 | |
| | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 39,307 | 145,828.970 | |
| | NATIONAL STORAGE REIT | 91,935 | 159,047.550 | |
| | INDUSTRIA REIT | 11,760 | 32,340.000 | |
| | GDI PROPERTY GROUP | 69,120 | 87,091.200 | |
| | SCENTRE GROUP | 835,070 | 3,348,630.700 | |
| | ARENA REIT | 35,380 | 84,204.400 | |
| | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 21,300 | 67,521.000 | |
| | BWP TRUST | 71,560 | 254,753.600 | |
| | DEXUS | 158,280 | 1,714,172.400 | |
| | GPT GROUP | 279,900 | 1,505,862.000 | |
| | INVESTA OFFICE FUND | 76,690 | 427,930.200 | |
| | CHARTER HALL RETAIL REIT | 48,780 | 222,436.800 | |
| | MIRVAC GROUP | 577,800 | 1,305,828.000 | |
| | STOCKLAND | 378,330 | 1,422,520.800 | |
| | ABACUS PROPERTY GROUP | 45,880 | 148,651.200 | |
| | GOODMAN GROUP | 251,370 | 2,684,631.600 | |
| | VICINITY CENTRES | 501,130 | 1,368,084.900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CHARTER HALL GROUP | 71,370 | 507,440.700 | |
| | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 28,460 | 87,372.200 | |
| オーストラリア・ドル　小計 | | | オーストラリア・ドル<br>16,726,170.520<br>(1,389,610,247) | |
| カナダ・ドル | | | カナダ・ドル | |
| | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10,400 | 102,960.000 | |
| | DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV | 13,900 | 186,399.000 | |
| | SLATE RETAIL REIT - U | 3,100 | 37,417.000 | |
| | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 6,400 | 105,472.000 | |
| | AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA | 2,700 | 38,286.000 | |
| | SLATE OFFICE REIT | 5,100 | 36,210.000 | |
| | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 7,200 | 75,168.000 | |
| | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 4,500 | 43,245.000 | |
| | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 4,200 | 25,494.000 | |
| | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3,400 | 186,422.000 | |
| | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 7,000 | 70,490.000 | |
| | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 7,600 | 98,116.000 | |
| | CHOICE PROPERTIES REIT | 20,500 | 248,870.000 | |
| | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 1,700 | 29,648.000 | |
| | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 5,200 | 63,180.000 | |
| | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 10,300 | 322,390.000 | |
| | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 10,800 | 502,956.000 | |
| | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 13,790 | 146,311.900 | |
| | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 21,866 | 463,996.520 | |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 23,800 | 586,432.000 | |
| | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 5,400 | 129,222.000 | |
| | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3,200 | 134,048.000 | |
| | NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 3,800 | 99,940.000 | |
| | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 6,500 | 84,370.000 | |
| | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 7,700 | 346,500.000 | |
| カナダ・ドル　小計 | | | カナダ・ドル<br>4,163,543.420<br>(355,649,879) | |
| シンガポール・ドル | | | シンガポール・ドル | |
| | KEPPEL DC REIT | 139,728 | 190,030.080 | |
| | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 81,200 | 82,824.000 | |
| | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC | 316,700 | 361,038.000 | |
| | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL | 89,000 | 121,040.000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI | 242,250 | 254,362.500 | |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 434,475 | 764,676.000 | |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 396,100 | 1,025,899.000 | |
| | CAPITALAND MALL TRUST | 419,200 | 947,392.000 | |
| | SUNTEC REIT | 343,800 | 618,840.000 | |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 352,700 | 444,402.000 | |
| | KEPPEL REIT | 283,400 | 328,744.000 | |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 104,960 | 145,894.400 | |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 188,600 | 205,574.000 | |
| | ESR-REIT | 294,337 | 145,696.810 | |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 112,300 | 167,327.000 | |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 89,300 | 193,781.000 | |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 203,800 | 135,527.000 | |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS | 87,600 | 120,012.000 | |
| | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 57,300 | 154,137.000 | |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL | 267,200 | 52,638.400 | |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 191,080 | 359,230.400 | |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 145,200 | 102,366.000 | |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 294,300 | 488,538.000 | |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 127,100 | 77,531.000 | |
| | SPH REIT | 89,600 | 89,600.000 | |
| | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | 95,000 | 55,575.000 | |
| | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 78,100 | 30,849.500 | |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | 108,900 | 84,942.000 | |
| | OUE HOSPITALITY TRUST | 166,873 | 115,142.370 | |
| シンガポール・ドル　小計 | | | シンガポール・ドル<br>7,863,609.460<br>(651,814,588) | |
| ニュージーランド・ドル | | | ニュージーランド・ドル | |
| | STRIDE PROPERTY GROUP | 51,480 | 94,723.200 | |
| | ARGOSY PROPERTY LTD | 128,520 | 148,440.600 | |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 210,260 | 290,158.800 | |
| | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 44,560 | 94,467.200 | |
| | GOODMAN PROPERTY TRUST | 152,500 | 232,562.500 | |
| | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 147,000 | 209,475.000 | |
| ニュージーランド・ドル　小計 | | | ニュージーランド・ドル<br>1,069,827.300<br>(83,307,452) | |
| ユーロ | | | ユーロ | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 24,320 | 299,622.400 | |
| | | HAMBORNER REIT AG | 11,980 | 106,023.000 | |
| | | WERELDHAVE NV | 5,960 | 175,820.000 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 21,340 | 3,300,444.400 | |
| | | EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV | 6,020 | 179,877.600 | |
| | | NSI NV | 2,731 | 98,316.000 | |
| | | VASTNED RETAIL NV | 2,450 | 81,830.000 | |
| | | ICADE | 6,950 | 495,187.500 | |
| | | ALTAREA | 540 | 100,008.000 | |
| | | GECINA SA | 8,501 | 1,066,025.400 | |
| | | KLEPIERRE | 32,160 | 939,715.200 | |
| | | COVIVIO | 8,360 | 730,246.000 | |
| | | MERCIALYS | 8,070 | 104,587.200 | |
| | | AEDIFICA | 2,798 | 208,451.000 | |
| | | COFINIMMO | 3,210 | 345,075.000 | |
| | | BEFIMMO | 3,460 | 175,768.000 | |
| | | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 3,310 | 66,133.800 | |
| | | RETAIL ESTATES | 1,140 | 83,904.000 | |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 2,560 | 296,960.000 | |
| | | BENI STABILI SPA | 143,400 | 105,757.500 | |
| | | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 6,240 | 38,014.080 | |
| | | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 10,530 | 90,031.500 | |
| | | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 45,393 | 402,635.910 | |
| | | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 56,800 | 639,852.000 | |
| | | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 49,010 | 70,084.300 | |
| | | GREEN REIT PLC | 100,940 | 141,316.000 | |
| | | HIBERNIA REIT PLC | 103,100 | 137,535.400 | |
| | ユーロ　小計 | | | ユーロ<br>10,479,221.190<br>(1,353,810,586) | |
| | 香港・ドル | | | 香港・ドル | |
| | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 199,000 | 1,000,970.000 | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 153,000 | 748,170.000 | |
| | | FORTUNE REIT | 218,000 | 1,959,820.000 | |
| | | PROSPERITY REIT | 158,000 | 456,620.000 | |
| | | LINK REIT | 334,000 | 25,200,300.000 | |
| | | CHAMPION REIT | 302,000 | 1,645,900.000 | |
| | 香港・ドル　小計 | | | 香港・ドル<br>31,011,780.000<br>(449,980,928) | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 投資証券　合計 | | 19,473,164,421<br>[19,473,164,421] | |
| 合計 | | 19,629,817,699<br>[19,629,817,699] | |

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<br>投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 投資信託<br>受益証券　1銘柄<br>投資証券　157銘柄 | 1.1% | 98.9% | 73.1% |
| イギリス・ポンド | 投資証券　27銘柄 | -% | 100% | 5.1% |
| イスラエル・シュケル | 投資証券　1銘柄 | -% | 100% | 0.0% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券　26銘柄 | -% | 100% | 7.1% |
| カナダ・ドル | 投資証券　25銘柄 | -% | 100% | 1.8% |
| シンガポール・ドル | 投資証券　29銘柄 | -% | 100% | 3.3% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券　6銘柄 | -% | 100% | 0.4% |
| ユーロ | 投資証券　27銘柄 | -% | 100% | 6.9% |
| 香港・ドル | 投資証券　6銘柄 | -% | 100% | 2.3% |

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 【ダイワファンドラップオンライン 外国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2期計算期間（平成29年12月1日から平成30年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

【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1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | ― | 432,546 |
| コール・ローン | 525,823 | 841,202 |
| 親投資信託受益証券 | 312,229,838 | 561,199,416 |
| 流動資産合計 | 312,755,661 | 562,473,164 |
| 資産合計 | 312,755,661 | 562,473,164 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 150,636 | 357,215 |
| 未払受託者報酬 | 20,873 | 57,235 |
| 未払委託者報酬 | 287,391 | 787,605 |
| その他未払費用 | 5,149 | 14,235 |
| 流動負債合計 | 464,049 | 1,216,290 |
| 負債合計 | 464,049 | 1,216,290 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 303,982,175 | ※1 534,454,266 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 8,309,437 | 26,802,608 |
| （分配準備積立金） | 9,476,798 | 31,709,700 |
| 元本等合計 | 312,291,612 | 561,256,874 |
| 純資産合計 | 312,291,612 | 561,256,874 |
| 負債純資産合計 | 312,755,661 | 562,473,164 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 10,593,338 | 25,932,578 |
| その他収益 | ― | 25 |
| 営業収益合計 | 10,593,338 | 25,932,603 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 63 | 599 |
| 受託者報酬 | 28,711 | 96,615 |
| 委託者報酬 | 395,642 | 1,329,577 |
| その他費用 | 7,022 | 24,042 |
| 営業費用合計 | 431,438 | 1,450,833 |
| 営業利益 | 10,161,900 | 24,481,770 |
| 経常利益 | 10,161,900 | 24,481,770 |
| 当期純利益 | 10,161,900 | 24,481,770 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | 685,164 | 319,081 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | ― | 8,309,437 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 276,171 | ― |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 276,171 | ― |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,443,470 | 5,669,518 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | ― | 701,981 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,443,470 | 4,967,537 |
| 分配金 | ※1　― | ※1　― |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 8,309,437 | 26,802,608 |

### (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2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 10,000,000円 | 303,982,175円 |
| 期中追加設定元本額 | 323,203,250円 | 333,551,014円 |
| 期中一部解約元本額 | 29,221,075円 | 103,078,923円 |
| 2.　計算期間末日における受益権の総数 | 303,982,175口 | 534,454,266口 |

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 第1期<br>自　平成29年1月11日<br>至　平成29年11月30日 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| ※1　分配金の計算過程 | 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（9,476,798円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は9,476,798円（1万口当たり311.76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（24,163,176円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,115,307円）及び分配準備積立金（7,546,524円）より分配対象額は40,825,007円（1万口当たり763.86円）であり、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

| 区　分 | 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|---|
| 1.　金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |
| 2.　金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3.　金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 |

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種　類 | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 10,402,840 | 25,571,249 |
| 合計 | 10,402,840 | 25,571,249 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第2期<br>自　平成29年12月1日<br>至　平成30年11月30日 |
|---|
| 市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 第1期<br>平成29年11月30日現在 | 第2期<br>平成30年11月30日現在 |
|---|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.0273円 | 1.0501円 |

| | | |
|---|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (10,273円) | (10,501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 | 243,291,029 | 561,199,416 | |
| 親投資信託受益証券　合計 | | | 561,199,416 | |
| 合計 | | | 561,199,416 | |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ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）」に記載のとおりであります。

## 【ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス】

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン　ＴＯＰＩＸインデックス

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,746,477 |
| 親投資信託受益証券 | 2,440,666,853 |
| 未収入金 | 654,000 |
| 流動資産合計 | 2,445,067,330 |
| 資産合計 | 2,445,067,330 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 1,740,916 |
| 未払受託者報酬 | 232,646 |
| 未払委託者報酬 | 2,210,482 |
| その他未払費用 | 58,078 |
| 流動負債合計 | 4,242,122 |
| 負債合計 | 4,242,122 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 2,371,670,143 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 69,155,065 |
| （分配準備積立金） | 91,328,140 |
| 元本等合計 | 2,440,825,208 |
| 純資産合計 | 2,440,825,208 |
| 負債純資産合計 | 2,445,067,330 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | △ 197,295,416 |
| 営業収益合計 | △ 197,295,416 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 1,468 |
| 受託者報酬 | 232,646 |
| 委託者報酬 | 2,210,482 |
| その他費用 | 58,179 |
| 営業費用合計 | 2,502,775 |
| 営業損失（△） | △ 199,798,191 |
| 経常損失（△） | △ 199,798,191 |
| 中間純損失（△） | △ 199,798,191 |
| 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | △ 11,474,782 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 217,281,743 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 75,168,602 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 75,168,602 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 34,971,871 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 34,971,871 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 69,155,065 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,797,553,299円 |
| 期中追加設定元本額 | 884,513,758円 |
| 期中一部解約元本額 | 310,396,914円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 2,371,670,143口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0292円<br>(10,292円) |

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2019年5月31日現在<br>金　額（円） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 25,633,881,058 |
| 株式　※3※4 | 131,113,242,940 |
| 未収配当金 | 1,339,006,285 |
| 未収利息 | 2,210,369 |
| 前払金 | 70,693,300 |

| | |
|---|---|
| その他未収収益　※5 | 68,481,875 |
| 流動資産合計 | 158,227,515,827 |
| 資産合計 | 158,227,515,827 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 105,305,520 |
| 未払金 | 1,068,182,272 |
| 未払解約金 | 149,018,200 |
| 受入担保金 | 23,618,009,413 |
| その他未払費用 | 69,069 |
| 流動負債合計 | 24,940,584,474 |
| 負債合計 | 24,940,584,474 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本　※1 | 137,134,203,836 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）　※2 | △3,847,272,483 |
| 元本等合計 | 133,286,931,353 |
| 純資産合計 | 133,286,931,353 |
| 負債純資産合計 | 158,227,515,827 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

| | |
|---|---|
| 2．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1．　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 134,890,694,102円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,724,969,235円 |
| 期中一部解約元本額 | 7,481,459,501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 | 4,073,523,584円 |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ | 7,850,097,932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 | 30,396,804円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 60,746,661円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 976,298,947円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 49,591,649円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 1,345,583,232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） | 16,075,672円 |
| Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス | 40,214,704円 |
| 為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド | 19,956,909円 |

| | |
|---|---|
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 1,615,386円 |
| ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス | 1,058,368,415円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 1,668,197,638円 |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | 39,259,361円 |
| ＤＣダイワ日本株式インデックス | 65,463,869,371円 |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 2,822,872,454円 |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 3,155,894,448円 |
| ダイワ・ライフ・バランス７０ | 2,903,880,442円 |
| 年金ダイワ日本株式インデックス | 4,924,604,053円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 15,526,759円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 51,731,923円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 18,069,602円 |
| ダイワつみたてインデックス日本株式 | 94,482,729円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ | 358,303円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ | 367,695円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型） | 726,124円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ | 4,245,918円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ | 4,248,105円 |
| ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型） | 8,201,794円 |
| ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 168,418,017円 |
| ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 165,937,499円 |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 9,582,574,749円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 534,691円 |

| | | |
|---|---|---|
| | ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 2,894,230円 |
| | ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 825,721,462円 |
| | ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 127,351,633円 |
| | ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用） | 223,926,223円 |
| | ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド | 162,607,666円 |
| | ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス | 8,816,898,397円 |
| | ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 1,824,429,209円 |
| | ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス | 2,511,232,486円 |
| | ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ | 1,422,634,051円 |
| | ダイワライフスタイル２５ | 193,069,689円 |
| | ダイワライフスタイル５０ | 678,512,244円 |
| | ダイワライフスタイル７５ | 558,497,294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） | 13,169,957,682円 |
| 計 | | 137,134,203,836円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 137,134,203,836口 |
| 3. ※2 | 元本の欠損 | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,847,272,483円であります。 |
| 4. ※3 | 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。<br>株式 22,131,142,240円 |
| 5. ※4 | 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。<br>株式 563,220,000円 |
| 6. ※5 | 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64,882,793円が含まれております。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 株価指数 | | | | |
| 先物取引 | | | | |
| 買　建 | 2,258,808,300 | － | 2,153,580,000 | △105,228,300 |
| 合計 | 2,258,808,300 | － | 2,153,580,000 | △105,228,300 |

（注）　1.　時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2.　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

**（1口当たり情報）**

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 0.9719円<br>(9,719円) |

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

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 7,646,996 |
| 親投資信託受益証券 | 2,136,266,143 |
| 未収入金 | 2,210,000 |
| 流動資産合計 | 2,146,123,139 |
| 資産合計 | 2,146,123,139 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 5,815,726 |
| 未払受託者報酬 | 239,293 |
| 未払委託者報酬 | 3,410,707 |
| その他未払費用 | 59,782 |
| 流動負債合計 | 9,525,508 |
| 負債合計 | 9,525,508 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 1,812,616,065 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 323,981,566 |
| （分配準備積立金） | 45,312,606 |
| 元本等合計 | 2,136,597,631 |
| 純資産合計 | 2,136,597,631 |
| 負債純資産合計 | 2,146,123,139 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 84,501,822 |
| 営業収益合計 | 84,501,822 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 1,980 |
| 受託者報酬 | 239,293 |
| 委託者報酬 | 3,410,707 |
| その他費用 | 59,869 |
| 営業費用合計 | 3,711,849 |
| 営業利益 | 80,789,973 |
| 経常利益 | 80,789,973 |
| 中間純利益 | 80,789,973 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 20,029,291 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 273,851,379 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 57,169,404 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 57,169,404 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 67,799,899 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 67,799,899 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 323,981,566 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,924,332,921円 |
| 期中追加設定元本額 | 366,222,270円 |
| 期中一部解約元本額 | 477,939,126円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 1,812,616,065口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.1787円<br>(11,787円) |

（参考）

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 286,722,301 |
| コール・ローン | 821,381,972 |
| 株式 | 37,393,684,383 |
| 投資証券 | 1,122,705,902 |
| 派生商品評価勘定 | 595,818,626 |

| | |
|---|---|
| 未収入金 | 22,456,679 |
| 未収配当金 | 92,701,515 |
| 差入委託証拠金 | 304,134,331 |
| 流動資産合計 | 40,639,605,709 |
| 資産合計 | 40,639,605,709 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 22,283,122 |
| 未払金 | 48,609,188 |
| 未払解約金 | 19,305,000 |
| その他未払費用 | 704 |
| 流動負債合計 | 90,198,014 |
| 負債合計 | 90,198,014 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 21,543,325,848 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 19,006,081,847 |
| 元本等合計 | 40,549,407,695 |
| 純資産合計 | 40,549,407,695 |
| 負債純資産合計 | 40,639,605,709 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

| | |
|---|---|
| | (2)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 1.　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 21,183,891,958円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,238,301,835円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,878,867,945円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 18,521,770,351円 |
| ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 1,134,983,606円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） | 307,932,809円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 1,155,910円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 9,832,427円 |
| ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 1,567,650,745円 |
| 計 | 21,543,325,848円 |
| | |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 21,543,325,848口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 株価指数先物取引 | | | | |
| 買　建 | 1,233,291,808 | － | 1,212,485,172 | △20,806,636 |
| 合計 | 1,233,291,808 | － | 1,212,485,172 | △20,806,636 |

（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 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売　建 | 41,512,881,243 | － | 40,918,539,103 | 594,342,140 |
| アメリカ・ドル | 28,330,440,035 | － | 28,034,367,930 | 296,072,105 |
| イギリス・ポンド | 2,645,130,841 | － | 2,514,447,036 | 130,683,805 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| イスラエル・シュケル | 47,513,950 | － | 46,354,345 | 1,159,605 |
| オーストラリア・ドル | 1,047,612,602 | － | 1,023,319,793 | 24,292,809 |
| カナダ・ドル | 1,528,853,329 | － | 1,502,071,613 | 26,781,716 |
| シンガポール・ドル | 210,146,400 | － | 205,554,312 | 4,592,088 |
| スイス・フラン | 1,338,901,103 | － | 1,336,420,206 | 2,480,897 |
| スウェーデン・クローナ | 438,777,655 | － | 433,859,556 | 4,918,099 |
| デンマーク・クローネ | 272,654,466 | － | 267,678,600 | 4,975,866 |
| ニュージーランド・ドル | 37,315,555 | － | 36,351,432 | 964,123 |
| ノルウェー・クローネ | 111,362,550 | － | 109,385,700 | 1,976,850 |
| ユーロ | 4,887,439,546 | － | 4,798,917,756 | 88,521,790 |
| 香港・ドル | 616,733,211 | － | 609,810,824 | 6,922,387 |
| 合計 | 41,512,881,243 | － | 40,918,539,103 | 594,342,140 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額 | 1.8822円 |

| | |
|---|---|
| （1万口当たり純資産額） | (18,822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）】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン 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)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 18,978,824 |
| 親投資信託受益証券 | 1,637,399,871 |
| 未収入金 | 120,000 |
| 流動資産合計 | 1,656,498,695 |
| 資産合計 | 1,656,498,695 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 2,963,852 |
| 未払受託者報酬 | 179,328 |
| 未払委託者報酬 | 2,645,700 |
| その他未払費用 | 44,801 |
| 流動負債合計 | 5,833,681 |
| 負債合計 | 5,833,681 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 1,443,606,474 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 207,058,540 |
| （分配準備積立金） | 49,564,745 |
| 元本等合計 | 1,650,665,014 |
| 純資産合計 | 1,650,665,014 |
| 負債純資産合計 | 1,656,498,695 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | △ 8,398,211 |
| 営業収益合計 | △ 8,398,211 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 6,727 |
| 受託者報酬 | 179,328 |
| 委託者報酬 | 2,645,700 |
| その他費用 | 45,303 |
| 営業費用合計 | 2,877,058 |
| 営業損失（△） | △ 11,275,269 |
| 経常損失（△） | △ 11,275,269 |
| 中間純損失（△） | △ 11,275,269 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 4,672,052 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 219,747,125 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 43,998,116 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 43,998,116 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 40,739,380 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 40,739,380 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 207,058,540 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 1,417,526,848円 |
| 期中追加設定元本額 | 293,572,004円 |
| 期中一部解約元本額 | 267,492,378円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 1,443,606,474口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.1434円<br>(11,434円) |

（参考）

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

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

| | 2019年5月31日現在<br>金　額（円） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 477,211,593 |
| コール・ローン | 657,931,001 |
| 株式 | 104,607,938,513 |
| 投資証券 | 3,065,289,476 |
| 派生商品評価勘定 | 60,588 |

| | |
|---|---|
| 未収入金 | 29,852,491 |
| 未収配当金 | 246,626,252 |
| 差入委託証拠金 | 529,774,376 |
| 流動資産合計 | 109,614,684,290 |
| 資産合計 | 109,614,684,290 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 38,237,298 |
| 未払金 | 611,537,106 |
| 未払解約金 | 19,660,300 |
| その他未払費用 | 242 |
| 流動負債合計 | 669,434,946 |
| 負債合計 | 669,434,946 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 44,628,273,602 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 64,316,975,742 |
| 元本等合計 | 108,945,249,344 |
| 純資産合計 | 108,945,249,344 |
| 負債純資産合計 | 109,614,684,290 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

| | |
|---|---|
| | (2)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 1.　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 43,964,024,902円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,891,561,132円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,227,312,432円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワ外国株式インデックスＶＡ | 465,436,944円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 12,197,180円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 166,747,782円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 19,605,630円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 536,410,008円 |
| 外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用） | 2,841,001円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 564,006,956円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） | 1,670,052,387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） | 537,878,792円 |
| Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス | 6,496,960円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 441,378円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） | 887,982,883円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 664,732,732円 |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | 15,735,595円 |
| ＤＣダイワ外国株式インデックス | 28,307,321,069円 |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 566,316,775円 |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 845,096,866円 |

| | | |
|---|---|---|
| | ダイワ・ライフ・バランス７０ | 647,722,261円 |
| | 大和ＤＣ海外株式インデックスファンド | 1,490,572,021円 |
| | ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 3,377,054円 |
| | ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 13,224,319円 |
| | ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 4,114,724円 |
| | ダイワつみたてインデックス外国株式 | 48,899,893円 |
| | ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ | 73,977円 |
| | ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ | 151,649円 |
| | ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ | 1,168,038円 |
| | ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ | 1,759,327円 |
| | ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 201,197,830円 |
| | ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 330,653,891円 |
| | ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 2,865,438,066円 |
| | ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 147,919,110円 |
| | ダイワ・インデックスセレクト外国株式 | 659,889,033円 |
| | ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド | 105,242,619円 |
| | ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用） | 452,701円 |
| | ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス | 2,693,918,139円 |
| | ダイワライフスタイル２５ | 19,377,609円 |
| | ダイワライフスタイル５０ | 68,025,943円 |
| | ダイワライフスタイル７５ | 55,794,460円 |
| 計 | | 44,628,273,602円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 44,628,273,602口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>1年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 株価指数 | | | | |
| 先物取引 | | | | |
| 買　建 | 1,258,897,640 | － | 1,220,676,320 | △38,221,320 |
| 合計 | 1,258,897,640 | － | 1,220,676,320 | △38,221,320 |

（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 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち１年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 買　建 | 609,698,390 | － | 609,743,000 | 44,610 |
| アメリカ・ドル | 535,646,160 | － | 535,696,000 | 49,840 |
| イギリス・ポンド | 34,454,250 | － | 34,450,000 | △4,250 |
| オーストラリア・ドル | 17,365,460 | － | 17,365,000 | △460 |
| カナダ・ドル | 19,387,968 | － | 19,387,200 | △768 |
| ニュージーランド・ドル | 2,844,552 | － | 2,844,800 | 248 |
| 合計 | 609,698,390 | － | 609,743,000 | 44,610 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.4412円<br>(24,412円) |

「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

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 72,557,114 |
| コール・ローン | 41,827,316 |
| 株式 | 6,220,019,712 |
| 投資証券 | 516,786,202 |
| 派生商品評価勘定 | 99,518 |
| 未収配当金 | 24,766,895 |
| 差入委託証拠金 | 24,307,320 |
| 流動資産合計 | 6,900,364,077 |
| 資産合計 | 6,900,364,077 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 5,161,190 |
| 未払金 | 55,968,380 |
| 未払解約金 | 30,000 |
| その他未払費用 | 77 |
| 流動負債合計 | 61,159,647 |
| 負債合計 | 61,159,647 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本　※1 | 4,519,681,719 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,319,522,711 |
| 元本等合計 | 6,839,204,430 |
| 純資産合計 | 6,839,204,430 |

| | |
|---|---|
| 負債純資産合計 | 6,900,364,077 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(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。<br>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<br>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1．　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 3,983,740,010円 |
| 期中追加設定元本額 | 724,025,824円 |
| 期中一部解約元本額 | 188,084,115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（FOFs用）（適格機関投資家専用） | 8,323,453円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 224,064,642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） | 214,333,971円 |

| | | |
|---|---|---|
| | Ｄ－Ｉ'ｓ 新興国株式インデックス | 93,269,259円 |
| | ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス | 1,531,209,010円 |
| | ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 1,098,905,666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 | 924,695,237円 |
| | ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 | 364,406,254円 |
| | ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド | 60,474,227円 |
| 計 | | 4,519,681,719円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 4,519,681,719口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 市場取引<br><br>株価指数<br>先物取引<br><br>買　建 | 75,770,076 | － | 70,757,014 | △5,013,062 |
| 合計 | 75,770,076 | － | 70,757,014 | △5,013,062 |

（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 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引以外の取引<br><br>為替予約取引<br><br>買　建 | 10,962,610 | － | 10,914,000 | △48,610 |
| アメリカ・ドル | 10,962,610 | － | 10,914,000 | △48,610 |
| 合計 | 10,962,610 | － | 10,914,000 | △48,610 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.5132円<br>(15,132円) |

**【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,575,123 |
| 親投資信託受益証券 | 2,083,967,603 |
| 流動資産合計 | 2,087,542,726 |
| 資産合計 | 2,087,542,726 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 270,791 |
| 未払受託者報酬 | 116,987 |
| 未払委託者報酬 | 1,053,274 |
| その他未払費用 | 58,430 |
| 流動負債合計 | 1,499,482 |
| 負債合計 | 1,499,482 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 2,033,165,594 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 52,877,650 |
| （分配準備積立金） | 2,306,784 |
| 元本等合計 | 2,086,043,244 |
| 純資産合計 | 2,086,043,244 |
| 負債純資産合計 | 2,087,542,726 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 51,792,379 |
| 営業収益合計 | 51,792,379 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 2,282 |
| 受託者報酬 | 116,987 |
| 委託者報酬 | 1,053,274 |
| その他費用 | 58,614 |
| 営業費用合計 | 1,231,157 |
| 営業利益 | 50,561,222 |
| 経常利益 | 50,561,222 |
| 中間純利益 | 50,561,222 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 9,049,489 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 5,410,368 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,757,922 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,757,922 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,802,373 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,802,373 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 52,877,650 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 2,156,165,819円 |
| 期中追加設定元本額 | 540,518,219円 |
| 期中一部解約元本額 | 663,518,444円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 2,033,165,594口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0260円<br>(10,260円) |

（参考）

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 318,612,580 |
| 国債証券 | 68,619,637,360 |
| 地方債証券 | 4,258,984,300 |
| 特殊債券 | 3,038,197,800 |
| 社債券 | 3,214,418,000 |
| 未収入金 | 404,252,000 |

| | |
|---|---|
| 未収利息 | 190,215,009 |
| 前払費用 | 3,219,222 |
| 流動資産合計 | 80,047,536,271 |
| 資産合計 | 80,047,536,271 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 151,425,000 |
| 未払解約金 | 199,700,940 |
| その他未払費用 | 616 |
| 流動負債合計 | 351,126,556 |
| 負債合計 | 351,126,556 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 55,694,177,433 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 24,002,232,282 |
| 元本等合計 | 79,696,409,715 |
| 純資産合計 | 79,696,409,715 |
| 負債純資産合計 | 80,047,536,271 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31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<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 1.　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 56,170,487,793円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,924,937,246円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,401,247,606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) | 110,544,053円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 695,407,858円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 81,173,073円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 941,805,563円 |
| ＤＣダイワ日本債券インデックス | 6,624,352,852円 |
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 11,990,994,559円 |
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 2,032,404,440円 |
| ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 273,700,515円 |
| ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用） | 377,796,020円 |
| ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド | 76,740,301円 |
| ダイワファンドラップ 日本債券インデックス | 18,773,312,277円 |
| ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 3,350,910,901円 |
| ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス | 1,456,301,610円 |
| ダイワ・インデックスセレクト日本債券 | 1,193,875,632円 |
| ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス | 6,669,658,876円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 437,855,405円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 473,545,800円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 133,797,698円 |
| 計 | 55,694,177,433円 |

| | |
|---|---|
| 2.　期末日における受益権の総数 | 55,694,177,433口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.4310円<br>(14,310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）】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 14,796,310 |
| 親投資信託受益証券 | 3,452,082,740 |
| 未収入金 | 9,525,254 |
| 流動資産合計 | 3,476,404,304 |
| 資産合計 | 3,476,404,304 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 16,165,364 |
| 未払受託者報酬 | 388,550 |
| 未払委託者報酬 | 4,274,552 |
| その他未払費用 | 145,673 |
| 流動負債合計 | 20,974,139 |
| 負債合計 | 20,974,139 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 3,363,034,669 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 92,395,496 |
| （分配準備積立金） | 4,198,954 |
| 元本等合計 | 3,455,430,165 |
| 純資産合計 | 3,455,430,165 |
| 負債純資産合計 | 3,476,404,304 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 153,924,886 |
| 営業収益合計 | 153,924,886 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 4,217 |
| 受託者報酬 | 388,550 |
| 委託者報酬 | 4,274,552 |
| その他費用 | 145,893 |
| 営業費用合計 | 4,813,212 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 149,111,674 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 149,111,674 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 149,111,674 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 22,830,249 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | △ 51,000,019 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 17,114,090 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 12,140,878 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,973,212 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 92,395,496 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 3,649,169,243円 |
| 期中追加設定元本額 | 727,616,316円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,013,750,890円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 3,363,034,669口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0275円<br>(10,275円) |

（参考）

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 271,704,552 |
| コール・ローン | 1,479,419,609 |
| 国債証券 | 82,167,864,805 |
| 派生商品評価勘定 | 1,917,817,642 |
| 未収入金 | 39,099,755 |

| | |
|---|---|
| 未収利息 | 538,055,341 |
| 前払費用 | 23,866,631 |
| 差入委託証拠金 | 116,887,102 |
| 流動資産合計 | 86,554,715,437 |
| 資産合計 | 86,554,715,437 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 101,044 |
| 未払解約金 | 41,374,013 |
| その他未払費用 | 1,507 |
| 流動負債合計 | 41,476,564 |
| 負債合計 | 41,476,564 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 87,271,890,608 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2 | △758,651,735 |
| 元本等合計 | 86,513,238,873 |
| 純資産合計 | 86,513,238,873 |
| 負債純資産合計 | 86,554,715,437 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

| | |
|---|---|
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 85,791,284,610円 |
| 期中追加設定元本額 | 10,488,342,391円 |
| 期中一部解約元本額 | 9,007,736,393円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） | 72,200,931,593円 |
| ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） | 3,482,379,442円 |

| | |
|---|---|
| ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 11,588,579,573円 |
| 計 | 87,271,890,608円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 87,271,890,608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758,651,735円であります。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．債券関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち１年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 債券先物取引 | | | | |
| 買　建 | 1,050,358,836 | － | 1,052,774,460 | 2,415,624 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合計 | 1,050,358,836 | － | 1,052,774,460 | 2,415,624 |

（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 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売　建 | 83,747,903,144 | － | 81,832,602,170 | 1,915,300,974 |
| アメリカ・ドル | 39,667,786,865 | － | 39,022,322,370 | 645,464,495 |
| イギリス・ポンド | 5,507,098,162 | － | 5,228,992,710 | 278,105,452 |
| オーストラリア・ドル | 1,729,093,497 | － | 1,667,649,590 | 61,443,907 |
| カナダ・ドル | 1,728,653,819 | － | 1,688,772,360 | 39,881,459 |
| シンガポール・ドル | 320,125,232 | － | 310,542,400 | 9,582,832 |
| スウェーデン・クローナ | 390,992,631 | － | 382,328,520 | 8,664,111 |
| デンマーク・クローネ | 429,797,452 | － | 418,698,100 | 11,099,352 |
| ノルウェー・クローネ | 186,205,276 | － | 180,188,850 | 6,016,426 |
| ポーランド・ズロチ | 501,248,836 | － | 489,380,160 | 11,868,676 |
| マレーシア・リンギット | 293,046,504 | － | 292,828,800 | 217,704 |
| メキシコ・ペソ | 605,352,386 | － | 583,984,800 | 21,367,586 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ユーロ | 31,933,902,295 | － | 31,132,326,720 | 801,575,575 |
| 南アフリカ・ランド | 454,600,189 | － | 434,586,790 | 20,013,399 |
| 合計 | 83,747,903,144 | － | 81,832,602,170 | 1,915,300,974 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 0.9913円<br>(9,913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）】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン 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)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 11,370,407 |
| 親投資信託受益証券 | 2,670,291,671 |
| 未収入金 | 3,003,539 |
| 流動資産合計 | 2,684,665,617 |
| 資産合計 | 2,684,665,617 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 8,210,398 |
| 未払受託者報酬 | 273,729 |
| 未払委託者報酬 | 3,148,405 |
| その他未払費用 | 102,615 |
| 流動負債合計 | 11,735,147 |
| 負債合計 | 11,735,147 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 2,614,509,710 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 58,420,760 |
| （分配準備積立金） | 25,237,175 |
| 元本等合計 | 2,672,930,470 |
| 純資産合計 | 2,672,930,470 |
| 負債純資産合計 | 2,684,665,617 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 1,982,303 |
| 営業収益合計 | 1,982,303 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 2,886 |
| 受託者報酬 | 273,729 |
| 委託者報酬 | 3,148,405 |
| その他費用 | 102,756 |
| 営業費用合計 | 3,527,776 |
| 営業損失（△） | △ 1,545,473 |
| 経常損失（△） | △ 1,545,473 |
| 中間純損失（△） | △ 1,545,473 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 3,032,867 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 53,107,629 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 20,410,244 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 20,410,244 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 10,518,773 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 10,518,773 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 58,420,760 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 2,389,228,743円 |
| 期中追加設定元本額 | 692,879,769円 |
| 期中一部解約元本額 | 467,598,802円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 2,614,509,710口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0223円<br>(10,223円) |

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

| | 2019年5月31日現在<br>金　額（円） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,650,778,791 |
| コール・ローン | 955,340,439 |
| 国債証券 | 170,561,258,660 |
| 未収利息 | 1,222,990,803 |
| 前払費用 | 31,229,606 |

| | |
|---|---|
| 流動資産合計 | 174,421,598,299 |
| 資産合計 | 174,421,598,299 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 565,471 |
| 未払金 | 548,772,893 |
| 未払解約金 | 115,345,161 |
| その他未払費用 | 2,684 |
| 流動負債合計 | 664,686,209 |
| 負債合計 | 664,686,209 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 62,716,189,447 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 111,040,722,643 |
| 元本等合計 | 173,756,912,090 |
| 純資産合計 | 173,756,912,090 |
| 負債純資産合計 | 174,421,598,299 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 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。<br>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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1．※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 61,445,933,589円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,051,866,337円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,781,610,479円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワ外国債券インデックスＶＡ | 646,989,957円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 22,454,828円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 152,843,057円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募) | 41,724,252円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募) | 484,204,601円 |
| 外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用） | 10,513,906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） | 388,409,650円 |
| ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） | 1,248,238,563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） | 771,688,522円 |
| Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス | 2,265,454円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 61,299円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス | 556,584,417円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 597,352,248円 |
| ｉＦｒｅｅ 年金バランス | 8,446,083円 |
| ＤＣダイワ外国債券インデックス | 43,740,646,206円 |
| ダイワ・ライフ・バランス３０ | 759,335,471円 |
| ダイワ・ライフ・バランス５０ | 377,634,416円 |
| ダイワ・ライフ・バランス７０ | 231,514,040円 |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） | 360,334,480円 |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース） | 284,809,971円 |
| ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） | 92,698,229円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 10,216,687円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 18,593,922円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 2,100,634円 |
| ダイワつみたてインデックス外国債券 | 25,338,842円 |
| ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ | 218,270,670円 |
| ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ | 154,401,436円 |

| | |
|---|---|
| ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ | 5,272,526,588円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド５０ＶＡ | 815,488円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ | 1,574,412円 |
| ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用） | 314,888,512円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国債券 | 147,665,486円 |
| ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド | 30,559,756円 |
| ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用） | 364,363円 |
| ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス | 5,627,577,092円 |
| ダイワライフスタイル２５ | 34,660,334円 |
| ダイワライフスタイル５０ | 60,836,672円 |
| ダイワライフスタイル７５ | 17,048,903円 |
| 計 | 62,716,189,447円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 62,716,189,447口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

**ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引**

**通貨関連**

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち1年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 買　建 | 777,524,401 | － | 776,958,930 | △565,471 |
| アメリカ・ドル | 361,822,355 | － | 361,642,960 | △179,395 |
| イギリス・ポンド | 551,232 | － | 550,720 | △512 |
| オーストラリア・ドル | 3,850,994 | － | 3,845,400 | △5,594 |
| カナダ・ドル | 51,595,479 | － | 51,528,960 | △66,519 |
| シンガポール・ドル | 23,732,703 | － | 23,721,000 | △11,703 |
| スウェーデン・クローナ | 2,156,276 | － | 2,154,480 | △1,796 |
| デンマーク・クローネ | 7,784,257 | － | 7,775,100 | △9,157 |
| ノルウェー・クローネ | 12,093,167 | － | 12,081,960 | △11,207 |
| ポーランド・ズロチ | 23,728,799 | － | 23,695,470 | △33,329 |
| マレーシア・リンギット | 12,502,080 | － | 12,499,200 | △2,880 |
| メキシコ・ペソ | 20,124,048 | － | 20,077,160 | △46,888 |
| ユーロ | 249,504,358 | － | 249,323,520 | △180,838 |
| 南アフリカ・ランド | 8,078,653 | － | 8,063,000 | △15,653 |
| 合計 | 777,524,401 | － | 776,958,930 | △565,471 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.7705円<br>(27,705円) |

「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

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 111,722,605 |
| コール・ローン | 148,813,922 |
| 国債証券 | 11,776,595,348 |
| 派生商品評価勘定 | 60,588 |
| 未収入金 | 34,671,473 |
| 未収利息 | 229,805,475 |
| 前払費用 | 18,432,356 |
| 流動資産合計 | 12,320,101,767 |
| 資産合計 | 12,320,101,767 |
| 負債の部 | |

| | |
|---|---|
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,649,900 |
| 未払金 | 124,416,674 |
| 未払解約金 | 35,182 |
| その他未払費用 | 121 |
| 流動負債合計 | 126,101,877 |
| 負債合計 | 126,101,877 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 9,241,310,166 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 2,952,689,724 |
| 元本等合計 | 12,193,999,890 |
| 純資産合計 | 12,193,999,890 |
| 負債純資産合計 | 12,320,101,767 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br><br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 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。<br>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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1．※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 8,027,339,497円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,495,846,761円 |
| 期中一部解約元本額 | 281,876,092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） | 8,376,997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） | 202,950,606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） | 403,432,074円 |
| Ｄ－Ｉ'ｓ 新興国債券インデックス | 57,710,555円 |
| ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス | 2,131,364,817円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 1,248,817,531円 |

| | |
|---|---|
| ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド | 4,979,465,675円 |
| ダイワ・インデックスセレクト新興国債券 | 177,783,585円 |
| ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド | 31,408,326円 |
| 計 | 9,241,310,166円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 9,241,310,166口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売　建 | 25,821,476 | － | 25,812,031 | 9,445 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アメリカ・ドル | 25,821,476 | － | 25,812,031 | 9,445 |
| 買　建 | 186,160,939 | － | 184,562,182 | △1,598,757 |
| アメリカ・ドル | 17,479,457 | － | 17,492,800 | 13,343 |
| コロンビア・ペソ | 25,821,476 | － | 25,765,580 | △55,896 |
| チェコ・コルナ | 11,774,112 | － | 11,656,000 | △118,112 |
| ハンガリー・フォリント | 12,319,622 | － | 12,237,702 | △81,920 |
| ポーランド・ズロチ | 9,727,708 | － | 9,645,800 | △81,908 |
| マレーシア・リンギット | 52,082,800 | － | 52,080,000 | △2,800 |
| メキシコ・ペソ | 26,842,592 | － | 26,310,900 | △531,692 |
| ルーマニア・レイ | 13,471,880 | － | 13,306,800 | △165,080 |
| 南アフリカ・ランド | 16,641,292 | － | 16,066,600 | △574,692 |
| 合計 | 211,982,415 | － | 210,374,213 | △1,589,312 |

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| **1口当たり純資産額**<br>**（1万口当たり純資産額）** | **1.3195円**<br>**(13,195円)** |

**【ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

### ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,522,054 |
| 親投資信託受益証券 | 1,080,741,027 |
| 未収入金 | 643,000 |
| 流動資産合計 | 1,084,906,081 |
| 資産合計 | 1,084,906,081 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 2,427,149 |
| 未払受託者報酬 | 111,066 |
| 未払委託者報酬 | 1,055,512 |
| その他未払費用 | 27,696 |
| 流動負債合計 | 3,621,423 |
| 負債合計 | 3,621,423 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 949,834,808 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 131,449,850 |
| （分配準備積立金） | 71,819,511 |
| 元本等合計 | 1,081,284,658 |
| 純資産合計 | 1,081,284,658 |
| 負債純資産合計 | 1,084,906,081 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 74,614,892 |
| 営業収益合計 | 74,614,892 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 1,547 |
| 受託者報酬 | 111,066 |
| 委託者報酬 | 1,055,512 |
| その他費用 | 27,800 |
| 営業費用合計 | 1,195,925 |
| 営業利益 | 73,418,967 |
| 経常利益 | 73,418,967 |
| 中間純利益 | 73,418,967 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額 | 4,649,343 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 56,762,280 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 18,588,637 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 18,588,637 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 12,670,691 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 12,670,691 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 131,449,850 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 970,641,025円 |
| 期中追加設定元本額 | 189,109,235円 |
| 期中一部解約元本額 | 209,915,452円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 949,834,808口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.1384円<br>(11,384円) |

（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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「ダイワ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

| | 2019年5月31日現在<br>金　額（円） |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,003,192,438 |
| 投資証券　※2 | 269,913,045,900 |
| 派生商品評価勘定 | 161,384,000 |
| 未収配当金 | 1,756,447,630 |
| 流動資産合計 | 276,834,069,968 |

| | |
|---|---|
| 資産合計 | 276,834,069,968 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 213,600,000 |
| 未払金 | 2,749,909,314 |
| 未払解約金 | 33,529,400 |
| その他未払費用 | 9,240 |
| 流動負債合計 | 2,997,047,954 |
| 負債合計 | 2,997,047,954 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 ※1 | 94,901,596,207 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 178,935,425,807 |
| 元本等合計 | 273,837,022,014 |
| 純資産合計 | 273,837,022,014 |
| 負債純資産合計 | 276,834,069,968 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 1.　有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 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。<br>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3．　収益及び費用の計上基準 | 受取配当金<br>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1．　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 83,907,324,720円 |
| 期中追加設定元本額 | 13,552,898,943円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,558,627,456円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン | 6,930,989,301円 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型） | 79,382,113,699円 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型） | 339,254,834円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 70,328円 |
| ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 105,930,548円 |
| ｉＦｒｅｅ　８資産バランス | 578,528,284円 |
| ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン | 4,355,304,593円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 2,459,270円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 4,848,555円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 1,333,486円 |
| ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド | 49,188,913円 |
| ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 1,074,953,085円 |
| ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用） | 426,973,878円 |

| | |
|---|---|
| ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス | 374,542,030円 |
| ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ | 1,275,105,403円 |
| 計 | 94,901,596,207円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 94,901,596,207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。<br>投資証券　445,200,000円 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等（円） | うち１年超 | 時価（円） | 評価損益（円） |
| 市場取引 | | | | |
| 不動産投信 | | | | |
| 指数先物取引 | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 買　建 | 3,672,400,000 | － | 3,834,000,000 | 161,600,000 |
| 合計 | 3,672,400,000 | － | 3,834,000,000 | 161,600,000 |

（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）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.8855円<br>(28,855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）】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

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

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,389,716 |
| 親投資信託受益証券 | 773,330,673 |
| 派生商品評価勘定 | 11,381,756 |
| 未収入金 | 589,387 |
| 流動資産合計 | 788,691,532 |
| 資産合計 | 788,691,532 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,331 |
| 未払解約金 | 1,847,269 |
| 未払受託者報酬 | 84,328 |
| 未払委託者報酬 | 1,160,043 |
| その他未払費用 | 20,991 |
| 流動負債合計 | 3,113,962 |
| 負債合計 | 3,113,962 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 719,863,440 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 65,714,130 |
| （分配準備積立金） | 16,392,739 |
| 元本等合計 | 785,577,570 |
| 純資産合計 | 785,577,570 |
| 負債純資産合計 | 788,691,532 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 23,569,150 |
| 為替差損益 | 22,010,395 |
| その他収益 | 2,659 |
| 営業収益合計 | 45,582,204 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 1,662 |
| 受託者報酬 | 84,328 |
| 委託者報酬 | 1,160,043 |
| その他費用 | 31,858 |
| 営業費用合計 | 1,277,891 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 44,304,313 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 44,304,313 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 44,304,313 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 5,913,690 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 23,578,880 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,733,047 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,733,047 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,988,420 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 4,988,420 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 65,714,130 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31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<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 為替予約取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 743,572,984円 |
| 期中追加設定元本額 | 124,796,123円 |
| 期中一部解約元本額 | 148,505,667円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 719,863,440口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種　類 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 売　建 | 780,916,704 | － | 769,536,279 | 11,380,425 |
| アメリカ・ドル | 566,093,169 | － | 560,242,398 | 5,850,771 |
| イギリス・ポンド | 42,252,760 | － | 40,165,785 | 2,086,975 |
| イスラエル・シュケル | 527,573 | － | 514,881 | 12,692 |
| オーストラリア・ドル | 52,954,313 | － | 51,703,101 | 1,251,212 |
| カナダ・ドル | 14,552,597 | － | 14,286,444 | 266,153 |
| シンガポール・ドル | 27,772,196 | － | 27,148,694 | 623,502 |
| ニュージーランド・ドル | 3,535,328 | － | 3,441,724 | 93,604 |
| ユーロ | 53,145,439 | － | 52,177,764 | 967,675 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 香港・ドル | 20,083,329 | － | 19,855,488 | 227,841 |
| 合計 | 780,916,704 | － | 769,536,279 | 11,380,425 |

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0913円<br>(10,913円) |

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

**貸借対照表**

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| | 金　額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 126,051,005 |
| コール・ローン | 139,673,313 |
| 投資信託受益証券 | 163,443,660 |
| 投資証券 | 21,213,772,041 |
| 派生商品評価勘定 | 2,027,461 |
| 未収入金 | 734,735 |
| 未収配当金 | 36,373,027 |
| 差入委託証拠金 | 51,425,500 |
| 流動資産合計 | 21,733,500,742 |
| 資産合計 | 21,733,500,742 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,216,340 |
| 未払金 | 123,175,285 |
| 未払解約金 | 1,098,000 |
| その他未払費用 | 352 |
| 流動負債合計 | 125,489,977 |
| 負債合計 | 125,489,977 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本　※1 | 9,137,609,140 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 12,470,401,625 |
| 元本等合計 | 21,608,010,765 |
| 純資産合計 | 21,608,010,765 |
| 負債純資産合計 | 21,733,500,742 |

**注記表**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31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<br><br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。<br><br>(2)投資証券<br>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。<br>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。<br>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>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<br>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |

| | |
|---|---|
| 4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準<br><br>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 | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首 | 2018年12月1日 |
| 期首元本額 | 8,618,915,071円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,092,101,933円 |
| 期中一部解約元本額 | 573,407,864円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| ファンド名 | |
| ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） | 4,407,798,668円 |
| ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし） | 659,305,893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） | 327,031,198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） | 229,189,860円 |
| Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス | 1,216,664円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 | 70,488円 |
| ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス | 84,453,429円 |
| ｉＦｒｅｅ ８資産バランス | 683,328,997円 |
| ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド | 1,961,612,839円 |

| | |
|---|---|
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 | 2,923,729円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 | 5,803,252円 |
| ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 | 1,403,212円 |
| ダイワ・インデックスセレクトグローバルＲＥＩＴ | 246,768,153円 |
| ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド | 30,016,739円 |
| ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） | 276,603,041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） | 220,082,978円 |
| 計 | 9,137,609,140円 |
| 2.　期末日における受益権の総数 | 9,137,609,140口 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 2019年5月31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<br>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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

| 種　類 | 2019年5月31日 現在 | | |
|---|---|---|---|
| | 契約額等 | 時価 | 評価損益 |

| | （円） | うち<br>１年超 | （円） | （円） |
|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | | | | |
| 不動産投信<br>指数先物取引 | | | | |
| 買　建 | 210,136,139 | － | 211,660,524 | 1,524,385 |
| 合計 | 210,136,139 | － | 211,660,524 | 1,524,385 |

（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 | 2019年5月31日 現在 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 契約額等<br>（円） | うち<br>１年超 | 時価<br>（円） | 評価損益<br>（円） |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 買　建 | 116,013,564 | － | 115,300,300 | △713,264 |
| アメリカ・ドル | 100,130,602 | － | 99,465,400 | △665,202 |
| イギリス・ポンド | 6,890,245 | － | 6,889,500 | △745 |
| オーストラリア・ドル | 3,774,480 | － | 3,774,500 | 20 |
| カナダ・ドル | 1,643,862 | － | 1,615,400 | △28,462 |
| ニュージーランド・ドル | 3,574,375 | － | 3,555,500 | △18,875 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合計 | 116,013,564 | － | 115,300,300 | △713,264 |

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

| | 2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 2.3647円<br>(23,647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）】**

**(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。**

**なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。**

**(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。**

## 1【中間財務諸表】

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

#### (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,983,388 |
| 親投資信託受益証券 | 541,965,261 |
| 未収入金 | 389,000 |
| 流動資産合計 | 544,337,649 |
| 資産合計 | 544,337,649 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 1,307,098 |
| 未払受託者報酬 | 59,943 |
| 未払委託者報酬 | 824,829 |
| その他未払費用 | 14,915 |
| 流動負債合計 | 2,206,785 |
| 負債合計 | 2,206,785 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | ※1 504,464,181 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 37,666,683 |
| （分配準備積立金） | 25,387,294 |
| 元本等合計 | 542,130,864 |
| 純資産合計 | 542,130,864 |
| 負債純資産合計 | 544,337,649 |

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 15,053,845 |
| その他収益 | 1,226 |
| 営業収益合計 | 15,055,071 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 443 |
| 受託者報酬 | 59,943 |
| 委託者報酬 | 824,829 |
| その他費用 | 14,921 |
| 営業費用合計 | 900,136 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 14,154,935 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 14,154,935 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 14,154,935 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 2,779,824 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 26,802,608 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,250,842 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,250,842 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,761,878 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 5,761,878 |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 37,666,683 |

### (3) 【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　※1　期首元本額 | 534,454,266円 |
| 期中追加設定元本額 | 86,550,668円 |
| 期中一部解約元本額 | 116,540,753円 |
| 2.　中間計算期間末日における受益権の総数 | 504,464,181口 |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 区　分 | 当中間計算期間<br>自　2018年12月1日<br>至　2019年5月31日 |
|---|---|
| | 該当事項はありません。 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区　分 | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1.　金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.　金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券<br>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<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（1口当たり情報）

| | 当中間計算期間末<br>2019年5月31日現在 |
|---|---|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.0747円<br>(10,747円) |

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ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）」に記載のとおりであります。

## 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】**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 2,526,096,417円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 4,954,993円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 2,521,141,424円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 2,384,880,499口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0571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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 155,598,886,758円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 18,082,616,590円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 137,516,270,168円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 137,726,173,770口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 0.9985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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 2,238,344,672円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 6,472,899円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 2,231,871,773円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 1,814,876,163口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.2298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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 42,901,858,721円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 136,901,286円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 42,764,957,435円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 21,772,570,884口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.9642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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 1,723,062,733円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 5,894,304円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 1,717,168,429円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 1,447,534,997口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.1863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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 114,139,929,196円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 53,087,710円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 114,086,841,486円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 45,109,732,813口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.5291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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 7,329,034,570円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 14,969,275円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 7,314,065,295円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 4,619,178,375口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.5834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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 2,123,584,634円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 7,396,851円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 2,116,187,783円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 2,050,130,588口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0322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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 80,712,492,041円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 123,692,387円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 80,588,799,654円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 55,970,299,440口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.4398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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 3,533,950,341円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 14,745,687円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 3,519,204,654円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 3,372,112,025口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0436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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 90,869,468,717円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 511,510,704円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 90,357,958,013円 |

| | | |
|---|---|---|
| Ⅳ | 発行済数量 | 89,718,119,862口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0071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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 2,740,130,194円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 8,809,268円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 2,731,320,926円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 2,621,258,282口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0420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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 177,245,825,755円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 437,987,039円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 176,807,838,716円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 62,994,327,197口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.8067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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 12,999,581,404円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 48,486,470円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 12,951,094,934円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 9,390,810,527口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.3791円 |

## ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

### 純資産額計算書

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 1,099,921,064円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 2,684,363円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 1,097,236,701円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 949,838,846口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.1552円 |

**(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド**

**純資産額計算書**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 291,116,277,094円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 3,837,598,069円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 287,278,679,025円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 98,093,263,391口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.9286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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 798,329,386円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 3,846,110円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 794,483,276円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 720,210,549口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.1031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**

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 22,332,804,119円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 50,196,769円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 22,282,607,350円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 9,396,786,374口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.3713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

2019年6月28日

| | | |
|---|---|---|
| Ⅰ | 資産総額 | 546,167,285円 |
| Ⅱ | 負債総額 | 1,465,621円 |
| Ⅲ | 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 544,701,664円 |
| Ⅳ | 発行済数量 | 505,571,506口 |
| Ⅴ | １単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.0774円 |

### (参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

前記「ダイワ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）」の記載と同じ。

## 第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

**取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。**

**(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて**

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

# 第三部　【委託会社等の情報】

## 第１　【委託会社等の概況】

### １　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2019年6月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

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．ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績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。

・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。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守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。

2019年6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 | 75 | 145,253 |
| 追加型株式投資信託 | 721 | 15,318,969 |
| 株式投資信託　　合計 | 796 | 15,464,222 |
| 単位型公社債投資信託 | 30 | 111,005 |
| 追加型公社債投資信託 | 14 | 1,392,102 |
| 公社債投資信託　合計 | 44 | 1,503,108 |
| 総合計 | 840 | 16,967,330 |

## 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。

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、当事業年度（2018年４月１日から2019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。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満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<br>（2018年３月31日） | | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|---|---|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金・預金 | | 28,709 | | 28,489 |
| 有価証券 | | 0 | | 554 |
| 前払費用 | | 201 | | 214 |
| 未収委託者報酬 | | 12,368 | | 11,468 |
| 未収収益 | | 82 | | 98 |
| その他 | | 47 | | 56 |
| 流動資産計 | | 41,410 | | 40,882 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | ※1 | 213 | ※1 | 206 |
| 建物 | | 12 | | 10 |
| 器具備品 | | 200 | | 195 |
| 無形固定資産 | | 2,614 | | 2,821 |
| ソフトウェア | | 2,456 | | 2,804 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 158 | | 17 |
| 投資その他の資産 | | 15,066 | | 12,799 |
| 投資有価証券 | | 8,600 | | 8,493 |
| 関係会社株式 | | 5,129 | | 1,836 |
| 出資金 | | 183 | | 183 |
| 長期差入保証金 | | 1,072 | | 1,070 |
| 繰延税金資産 | | 1,078 | | 1,183 |
| その他 | | 34 | | 31 |
| 固定資産計 | | 18,927 | | 15,827 |
| 資産合計 | | 60,337 | | 56,709 |

（単位:百万円）

| | 前事業年度<br>（2018年３月31日） | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 65 | 75 |
| 未払金 | 9,747 | 8,548 |
| 未払収益分配金 | 8 | 15 |
| 未払償還金 | 59 | 40 |
| 未払手数料 | 5,202 | 4,610 |
| その他未払金 | ※2 4,476 | ※2 3,882 |
| 未払費用 | 4,148 | 3,735 |
| 未払法人税等 | 850 | 726 |
| 未払消費税等 | 583 | 255 |
| 賞与引当金 | 1,012 | 725 |
| その他 | 335 | 2 |
| 流動負債計 | 16,744 | 14,070 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 2,350 | 2,389 |
| 役員退職慰労引当金 | 125 | 103 |
| その他 | 5 | 2 |
| 固定負債計 | 2,481 | 2,496 |
| 負債合計 | 19,225 | 16,567 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 15,174 | 15,174 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 11,495 | 11,495 |
| 資本剰余金合計 | 11,495 | 11,495 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 374 | 374 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 13,850 | 13,052 |
| 利益剰余金合計 | 14,225 | 13,426 |
| 株主資本合計 | 40,895 | 40,096 |
| 評価・換算差額等 | | |

| | | |
|---|---|---|
| その他有価証券評価差額金 | 216 | 46 |
| 評価・換算差額等合計 | 216 | 46 |
| 純資産合計 | 41,112 | 40,142 |
| 負債・純資産合計 | 60,337 | 56,709 |

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

| | 前事業年度<br>（自　2017年４月１日<br>至　2018年３月31日） | 当事業年度<br>（自　2018年４月１日<br>至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 82,510 | 76,052 |
| その他営業収益 | 733 | 673 |
| 営業収益計 | 83,244 | 76,725 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 40,392 | 35,789 |
| 広告宣伝費 | 673 | 694 |
| 調査費 | 9,816 | 9,066 |
| 調査費 | 955 | 1,057 |
| 委託調査費 | 8,860 | 8,009 |
| 委託計算費 | 839 | 1,351 |
| 営業雑経費 | 1,579 | 1,557 |
| 通信費 | 249 | 228 |
| 印刷費 | 500 | 513 |
| 協会費 | 53 | 55 |
| 諸会費 | 13 | 13 |
| その他営業雑経費 | 762 | 746 |
| 営業費用計 | 53,300 | 48,459 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 5,840 | 5,755 |
| 役員報酬 | 377 | 373 |
| 給料・手当 | 3,973 | 4,145 |
| 賞与 | 477 | 510 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,012 | 725 |
| 福利厚生費 | 788 | 796 |
| 交際費 | 55 | 64 |
| 旅費交通費 | 195 | 178 |
| 租税公課 | 501 | 472 |
| 不動産賃借料 | 1,281 | 1,291 |
| 退職給付費用 | 316 | 374 |

| | | |
|---|---|---|
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 46 | 34 |
| 固定資産減価償却費 | 977 | 907 |
| 諸経費 | 1,528 | 1,819 |
| 一般管理費計 | 11,531 | 11,693 |
| 営業利益 | 18,411 | 16,572 |

（単位:百万円）

| | 前事業年度<br>（自　2017年４月１日<br>至　2018年３月31日） | 当事業年度<br>（自　2018年４月１日<br>至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 営業外収益 | | |
| 投資有価証券売却益 | 210 | 215 |
| 有価証券償還益 | 17 | 133 |
| その他 | 130 | 172 |
| 営業外収益計 | 359 | 521 |
| 営業外費用 | | |
| 投資有価証券売却損 | 0 | 40 |
| 有価証券償還損 | 3 | 32 |
| その他 | 25 | 60 |
| 営業外費用計 | 29 | 132 |
| 経常利益 | 18,741 | 16,961 |
| 特別損失 | | |
| 関係会社整理損失 | 333 | 29 |
| 特別損失計 | 333 | 29 |
| 税引前当期純利益 | 18,407 | 16,931 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 5,843 | 5,076 |
| 法人税等調整額 | △106 | △15 |
| 法人税等合計 | 5,737 | 5,060 |
| 当期純利益 | 12,670 | 11,870 |

### (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）

（単位：百万円）

| | 株主資本 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | 利益剰余金 | | | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| | | | | 繰越利益剰余金 | | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 当期首残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 12,231 | 12,606 | 39,276 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | - | - | - | 480 | 480 | 480 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 12,712 | 13,086 | 39,756 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △11,532 | △11,532 | △11,532 |
| 当期純利益 | - | - | - | 12,670 | 12,670 | 12,670 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 1,138 | 1,138 | 1,138 |
| 当期末残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 13,850 | 14,225 | 40,895 |

| | 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 | 264 | 264 | 39,540 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | - | - | 480 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 264 | 264 | 40,021 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | △11,532 |
| 当期純利益 | - | - | 12,670 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | △47 | △47 | △47 |
| 当期変動額合計 | △47 | △47 | 1,090 |
| 当期末残高 | 216 | 216 | 41,112 |

当事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

| | 株主資本 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 資本金 | 資本剰余金 | 利益剰余金 | | | 株主資本合計 |
| | | 資本準備金 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | 利益剰余金合計 | |
| | | | | 繰越利益剰余金 | | |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 当期首残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 13,850 | 14,225 | 40,895 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | - | - | - | - | - | - |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 13,850 | 14,225 | 40,895 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | - | △12,669 | △12,669 | △12,669 |
| 当期純利益 | - | - | - | 11,870 | 11,870 | 11,870 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | - | - | - | - | - | - |
| 当期変動額合計 | - | - | - | △798 | △798 | △798 |
| 当期末残高 | 15,174 | 11,495 | 374 | 13,052 | 13,426 | 40,096 |

| | 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 | 216 | 216 | 41,112 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | - | - | - |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 216 | 216 | 41,112 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | - | - | △12,669 |
| 当期純利益 | - | - | 11,870 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | △170 | △170 | △170 |
| 当期変動額合計 | △170 | △170 | △969 |
| 当期末残高 | 46 | 46 | 40,142 |

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
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
時価のあるもの

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。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

| | |
|---|---|
| 建物 | 10～18年 |
| 器具備品 | ４～20年 |

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員･参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年２月16日）を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

（未適用の会計基準等）

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年３月30日）

・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年３月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。

ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年２月16日）等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の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、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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<br>（2018年３月31日） | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 建物 | 29百万円 | 31百万円 |

| | | |
|---|---|---|
| 器具備品 | 235百万円 | 264百万円 |

※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<br>（2018年３月31日） | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 未払金 | 4,406百万円 | 3,788百万円 |

３　保証債務

前事業年度（2018年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万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　2017年４月１日　至　2018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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>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<br>総額（百万円） | １株当たり<br>配当額（円） | 基準日 | 効力発生日 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2017年６月26日<br>定時株主総会 | 普通株式 | 11,532 | 4,421 | 2017年<br>３月31日 | 2017年<br>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

2018年６月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①　剰余金の配当の総額　　12,669百万円

②　配当の原資　　利益剰余金

③　１株当たり配当額　　4,857円
④　基準日　　2018年３月31日
⑤　効力発生日　　2018年６月26日

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2018年６月25日定時株主総会 | 普通株式 | 12,669 | 4,857 | 2018年３月31日 | 2018年６月26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

2019年６月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①　剰余金の配当の総額　　11,868百万円
②　配当の原資　　利益剰余金
③　１株当たり配当額　　4,550円
④　基準日　　2019年３月31日
⑤　効力発生日　　2019年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子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、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）参照のこと）。

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

| | 貸借対照表　計上額(*1) | 時価(*1) | 差額 |
|---|---|---|---|
| （１）現金・預金 | 28,709 | 28,709 | ― |
| （２）未収委託者報酬 | 12,368 | 12,368 | ― |
| （３）有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 7,631 | 7,631 | ― |
| 資産計 | 48,709 | 48,709 | ― |
| （１）未払手数料 | (5,202) | (5,202) | ― |
| （２）その他未払金 | (4,476) | (4,476) | ― |
| （３）未払費用（*2） | (3,286) | (3,286) | ― |
| 負債計 | (12,965) | (12,965) | ― |

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

| | 貸借対照表　計上額(*1) | 時価(*1) | 差額 |
|---|---|---|---|
| （１）現金・預金 | 28,489 | 28,489 | ― |

| | | | |
|---|---|---|---|
| （２）未収委託者報酬 | 11,468 | 11,468 | ― |
| （３）有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券 | 8,380 | 8,380 | ― |
| 資産計 | 48,338 | 48,338 | ― |
| （１）未払手数料 | (4,610) | (4,610) | ― |
| （２）その他未払金 | (3,882) | (3,882) | ― |
| （３）未払費用（*2） | (2,805) | (2,805) | ― |
| 負債計 | (11,298) | (11,298) | ― |

（*1）負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
（*2）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（３）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

| 区分 | 前事業年度<br>（2018年３月31日） | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|
| （１）その他有価証券<br>非上場株式 | 970 | 666 |
| （２）子会社株式及び関連会社株式<br>非上場株式 | 5,129 | 1,836 |
| （３）長期差入保証金 | 1,072 | 1,070 |

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

| | １年以内 | １年超<br>５年以内 | ５年超<br>10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金・預金 | 28,709 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 12,368 | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券のうち満期があるもの | 0 | 5,302 | 1,801 | 117 |
| 合計 | 41,078 | 5,302 | 1,801 | 117 |

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

| | １年以内 | １年超<br>５年以内 | ５年超<br>10年以内 | 10年超 |
|---|---|---|---|---|
| 現金・預金 | 28,489 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 11,468 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券<br>その他有価証券のうち満期があるもの | 554 | 4,284 | 2,227 | 1,227 |
| 合計 | 40,512 | 4,284 | 2,227 | 1,227 |

（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（2018年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2019年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2018年３月31日）

| | 貸借対照表計上額<br>（百万円） | 取得原価<br>（百万円） | 差額<br>（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 | 134 | 55 | 79 |
| （２）その他 | | | |
| 証券投資信託 | 4,196 | 3,740 | 456 |
| 小計 | 4,331 | 3,795 | 535 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | | | |
| 証券投資信託 | 3,299 | 3,522 | △223 |
| 小計 | 3,299 | 3,522 | △223 |
| 合計 | 7,631 | 7,318 | 312 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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（2019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 | 87 | 55 | 32 |
| （２）その他 | | | |
| 証券投資信託 | 4,991 | 4,712 | 278 |
| 小計 | 5,079 | 4,767 | 311 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | | | |
| 証券投資信託 | 3,301 | 3,560 | △258 |
| 小計 | 3,301 | 3,560 | △258 |
| 合計 | 8,380 | 8,328 | 52 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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　2017年４月１日　至　2018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 | 1,963 | 210 | 0 |
| 合計 | 1,963 | 210 | 0 |

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019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 | 389 | 86 | - |
| （２）その他 | | | |
| 証券投資信託 | 3,517 | 128 | 40 |
| 合計 | 3,907 | 215 | 40 |

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | 前事業年度<br>（自　2017年４月１日<br>至　2018年３月31日） | 当事業年度<br>（自　2018年４月１日<br>至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 退職給付債務の期首残高 | 2,318百万円 | 2,350百万円 |
| 勤務費用 | 159 | 158 |
| 退職給付の支払額 | △166 | △171 |
| その他 | 38 | 52 |
| 退職給付債務の期末残高 | 2,350 | 2,389 |

(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<br>（自　2017年４月１日<br>至　2018年３月31日） | 当事業年度<br>（自　2018年４月１日<br>至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 2,350百万円 | 2,389百万円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,350 | 2,389 |
| | | |
| 退職給付引当金 | 2,350 | 2,389 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,350 | 2,389 |

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 前事業年度<br>（自　2017年４月１日<br>至　2018年３月31日） | 当事業年度<br>（自　2018年４月１日<br>至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 勤務費用 | 159百万円 | 158百万円 |
| その他 | 24 | 41 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 184 | 199 |

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

（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<br>（2018年３月31日） | 当事業年度<br>（2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 719 | 731 |
| 賞与引当金 | 244 | 182 |
| システム関連費用 | 16 | 170 |
| 未払事業税 | 162 | 141 |
| 出資金評価損 | 94 | 94 |
| 投資有価証券評価損 | 68 | 32 |
| その他 | 297 | 240 |
| 繰延税金資産小計 | 1,602 | 1,592 |
| 評価性引当額 | △200 | △164 |
| 繰延税金資産合計 | 1,402 | 1,428 |
| 繰延税金負債 | | |
| 連結法人間取引（譲渡益） | △159 | △159 |
| その他有価証券評価差額金 | △164 | △85 |
| 繰延税金負債合計 | △323 | △244 |
| 繰延税金資産の純額 | 1,078 | 1,183 |

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018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（2019年３月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019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子会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018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)<br>直接100.0 | 経営管理 | 債務保証（注） | 1,701 | － | － |

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　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円） | 科目 | 期末残高（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | (所有)直接100.0 | 経営管理 | 債務保証（注１） | 1,719 | － | － |
| 子会社 | Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd. | India | 1,207 | 金融商品取引業 | (所有)直接91.0 | 経営管理 | 有償減資（注２） | 3,293 | － | － |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１) 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。

(注２) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

（イ）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　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金または出資金（百万円） | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円）（注1） | 科目 | 期末残高（百万円）（注1） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券㈱ | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | － | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料（注2） | 23,216 | 未払手数料 | 3,913 |
| 同一の親会社をもつ会社 | ㈱大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区 | 3,000 | 情報サービス業 | － | ソフトウェアの開発 | ソフトウェアの購入（注3） | 1,020 | 未払費用 | 233 |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ㈱ | 東京都中央区 | 100 | 不動産管理業 | － | 本社ビルの管理 | 不動産の賃借料（注4） | 1,048 | 長期差入保証金 | 1,055 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金または出資金（百万円） | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円）（注1） | 科目 | 期末残高（百万円）（注1） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券㈱ | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | － | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料（注2） | 19,975 | 未払手数料 | 3,400 |
| 同一の親会社をもつ会社 | ㈱大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区 | 3,000 | 情報サービス業 | － | ソフトウェアの開発 | ソフトウェアの購入（注3） | 1,052 | 未払費用 | 173 |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ㈱ | 東京都中央区 | 100 | 不動産管理業 | － | 本社ビルの管理 | 不動産の賃借料（注4） | 1,063 | 長期差入保証金 | 1,055 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

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　2017年４月１日　至　2018年３月31日） | 当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日） |
|---|---|
| １株当たり純資産額　15,760.66円 | １株当たり純資産額　15,389.06円 |
| １株当たり当期純利益　4,857.40円 | １株当たり当期純利益　4,550.81円 |

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

(注２)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の１株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注３)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

| | 前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日） | 当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日） |
|---|---|---|
| 当期純利益（百万円） | 12,670 | 11,870 |

| | | |
|---|---|---|
| 普通株式の期中平均株式数（株） | 2,608,525 | 2,608,525 |

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 4　【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

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

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

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

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

## 5　【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

# 第２　【その他の関係法人の概況】

## １　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

①　名称　三井住友信託銀行株式会社

②　資本金の額　342,037百万円（2019年3月末日現在）

③　事業の内容

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。

(2) 販売会社

| ①　名称 | ②　資本金の額<br>単位：百万円<br>（2019年3月末日現在） | ③　事業の内容 |
|---|---|---|
| 大和証券株式会社 | 100,000 | （注） |

（注）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。

## ２　【関係業務の概要】

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

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

## ３　【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第３　【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

① 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

② 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

④ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

⑤ 使用開始日を記載することがあります。

⑥ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

⑦ 次の事項を記載することがあります。

・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

⑧ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

⑨ ファンドの形態等を記載することがあります。

⑩ 図案を採用することがあります。

⑪ ファンドの管理番号等を記載することがあります。

⑫ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

⑬ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

# 独立監査人の監査報告書

2019年５月24日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | | |
|---|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小倉　加奈子 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 間瀬　友未 | 印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治 | 印 |

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証券投資信託委託株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第60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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、大和証券投資信託委託株式会社の2019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すべ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。

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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）の平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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）の平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックスの平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックスの平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

**(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年12月28日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの平成29年12月1日から平成30年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの平成30年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

**利害関係**

**大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

**以　上**

(注) 1．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 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2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

　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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
　当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
　中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
　当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
　当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
　大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 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2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

　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2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
　経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
　当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
　中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
　当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
　当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
　大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックスの2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックスの2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

2019年7月5日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

| | | |
|---|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井　康治　　印 |
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林　英之　　印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2018年12月1日から2019年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2019年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年12月1日から2019年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係
大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

**(注) １．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**

**(注) ２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。**