

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年2月21日提出
【計算期間】	第3計算期間 (自 2018年12月1日 至 2019年12月2日)
【ファンド名】	ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

## 第1 【ファンドの状況】

## 1 【ファンドの性格】

## (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

## &lt;FWO TOPIXインデックス&gt;

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

## &lt;FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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））

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

商品分類	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

## &lt; FWO 日本債券インデックス &gt;

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）

## &lt; FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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））

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

商品分類	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

## &lt;FWO J - R E I Tインデックス&gt;

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R E I T指数（配当込み））

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

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）

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

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

## &lt;FWO TOPIXインデックス&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW0 日本債券インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO J - R E I T インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW0 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	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

<FW0 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

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

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

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## <ファンドの特色>

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

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

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

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

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

## ●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いません。

◆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いません。

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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

## FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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

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

## FWO 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## FWO 日本債券インデックス

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

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

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

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

## FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、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 (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	80%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)	20%

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## FWO J-REITインデックス

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をあげることが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が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・アフィリエイト社（Research Affiliates LLC）独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

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

## ◆FTSE世界国債インデックス

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

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス  
－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与え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&amp;P先進国REIT指数

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

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

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

## 〈分配方針〉

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

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

### ●FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

### ●FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）

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

### ●FWO 日本債券インデックス

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

### ●FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

### ●FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）

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

**●FWO J-REITインデックス**

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

**●FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）**

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

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

### 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クの価格の不一致
- ・ 指数の算出に使用するリークの価格と基準価額の算出に使用するリークの価格の不一致
- ・ 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「㈩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㈩東京証券取引所が有します。
- ㈩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。
- ㈩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。
- ㈩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、㈩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、㈩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。
- ㈩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。
- ㈩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、㈩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「ライセンス各社」）によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンス各社はいずれも、明示的にも黙示的にもFTSE RAFI® エマージング インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行なうことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンス各社も、指数における瑕疵については（過失の有無に関わらず）何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。FTSE®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・インデックスーエマージング・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、(株)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(株)東京証券取引所が有します。
- (株)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。
- (株)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。
- (株)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、(株)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、(株)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。
- (株)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。
- (株)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、(株)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（「SPDJ」）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SPDJ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、SPDJ、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】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社 大和証券株式会社	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。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないません。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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象		<p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p>&lt; FWO TOPIXインデックス &gt; 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</p> <p>&lt; FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt; 外国の株式（DR（預託証券）を含みます。） など</p> <p>&lt; FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） &gt; 外国の株式（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</p> <p>&lt; FWO 日本債券インデックス &gt; わが国の公社債 など</p> <p>&lt; FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt; 外国の公社債 など</p> <p>&lt; FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） &gt; 外国の公社債、新興国通貨建ての債券 など</p> <p>&lt; FWO J-REITインデックス &gt; わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 など</p> <p>&lt; FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし） &gt; 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券 など</p>

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

## &lt; 委託会社の概況（2019年12月末日現在） &gt;

・ 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】

## 主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FWO T O P I X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 - R E I Tインデックス	ダイワJ - R E I T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。

#### 投資態度

##### <FWO TOPIXインデックス>

- イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(TOPIX)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ. 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

##### <FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

- イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ. マザーファンドにおける外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

##### <FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

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

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

## (2) 【投資対象】

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和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)>

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

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）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

## &lt; FWO T O P I Xインデックス &gt;

## &lt; FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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

## &lt; FWO 日本債券インデックス &gt;

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

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

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

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）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下

「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券(新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

#### <FWO J - R E I Tインデックス>

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

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

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和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 - R E I Tマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

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

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

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

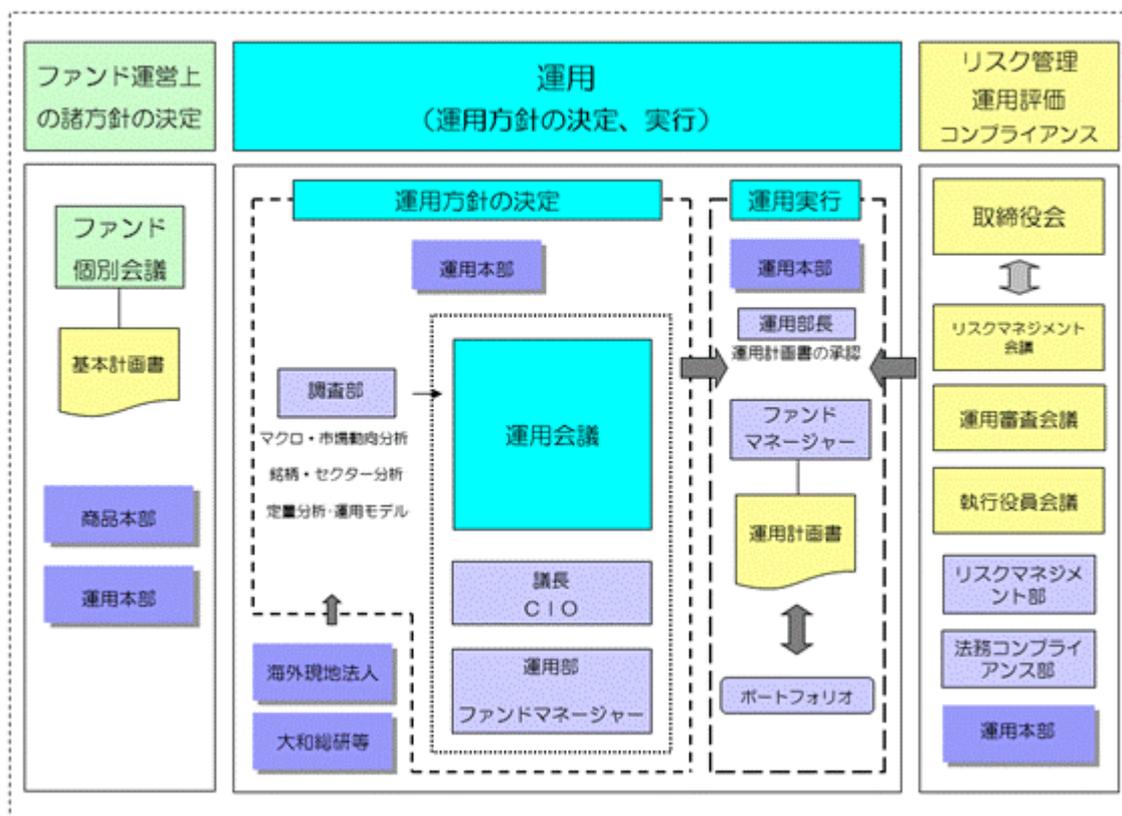
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

＜各ファンド共通＞

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・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。

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．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。

ロ．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。

ハ．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。

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12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

<各ファンド共通>

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

## マザーファンドの受益証券（信託約款）

## &lt;各ファンド共通&gt;

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

## 株式（信託約款）

## &lt;FWO TOPIXインデックス&gt;

## &lt;FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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

## &lt;FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）&gt;

## &lt;FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）&gt;

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

## &lt;FWO 日本債券インデックス&gt;

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します。

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。

## &lt;FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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します。

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。

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

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します。

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。

## &lt;FWO J-REITインデックス&gt;

株式への直接投資は、行ないません。

## 新株引受権証券等（信託約款）

<FWO T O P I Xインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

投資信託証券（信託約款）

<FWO T O P I Xインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

イ．委託会社は、信託財産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 - R E I Tインデックス>

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

<FWO T O P I Xインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国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)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用取引(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証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)

先物取引等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FWO J - R E I T インデックス>

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

スワップ取引(信託約款)

<FWO T O P I X インデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

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

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

#### <FWO J-REITインデックス>

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

#### <FWO TOPIXインデックス>

#### <FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

デリバティブ取引等（信託約款）

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

<FWO J - R E I T インデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FWO T O P I X インデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FWO J - R E I T インデックス>

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用リスク集中回避（信託約款）

<各ファンド共通>

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

資金の借入れ（信託約款）

<各ファンド共通>

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## &lt; 参 考 &gt; マザーファンドの概要

## トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所第一部上場株式（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。 イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。 ロ．ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。 ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。
主な投資制限	株式 株式への投資には、制限を設けません。 先物取引等 イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、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合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

## 新株引受権証券等

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 同一銘柄の転換社債等

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

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

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の

## 主な投資制限

	<p>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、</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとし、</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとし、</p>
--	--

## 外国株式インデックスマザーファンド

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

## ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

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

## 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

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

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

## 外国債券インデックスマザーファンド

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

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

ダイワJ-REITマザーファンド

<p>運用の基本方針</p>	<p>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。</p>
----------------	---

主要投資対象	<p>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。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ. 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。</p>
主な投資制限	<p>株式 株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p> <p>先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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、</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引</p> <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
--------	--

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### <FWO TOPIXインデックス>

##### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

##### その他

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

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

#### <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

##### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

##### 外国証券への投資に伴うリスク

##### イ．為替リスク

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

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

#### <FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

〈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いません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

## ロ．カントリー・リスク

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

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

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

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

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

## &lt;FWO 日本債券インデックス&gt;

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）



※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。

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

## &lt;FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FWO 日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈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。）。新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の と同内容）

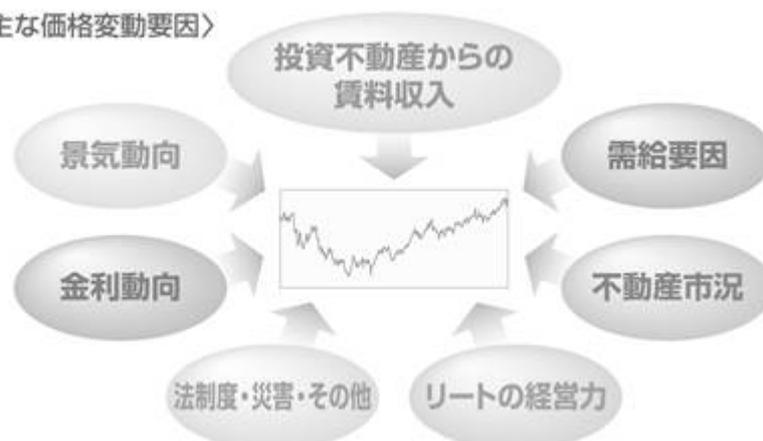
その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

<FWO J-REITインデックス>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リーートの主な価格変動要因〉



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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

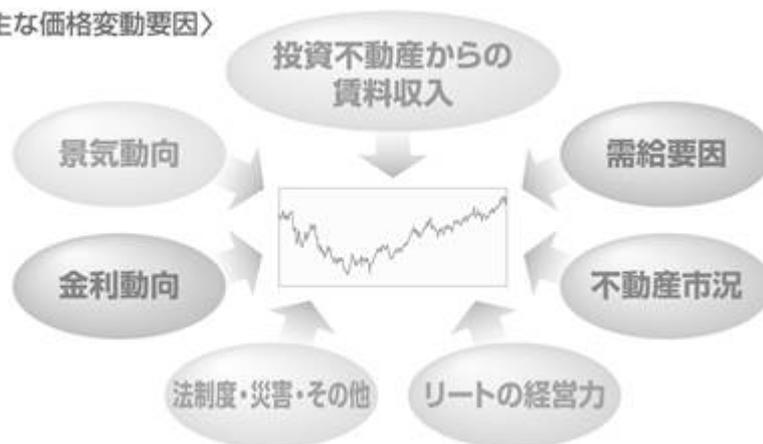
その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

<FWO 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

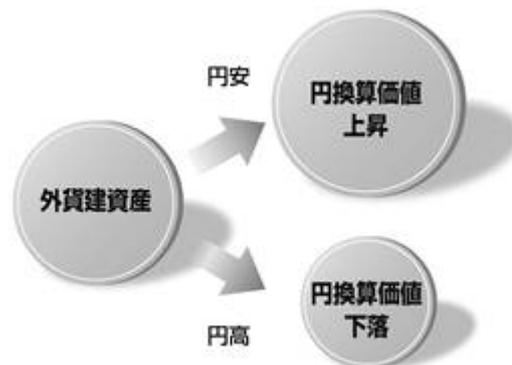
リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

（FWO 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

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。

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

#### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「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<sup>\*</sup>）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。

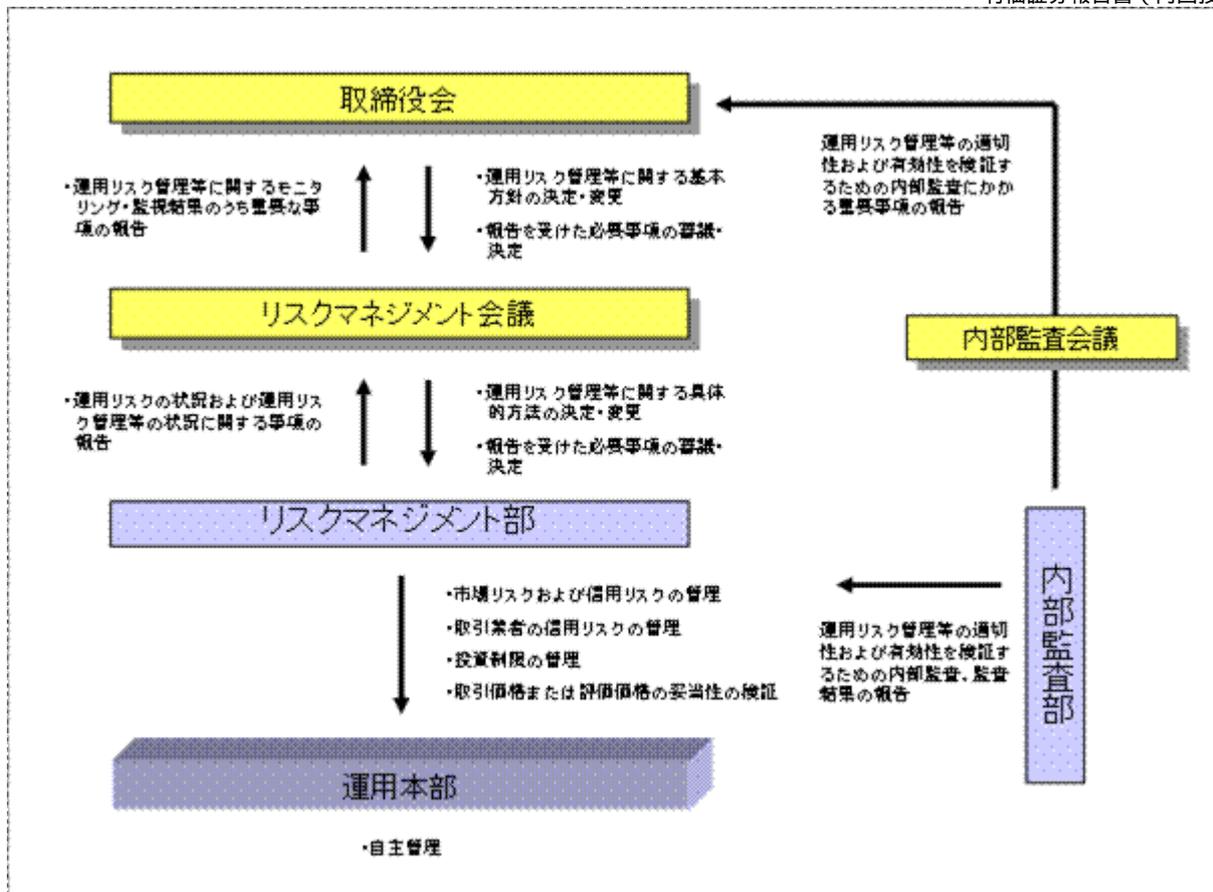
#### (3) その他の留意点

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

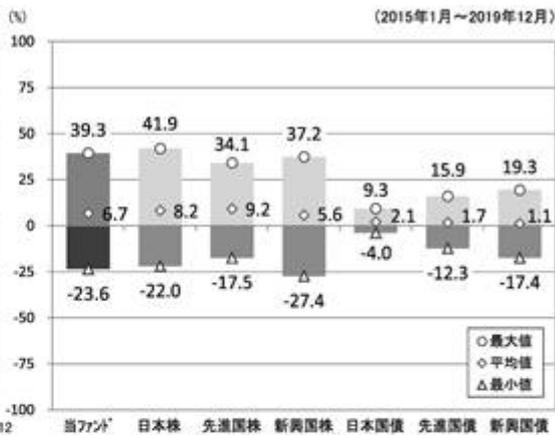
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

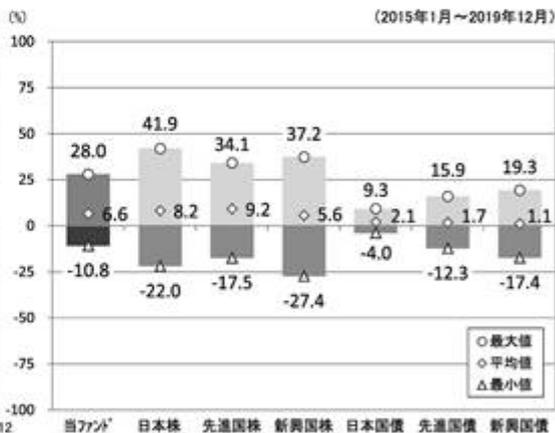
#### [FWO TOPIXインデックス]



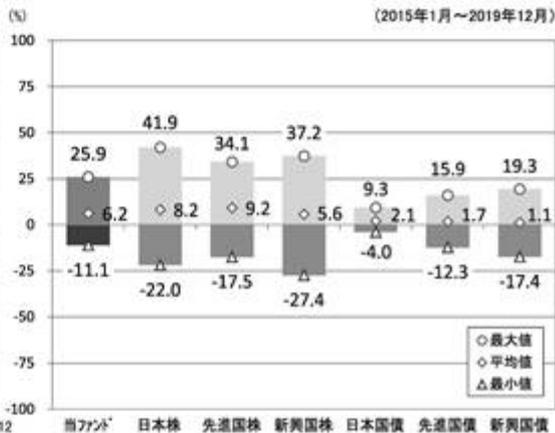
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



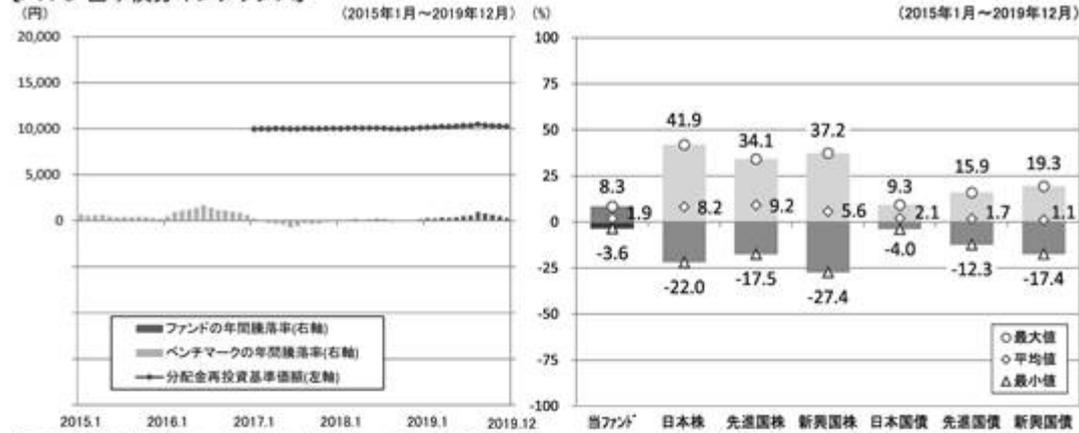
#### [FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



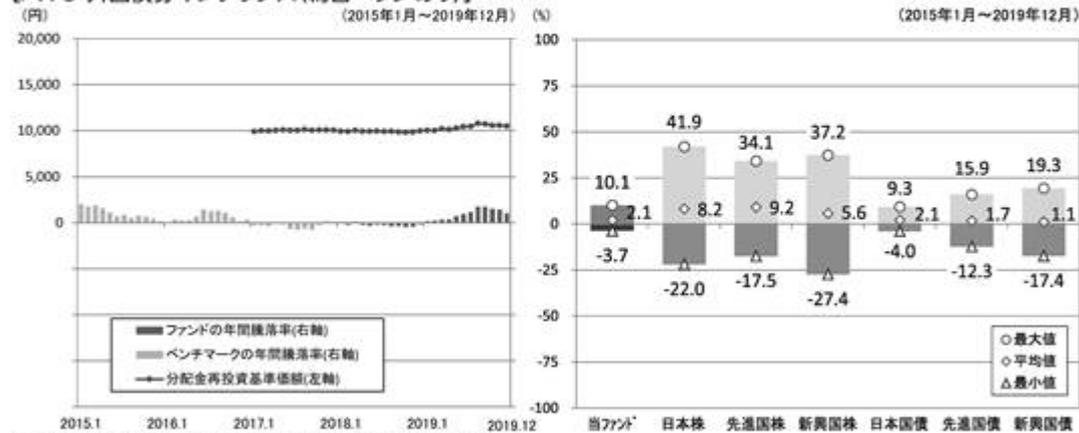
#### [FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



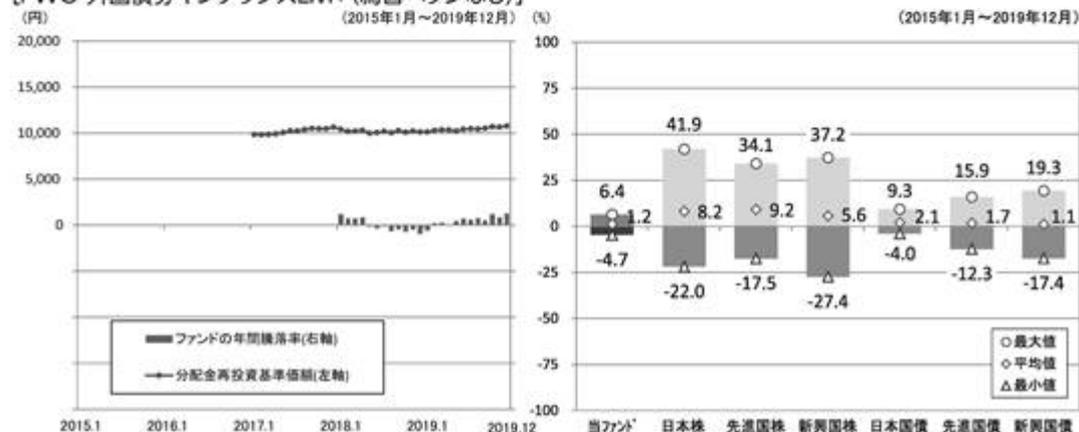
## [FWO 日本債券インデックス]



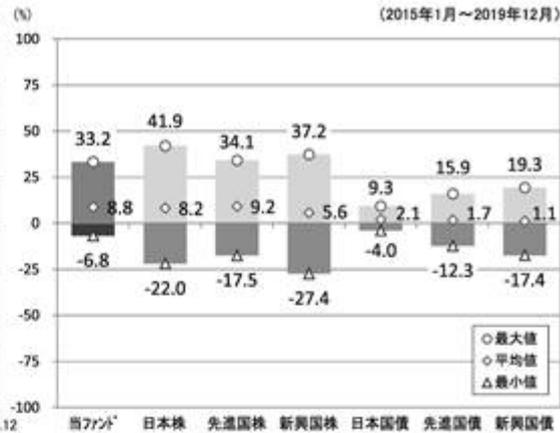
## [FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



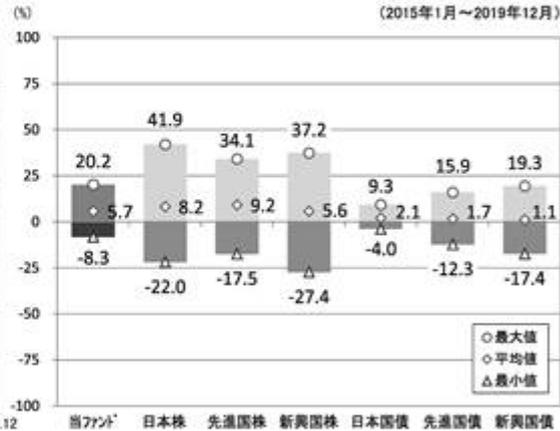
## [FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



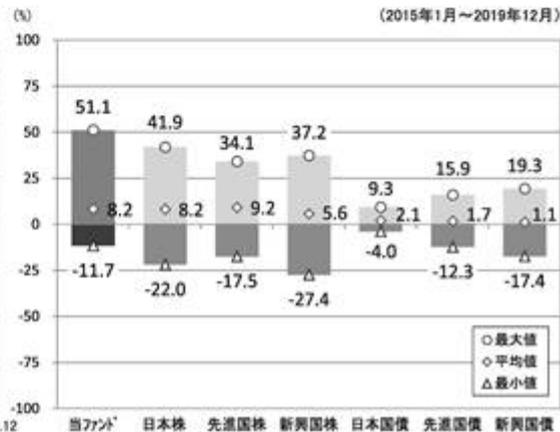
## [FWO J-REITインデックス]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせる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）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

##### (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3) 【信託報酬等】

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

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

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

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.11% (税抜0.10%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.2255% (税抜0.205%)

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

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

<FWO TOPIXインデックス>

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

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FWO 日本債券インデックス>

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

## &lt;FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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

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

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

## &lt;FWO J - R E I Tインデックス&gt;

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

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

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

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

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

### イ．収益分配金に対する課税

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

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日

まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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。

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

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2019年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

## (1) 【投資状況】（2019年12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,868,308,672	99.99
内 日本	2,868,308,672	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	202,192	0.01
純資産総額	2,868,510,864	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12月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	2,558,477,096	1.1150 2,852,839,485	1.1211 2,868,308,672	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,308,490,516	1,308,490,516	1.1827	1.1827
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,014,835,042	2,014,835,042	1.1209	1.1209
2018年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	-
7月末日	2,531,649,462	-	1.0665	-
8月末日	2,471,637,369	-	1.0304	-
9月末日	2,638,408,885	-	1.0924	-
10月末日	2,755,742,380	-	1.1467	-
11月末日	2,827,173,428	-	1.1688	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,849,716,102	2,849,716,102	1.1793	1.1793
12月末日	2,868,510,864	-	1.1855	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	18.3
第2計算期間	5.2

第3計算期間	5.2
--------	-----

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,207,147,382	101,755,106
第2計算期間	1,072,657,156	381,496,133
第3計算期間	1,209,913,301	590,980,566

(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12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	155,951,333,270	98.52
内 日本	155,951,333,270	98.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,348,948,523	1.48
純資産総額	158,300,281,793	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)	2,374,980,000	1.50
内 日本	2,374,980,000	1.50

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
					また は 額面金額			
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	716,800	7,380.53 5,290,370,124	7,714.00 5,529,395,200	3.49

2	ソニー	日本	株式	電気機器	406,200	6,391.26 2,596,130,797	7,401.00 3,006,286,200	1.90
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,361,500	565.52 2,466,526,575	593.20 2,587,241,800	1.63
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	500,200	4,585.35 2,293,597,034	4,756.00 2,378,951,200	1.50
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	842,600	2,640.04 2,224,501,679	2,757.00 2,323,048,200	1.47
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	534,500	3,777.63 2,019,146,698	4,332.00 2,315,454,000	1.46
7	キーエンス	日本	株式	電気機器	58,200	33,554.68 1,952,882,948	38,490.00 2,240,118,000	1.42
8	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	439,700	3,439.91 1,512,528,757	4,099.00 1,802,330,300	1.14
9	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	438,100	3,792.42 1,661,463,048	4,038.00 1,769,047,800	1.12
10	任天堂	日本	株式	その他製品	39,400	42,022.42 1,655,683,501	43,970.00 1,732,418,000	1.09
11	本田技研	日本	株式	輸送用機器	505,700	2,893.07 1,463,025,986	3,099.00 1,567,164,300	0.99
12	KDDI	日本	株式	情報・通信業	469,800	2,878.90 1,352,510,794	3,253.00 1,528,259,400	0.97
13	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	8,608,100	168.51 1,450,582,766	168.30 1,448,743,230	0.92
14	日立	日本	株式	電気機器	308,600	4,086.62 1,261,130,979	4,626.00 1,427,583,600	0.90
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	465,500	2,818.55 1,312,039,091	3,038.00 1,414,189,000	0.89
16	花王	日本	株式	化学	153,800	7,983.86 1,227,919,232	9,025.00 1,388,045,000	0.88
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	226,500	5,894.78 1,335,169,424	6,119.00 1,385,953,500	0.88
18	HOYA	日本	株式	精密機器	128,300	8,900.36 1,141,916,985	10,450.00 1,340,735,000	0.85
19	第一三共	日本	株式	医薬品	183,900	7,109.79 1,307,491,571	7,228.00 1,329,229,200	0.84
20	信越化学	日本	株式	化学	108,000	11,839.09 1,278,622,124	12,060.00 1,302,480,000	0.82
21	三菱商事	日本	株式	卸売業	443,900	2,782.47 1,235,140,806	2,900.00 1,287,310,000	0.81

22	村田製作所	日本	株式	電気機器	188,700	5,109.20 964,107,361	6,746.00 1,272,970,200	0.80
23	ダイキン工業	日本	株式	機械	81,800	14,519.52 1,187,697,097	15,450.00 1,263,810,000	0.80
24	ファナック	日本	株式	電気機器	61,000	20,505.47 1,250,833,987	20,330.00 1,240,130,000	0.78
25	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	53,400	22,499.16 1,201,455,472	22,000.00 1,174,800,000	0.74
26	日本電産	日本	株式	電気機器	77,300	15,367.90 1,187,939,397	15,005.00 1,159,886,500	0.73
27	伊藤忠	日本	株式	卸売業	442,500	2,303.15 1,019,144,576	2,534.50 1,121,516,250	0.71
28	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	113,000	10,509.64 1,187,589,589	9,858.00 1,113,954,000	0.70
29	三井物産	日本	株式	卸売業	556,000	1,840.32 1,023,222,820	1,946.00 1,081,976,000	0.68
30	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	565,000	1,543.73 872,210,609	1,870.00 1,056,550,000	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	98.52%
合計	98.52%

(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

業種	投資比率
水産・農林業	0.10%
鉱業	0.29%
建設業	2.74%
食料品	3.72%
繊維製品	0.59%
パルプ・紙	0.24%
化学	7.03%
医薬品	5.94%
石油・石炭製品	0.49%
ゴム製品	0.70%
ガラス・土石製品	0.84%

鉄鋼	0.76%
非鉄金属	0.76%
金属製品	0.59%
機械	5.04%
電気機器	14.19%
輸送用機器	7.60%
精密機器	2.34%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.52%
陸運業	4.32%
海運業	0.18%
空運業	0.49%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.59%
卸売業	4.92%
小売業	4.57%
銀行業	5.77%
証券、商品先物取引業	0.81%
保険業	2.28%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.35%
サービス業	5.09%
合計	98.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2020年3月	買建	138	2,377,560,000	2,374,980,000	1.50%

(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12月30日現在

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

#### 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,855円
純資産総額	28億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	8.5%
6カ月間	12.1%
1年間	17.9%
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	第3期 19年12月						
分配金	0円	0円	0円						

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

#### 主要な資産の状況

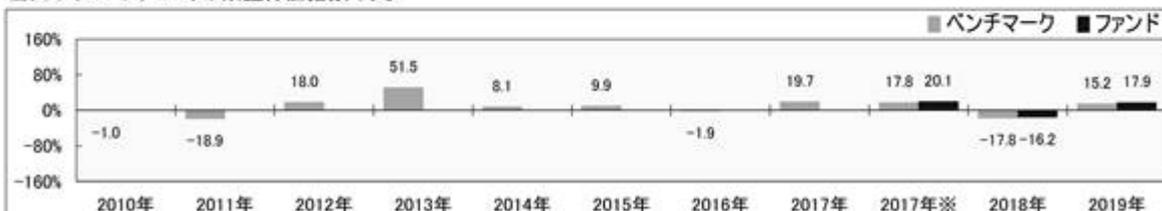
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,128	98.5%	電気機器	14.2%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.5%
国内株式先物	1	1.5%	情報・通信業	8.6%	ソニー	電気機器	1.9%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.6%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.6%
コール・ローン、その他		1.5%	化学	7.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.5%
合計	2,129	-	医薬品	5.9%	TOPIX先物 0203月	-	1.5%
株式市場・上場別構成			銀行業	5.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
一部(東証・名証)		98.5%	サービス業	5.1%	武田薬品	医薬品	1.5%
二部(東証・名証)		-	機械	5.0%	キーエンス	電気機器	1.4%
新興市場他		-	卸売業	4.9%	リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
その他		-	その他	34.3%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.1%
合計		98.5%	合計	98.5%	合計		16.6%

※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12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,412,672,590	99.99
内 日本	2,412,672,590	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	206,772	0.01
純資産総額	2,412,879,362	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12月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	1,125,261,224	2.0874 2,348,889,673	2.1441 2,412,672,590	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,294,661,850	1,294,661,850	1.1363	1.1363
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,198,184,300	2,198,184,300	1.1423	1.1423
2018年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	-
7月末日	2,262,256,872	-	1.2584	-
8月末日	2,202,277,014	-	1.2215	-
9月末日	2,220,934,395	-	1.2422	-
10月末日	2,275,284,298	-	1.2699	-
11月末日	2,363,495,987	-	1.3107	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,353,172,110	2,353,172,110	1.3050	1.3050
12月末日	2,412,879,362	-	1.3401	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.6
第2計算期間	0.5
第3計算期間	14.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,218,074,496	79,711,026
第2計算期間	1,148,408,392	363,438,941
第3計算期間	570,028,310	691,152,610

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	49,110,848,619	93.31
内 香港	629,099,166	1.20
内 シンガポール	216,125,326	0.41
内 イスラエル	108,133,804	0.21
内 ノルウェー	120,343,462	0.23
内 スウェーデン	516,837,713	0.98
内 デンマーク	350,127,689	0.67
内 イギリス	2,974,238,621	5.65
内 アイルランド	99,964,051	0.19
内 オランダ	723,657,090	1.37
内 ベルギー	190,600,730	0.36
内 フランス	2,029,105,008	3.86
内 ドイツ	1,575,714,809	2.99
内 スイス	1,690,248,772	3.21
内 ポルトガル	31,915,489	0.06
内 スペイン	520,283,189	0.99
内 イタリア	438,237,963	0.83
内 フィンランド	179,710,490	0.34
内 オーストリア	36,922,262	0.07
内 カナダ	1,744,819,486	3.31
内 アメリカ	33,780,277,652	64.18
内 オーストラリア	1,095,922,195	2.08
内 ニューージーランド	58,563,652	0.11
投資証券	1,443,234,067	2.74
内 香港	38,615,397	0.07
内 シンガポール	29,228,005	0.06

	内 イギリス	44,824,584	0.09
	内 フランス	60,793,213	0.12
	内 カナダ	13,921,709	0.03
	内 アメリカ	1,093,888,773	2.08
	内 オーストラリア	161,962,386	0.31
	コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,080,434,465	3.95
	純資産総額	52,634,517,151	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)	2,473,204,855	4.70
内 イギリス	141,506,433	0.27
内 ドイツ	412,406,760	0.78
内 カナダ	187,692,952	0.36
内 アメリカ	1,667,092,350	3.17
内 オーストラリア	64,506,360	0.12
為替予約取引(売建)	50,069,951,363	95.13
内 日本	50,069,951,363	95.13

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2019年12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	50,777	17,702.15 898,867,350	31,750.48 1,612,194,529	3.06
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	80,983	12,030.34 974,261,376	17,415.65 1,410,372,199	2.68

3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	4,747	184,465.29 875,656,973	204,855.28 972,448,052	1.85
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	27,031	16,648.84 450,036,542	22,799.43 616,291,555	1.17
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	36,264	11,260.13 408,341,172	15,244.17 552,814,885	1.05
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,595	120,416.19 432,896,243	148,113.06 532,466,481	1.01
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,274	120,647.03 394,998,396	148,414.35 485,908,609	0.92
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	29,677	14,203.90 421,529,361	15,968.37 473,893,316	0.90
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	33,545	9,566.81 320,919,507	11,959.36 401,176,731	0.76
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	19,327	15,808.08 305,523,078	20,749.56 401,026,908	0.76
11	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	101,268	2,899.72 293,651,887	3,872.94 392,205,496	0.75
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	27,825	10,458.37 291,006,445	13,814.42 384,386,248	0.73
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	47,945	7,906.83 379,093,984	7,657.14 367,121,980	0.70
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	14,492	21,693.64 314,384,406	24,775.89 359,052,320	0.68
15	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	81,815	3,389.12 277,289,122	4,299.13 351,733,681	0.67
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,726	26,841.21 287,899,640	32,426.47 347,806,352	0.66
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	10,141	22,938.68 232,621,292	32,949.07 334,136,563	0.63

18	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	49,706	5,321.21 264,499,936	6,582.36 327,183,025	0.62
19	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	20,184	12,728.35 256,909,976	15,968.37 322,305,580	0.61
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	46,447	6,254.12 290,488,718	6,741.22 313,109,761	0.59
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,415	20,283.17 251,816,670	24,099.91 299,200,422	0.57
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	28,553	8,433.49 240,802,092	10,024.74 286,236,401	0.54
23	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	47,667	5,245.84 250,053,633	5,907.47 281,591,620	0.53
24	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	21,352	12,506.93 267,048,368	13,180.06 281,420,812	0.53
25	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	45,442	5,221.19 237,263,804	6,064.14 275,566,923	0.52
26	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	7,624	28,893.88 220,287,572	35,658.90 271,863,454	0.52
27	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,373	4,638.87 289,344,132	4,307.89 268,696,597	0.51
28	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	48,358	4,836.52 233,886,298	5,233.68 253,090,355	0.48
29	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	51,046	4,089.98 208,780,128	4,941.15 252,226,249	0.48
30	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	23,462	8,608.60 201,975,932	10,465.56 245,543,063	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.31%
投資証券	2.74%

合計	96.05%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.01%
素材	4.11%
資本財・サービス	9.62%
一般消費財・サービス	9.17%
生活必需品	8.00%
ヘルスケア	12.81%
金融	15.37%
情報技術	17.13%
コミュニケーション・サービス	8.12%
公益事業	3.40%
不動産	0.55%
合計	93.31%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2020年3月	買建	94	1,645,941,847	1,667,092,350	3.17%
	イギリス	FT 100 2020年3月	買建	13	138,952,596	141,506,433	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2020年3 月	買建	5	64,883,030	64,506,360	0.12%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020 年3月	買建	11	187,165,200	187,692,952	0.36%
	ドイツ	SMI 2020年3月	買建	9	105,262,291	107,502,732	0.20%
		EURO STOXX 50 2020年3 月	買建	66	302,664,119	304,904,028	0.58%
為替予約取引	日本	香港ドル売/円買 2020年 1月	売建	43,660,500	609,267,158	613,430,025	1.17%

イスラエル・シケル 売/円買 2020年1月	売建	2,110,600	66,588,374	66,800,490	0.13%
ノルウェー・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	9,690,000	114,991,308	120,349,800	0.23%
ニュージーランド・ドル 売/円買 2020年1月	売建	785,100	55,227,406	57,673,446	0.11%
スウェーデン・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	43,226,000	495,067,378	507,473,240	0.96%
シンガポール・ドル売/ 円買 2020年1月	売建	3,043,900	243,343,854	246,555,900	0.47%
英ポンド売/円買 2020年 1月	売建	20,835,700	2,944,929,704	2,988,047,737	5.68%
ユーロ売/円買 2020年1 月	売建	47,436,100	5,730,251,890	5,812,345,333	11.04%
米ドル売/円買 2020年1 月	売建	315,274,500	34,459,932,754	34,513,099,515	65.57%
スイス・フラン売/円買 2020年1月	売建	15,051,600	1,649,858,436	1,691,950,356	3.21%
カナダ・ドル売/円買 2020年1月	売建	21,610,300	1,779,659,826	1,809,430,419	3.44%
豪ドル売/円買 2020年1 月	売建	16,926,600	1,253,805,486	1,294,377,102	2.46%
デンマーク・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	21,245,000	343,572,015	348,418,000	0.66%

(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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,401円
純資産総額	24億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	7.9%
6カ月間	9.0%
1年間	28.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	34.0%



※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)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,248	98.0%	日本円	97.5%	情報技術	17.1%	S&P500 EMINI FUT 202003	アメリカ	3.2%
外国リート	66	2.6%	米ドル	1.9%	金融	15.4%	APPLE INC	アメリカ	3.1%
外国投資証券	6	0.1%	ユーロ	0.2%	ヘルスケア	12.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.7%
			英ポンド	0.2%	資本財・サービス	9.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.8%
コール・ローン、その他		4.0%	スイス・フラン	0.1%	一般消費財・サービス	9.2%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.2%
			スウェーデン・クローネ	0.0%	コミュニケーション・サービス	8.1%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.1%
合計	1,320	-	香港ドル	0.0%	生活必需品	8.0%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			デンマーク・クローネ	0.0%	エネルギー	5.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
アメリカ		69.4%	カナダ・ドル	0.0%	素材	4.1%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
イギリス		6.0%	その他	-0.0%	公益事業、他	4.0%	NESTLE SA-REG	スイス	0.8%
その他		25.3%							
合計		100.7%	合計	100.0%	合計	93.3%	合計		16.6%

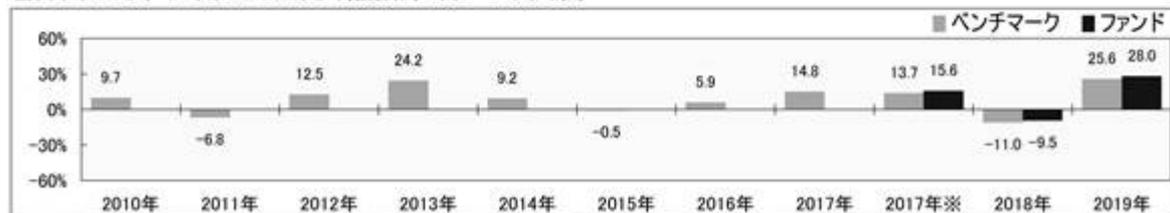
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)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12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,903,363,736	99.21
内 日本	1,903,363,736	99.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,130,855	0.79
純資産総額	1,918,494,591	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	534,311,390	2.7401 1,464,088,666	2.8314 1,512,849,269	78.86
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	229,390,547	1.5800 362,455,060	1.7024 390,514,467	20.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	915,626,043	915,626,043	1.1391	1.1391
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,637,273,973	1,637,273,973	1.1550	1.1550
2018年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	-
7月末日	1,744,439,411	-	1.2102	-
8月末日	1,651,704,372	-	1.1393	-
9月末日	1,715,911,246	-	1.1801	-
10月末日	1,787,555,223	-	1.2301	-
11月末日	1,853,568,171	-	1.2677	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,845,455,269	1,845,455,269	1.2622	1.2622
12月末日	1,918,494,591	-	1.3145	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.9
第2計算期間	1.4
第3計算期間	9.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	866,066,727	72,233,916

第2計算期間	874,852,673	261,158,636
第3計算期間	481,206,327	436,632,747

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	125,348,199,342	92.42
内 香港	1,579,010,477	1.16
内 シンガポール	526,081,098	0.39
内 イスラエル	262,101,557	0.19
内 ノルウェー	293,362,206	0.22
内 スウェーデン	1,272,335,342	0.94
内 デンマーク	867,568,323	0.64
内 イギリス	7,685,669,621	5.67
内 アイルランド	278,977,490	0.21
内 オランダ	1,880,025,072	1.39
内 ベルギー	468,039,840	0.35
内 フランス	5,236,230,091	3.86
内 ドイツ	4,084,735,905	3.01
内 スイス	4,437,210,052	3.27
内 ポルトガル	72,771,501	0.05
内 スペイン	1,337,941,033	0.99
内 イタリア	1,107,873,795	0.82
内 フィンランド	443,588,244	0.33
内 オーストリア	103,037,820	0.08
内 カナダ	4,720,120,626	3.48
内 アメリカ	85,723,257,338	63.20
内 オーストラリア	2,833,252,095	2.09
内 ニューージーランド	135,009,816	0.10
投資証券	3,646,909,082	2.69
内 香港	96,768,817	0.07
内 シンガポール	68,445,617	0.05
内 イギリス	96,386,028	0.07
内 フランス	148,911,589	0.11

	内 カナダ	33,580,602	0.02
	内 アメリカ	2,803,559,938	2.07
	内 オーストラリア	399,256,491	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,638,118,730	4.89
純資産総額		135,633,227,154	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		6,729,966,782	4.96
	内 イギリス	337,438,416	0.25
	内 ドイツ	913,712,742	0.67
	内 カナダ	238,881,938	0.18
	内 アメリカ	5,072,217,150	3.74
	内 オーストラリア	167,716,536	0.12
為替予約取引(買建)		3,841,569,000	2.83
	内 日本	3,841,569,000	2.83

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

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

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

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	129,800	29,279.91 3,800,532,318	31,750.48 4,121,213,342	3.04
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	205,650	16,585.19 3,410,744,899	17,415.65 3,581,529,985	2.64
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	11,770	197,295.64 2,322,169,777	204,855.28 2,411,146,740	1.78

4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	67,650	22,091.67 1,494,502,044	22,799.43 1,542,381,845	1.14
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	91,070	14,435.62 1,314,652,423	15,244.17 1,388,287,327	1.02
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	8,747	142,971.41 1,250,570,990	148,113.06 1,295,545,009	0.96
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	8,400	142,876.10 1,200,159,243	148,414.35 1,246,680,611	0.92
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルス ケア	74,800	15,063.40 1,126,742,649	15,968.37 1,194,434,076	0.88
9	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必 需品	86,900	11,680.60 1,015,044,835	11,959.36 1,039,268,384	0.77
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技 術	48,950	20,214.91 989,520,119	20,749.56 1,015,691,373	0.75
11	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	255,401	3,650.53 932,351,362	3,872.94 989,154,281	0.73
12	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	70,767	13,372.89 946,359,561	13,814.42 977,605,088	0.72
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	119,655	7,464.32 893,143,545	7,657.14 916,216,092	0.68
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	36,350	24,136.06 877,346,072	24,775.89 900,603,907	0.66
15	AT&T INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	206,591	4,095.35 846,063,030	4,299.13 888,162,475	0.65
16	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	26,776	30,662.55 821,020,632	32,426.47 868,251,246	0.64
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技 術	25,500	32,016.71 816,426,329	32,949.07 840,201,397	0.62
18	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	126,650	6,359.95 805,488,681	6,582.36 833,656,502	0.61

19	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	50,912	16,607.10 845,500,920	15,968.37 812,981,653	0.60
20	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	116,904	6,599.89 771,554,055	6,741.22 788,076,378	0.58
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	31,000	24,159.07 748,931,344	24,099.91 747,097,309	0.55
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルス ケア	72,721	9,551.44 694,590,326	10,024.74 729,009,118	0.54
23	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	120,922	5,966.63 721,497,752	5,907.47 714,343,716	0.53
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルス ケア	19,940	34,641.68 690,755,099	35,658.90 711,038,466	0.52
25	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	53,818	12,832.76 690,633,628	13,180.06 709,324,900	0.52
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	114,150	5,850.50 667,835,032	6,064.14 692,222,266	0.51
27	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	157,113	4,220.25 663,056,327	4,307.89 676,826,967	0.50
28	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルス ケア	61,050	10,347.54 631,717,561	10,465.56 638,922,682	0.47
29	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	121,050	4,964.16 600,912,004	5,233.68 633,537,109	0.47
30	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	128,190	4,837.07 620,064,516	4,941.15 633,406,788	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.42%
投資証券	2.69%
合計	95.11%

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.98%
素材	4.13%
資本財・サービス	9.60%
一般消費財・サービス	9.12%
生活必需品	7.93%
ヘルスケア	12.60%
金融	15.33%
情報技術	16.94%
コミュニケーション・サービス	7.93%
公益事業	3.37%
不動産	0.48%
合計	92.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2020年3月	買建	286	5,014,069,495	5,072,217,150	3.74%
	イギリス	FT 100 2020年3月	買建	31	332,185,649	337,438,416	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 INDEX 2020年3 月	買建	13	168,641,165	167,716,536	0.12%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020 年3月	買建	14	238,247,397	238,881,938	0.18%
	ドイツ	SMI 2020年3月	買建	15	175,974,424	179,171,220	0.13%
		EURO STOXX 50 2020年3 月	買建	159	729,874,770	734,541,522	0.54%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年1 月	買建	700,000	51,863,000	53,529,000	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2020年1月	買建	1,750,000	144,451,920	146,527,500	0.11%

スイス・フラン買/円売 2020年1月	買建	1,000,000	110,181,240	112,410,000	0.08%
ユーロ買/円売 2020年1 月	買建	3,500,000	423,265,270	428,855,000	0.32%
英ポンド買/円売 2020年 1月	買建	550,000	78,162,640	78,875,500	0.06%
米ドル買/円売 2020年1 月	買建	27,600,000	3,016,799,160	3,021,372,000	2.23%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

### 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12月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		8,212,873,918	90.87
	内 中国	2,703,277,604	29.91
	内 台湾	1,175,019,909	13.00
	内 タイ	272,006,007	3.01
	内 シンガポール	4,369,754	0.05
	内 マレーシア	108,819,309	1.20
	内 インドネシア	156,353,685	1.73
	内 インド	682,153,335	7.55
	内 ロシア	885,446,397	9.80
	内 トルコ	168,569,053	1.87
	内 メキシコ	295,540,250	3.27
	内 チリ	67,935,856	0.75
	内 ブラジル	1,135,143,598	12.56
	内 南アフリカ	558,239,161	6.18
投資証券		652,748,796	7.22
	内 トルコ	4,558,817	0.05
	内 アメリカ	613,240,188	6.79
	内 メキシコ	15,378,046	0.17

	内 南アフリカ	19,571,745	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		172,014,083	1.90
純資産総額		9,037,636,797	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)	123,353,604	1.36
内 アメリカ	123,353,604	1.36
為替予約取引(買建)	10,947,000	0.12
内 日本	10,947,000	0.12
為替予約取引(売建)	27,375,000	0.30
内 日本	27,375,000	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) 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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証 券	-	251,000	2,249.48 564,647,534	2,443.18 613,240,188	6.79
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	312,000	893.87 278,891,009	1,230.32 383,859,840	4.25
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	3,719,000	87.41 325,146,830	95.11 353,725,991	3.91
4	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,000,000	76.86 230,606,480	84.42 253,260,000	2.80
5	GAZPROM PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネ ル ギー	226,870	851.60 193,211,371	904.08 205,110,699	2.27
6	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネ ル ギー	18,690	9,244.67 172,784,980	10,848.63 202,760,917	2.24

7	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	3,621,000	45.62 165,260,569	47.13 170,674,025	1.89
8	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	157,500	988.47 155,685,540	920.17 144,928,035	1.60
9	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	79,960	1,676.15 134,029,421	1,798.42 143,802,255	1.59
10	VALE SA	ブラジル	株式	素材	96,890	1,358.59 131,635,630	1,449.34 140,426,940	1.55
11	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	128,636	984.98 126,705,412	1,008.59 129,741,241	1.44
12	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	1,557,800	72.05 112,245,446	65.98 102,796,574	1.14
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	77,000	1,339.99 103,180,025	1,294.44 99,671,880	1.10
14	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	株式	一般消費財・サービス	4,100	18,978.53 77,812,251	23,606.89 96,788,262	1.07
15	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	94,360	1,024.08 96,633,023	979.38 92,415,127	1.02
16	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	38,570	1,973.62 76,122,717	2,375.21 91,612,197	1.01
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	262,902	279.64 73,518,792	333.06 87,562,140	0.97
18	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	480,000	181.79 87,264,713	180.65 86,716,224	0.96
19	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	102,400	726.88 74,434,075	825.26 84,506,706	0.94
20	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	923,000	82.12 75,800,744	89.68 82,780,363	0.92
21	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	15,200	4,982.39 75,732,592	5,402.88 82,123,776	0.91
22	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	465,100	170.55 79,326,794	160.62 74,707,850	0.83

23	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	78,100	800.00 62,480,883	869.87 67,937,378	0.75
24	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	45,300	1,442.80 65,358,861	1,432.30 64,883,589	0.72
25	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	38,003	1,183.00 44,957,636	1,625.26 61,764,756	0.68
26	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	1,199,000	45.24 54,256,950	48.54 58,201,259	0.64
27	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	15,170	3,483.77 52,848,858	3,763.99 57,099,743	0.63
28	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	91,500	533.11 48,779,893	571.24 52,268,643	0.58
29	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	43,360	1,143.70 49,590,990	1,134.90 49,209,394	0.54
30	STANDARD BANK GROUP LTD	南アフリカ	株式	金融	36,420	1,472.29 53,621,162	1,327.31 48,340,703	0.53

(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	90.87%
投資証券	7.22%
合計	98.10%

(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	15.50%
素材	9.09%
資本財・サービス	2.99%
一般消費財・サービス	5.27%
生活必需品	4.43%
ヘルスケア	0.63%
金融	29.98%
情報技術	9.57%
コミュニケーション・サービス	8.00%
公益事業	2.68%
不動産	2.73%
合計	90.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 2020年3月	買建	20	121,172,264	123,353,604	1.36%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2020年1 月	買建	100,000	10,824,320	10,947,000	0.12%
		米ドル売/円買 2020年1 月	売建	250,000	27,375,000	27,375,000	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) 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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,145円
純資産総額	19億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.7%
3カ月間	11.4%
6カ月間	10.8%
1年間	25.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	31.5%



※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	直近1年間分配金合計額: 0円			設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月			
分配金	0円	0円	0円			

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,611	95.6%	米ドル	58.7%	金融	18.2%	S&P500 EMINI FUT 202003	アメリカ	2.9%
外国リート	71	2.1%	ユーロ	9.1%	情報技術	15.3%	APPLE INC	アメリカ	2.4%
外国投資証券	7	1.5%	香港ドル	6.5%	ヘルスケア	10.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.1%
			英ポンド	4.7%	一般消費財・サービス	8.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.4%
コール・ローン、その他		5.0%	カナダドル	2.9%	資本財・サービス	8.2%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.4%
合計	1,689	-	スイス・フラン	2.7%	コミュニケーション・サービス	7.9%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	0.9%
国・地域別構成			台湾ドル	2.7%	生活必需品	7.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.9%
アメリカ		56.1%	ブラジル・レアル	2.6%	エネルギー	7.1%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
中国		6.1%	豪ドル	2.0%	素材	5.1%	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	0.8%
その他		37.0%	その他	8.1%	公益事業、他	4.1%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.8%
合計		99.2%	合計	100.0%	合計	91.4%	合計		14.3%

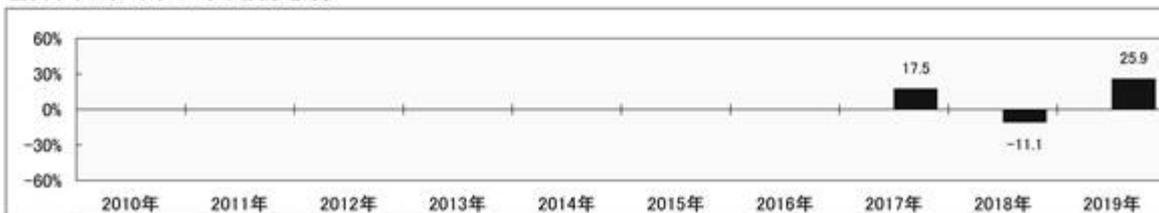
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンド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12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,169,809,097	99.90
内 日本	2,169,809,097	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,148,790	0.10
純資産総額	2,171,957,887	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	1,517,773,571	1.4302 2,170,804,435	1.4296 2,169,809,097	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,379,006,108	1,379,006,108	1.0010	1.0010
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,161,576,187	2,161,576,187	1.0025	1.0025
2018年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	-
7月末日	2,134,078,950	-	1.0333	-
8月末日	2,159,096,007	-	1.0477	-
9月末日	2,125,311,401	-	1.0361	-
10月末日	2,126,571,354	-	1.0312	-
11月末日	2,142,115,091	-	1.0276	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,135,143,578	2,135,143,578	1.0249	1.0249
12月末日	2,171,957,887	-	1.0243	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.1
第2計算期間	0.1
第3計算期間	2.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,498,842,558	122,203,095
第2計算期間	1,389,815,832	611,289,476

第3計算期間	844,707,447	917,630,059
--------	-------------	-------------

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	72,956,753,620	87.25
内 日本	72,956,753,620	87.25
地方債証券	4,262,043,800	5.10
内 日本	4,262,043,800	5.10
特殊債券	3,022,050,200	3.61
内 日本	3,022,050,200	3.61
社債券	2,997,921,000	3.59
内 日本	2,997,921,000	3.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	375,112,461	0.45
純資産総額	83,613,881,081	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12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	127 5年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	100.33 1,585,308,800	100.28 1,584,455,600	0.100000 2021/03/20	1.89
2	129 5年国債	日本	国債証券	1,340,000,000	100.49 1,346,633,000	100.41 1,345,601,200	0.100000 2021/09/20	1.61
3	131 5年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	100.64 1,177,534,800	100.52 1,176,189,300	0.100000 2022/03/20	1.41
4	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.99 1,070,937,000	101.60 1,066,831,500	0.100000 2027/12/20	1.28
5	342 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.68 1,016,850,000	101.40 1,014,050,000	0.100000 2026/03/20	1.21

6	128 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.41 1,004,180,000	100.34 1,003,490,000	0.100000 2021/06/20	1.20
7	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	103.50 931,527,000	103.26 929,412,000	0.600000 2024/06/20	1.11
8	135 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.96 888,456,800	100.78 886,925,600	0.100000 2023/03/20	1.06
9	132 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.71 886,292,000	100.59 885,192,000	0.100000 2022/06/20	1.06
10	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.89 815,192,000	101.53 812,248,000	0.100000 2028/06/20	0.97
11	343 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.73 813,895,000	101.46 811,704,000	0.100000 2026/06/20	0.97
12	340 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	103.29 785,021,600	103.04 783,142,000	0.400000 2025/09/20	0.94
13	333 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	103.31 723,213,000	103.10 721,728,000	0.600000 2024/03/20	0.86
14	346 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.91 713,426,000	101.52 710,668,000	0.100000 2027/03/20	0.85
15	335 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	103.21 712,183,500	102.98 710,568,900	0.500000 2024/09/20	0.85
16	345 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.83 712,827,000	101.50 710,549,000	0.100000 2026/12/20	0.85
17	344 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.78 712,502,000	101.48 710,402,000	0.100000 2026/09/20	0.85
18	139 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.16 708,169,000	100.99 706,944,000	0.100000 2024/03/20	0.85
19	137 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.05 707,357,000	100.89 706,251,000	0.100000 2023/09/20	0.84
20	136 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.03 707,245,000	100.85 705,950,000	0.100000 2023/06/20	0.84
21	406 2年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.52 703,689,000	100.43 703,059,000	0.100000 2021/11/01	0.84
22	352 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	101.82 702,558,000	101.48 700,267,200	0.100000 2028/09/20	0.84
23	130 5年国債	日本	国債証券	680,000,000	100.54 683,726,200	100.47 683,196,000	0.100000 2021/12/20	0.82
24	138 5年国債	日本	国債証券	660,000,000	101.07 667,113,000	100.93 666,164,400	0.100000 2023/12/20	0.80
25	141 5年国債	日本	国債証券	650,000,000	101.25 658,164,000	101.08 657,072,000	0.100000 2024/09/20	0.79

26	330 10年国債	日本	国債証券	612,000,000	103.72 634,809,240	103.48 633,297,600	0.800000 2023/09/20	0.76
27	348 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	101.97 611,832,000	101.59 609,552,000	0.100000 2027/09/20	0.73
28	354 10年国債	日本	国債証券	600,000,000	101.68 610,110,000	101.33 608,034,000	0.100000 2029/03/20	0.73
29	339 10年国債	日本	国債証券	590,000,000	103.16 608,649,900	102.91 607,169,000	0.400000 2025/06/20	0.73
30	140 5年国債	日本	国債証券	600,000,000	101.19 607,140,000	101.02 606,174,000	0.100000 2024/06/20	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	87.25%
地方債証券	5.10%
特殊債券	3.61%
社債券	3.59%
合計	99.55%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報) 運用実績

## ●FWO 日本債券インデックス

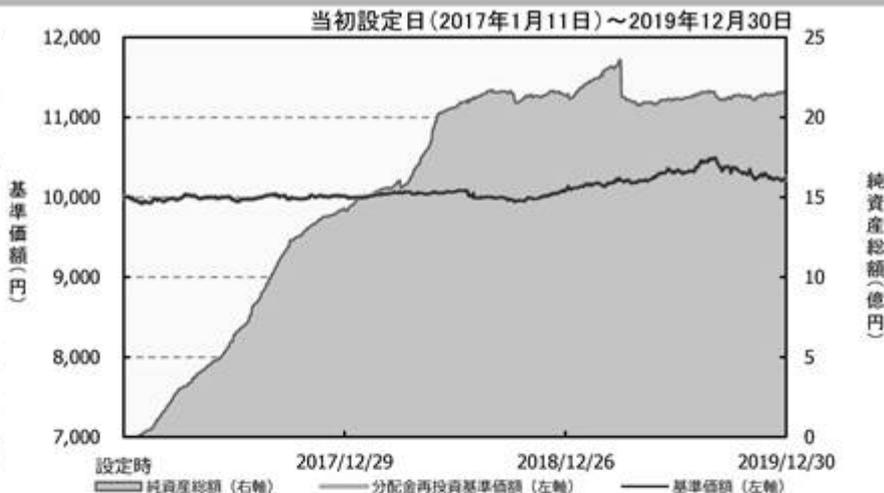
2019年12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,243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	-0.3%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	-0.8%
1年間	1.4%
3年間	-
5年間	-
設定来	2.4%



※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)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

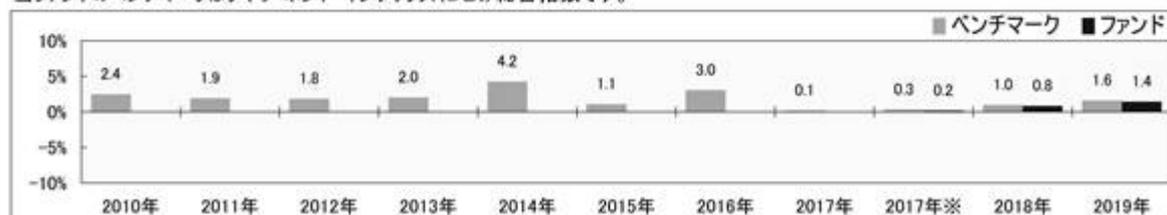
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	349	99.5%	直接利回り(%)	127 5年国債	0.100	2021/03/20	1.9%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	129 5年国債	0.100	2021/09/20	1.6%	
コール・ローン、その他		0.5%	修正デュレーション	131 5年国債	0.100	2022/03/20	1.4%	
合計	349	100.0%	残存年数	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.3%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率				
国債		86.9%	AAA	90.0%	128 5年国債	0.100	2021/06/20	1.2%
地方債		6.2%	AA	4.7%	334 10年国債	0.600	2024/06/20	1.1%
事業債		3.8%	A	2.6%	135 5年国債	0.100	2023/03/20	1.1%
政府保証債		2.1%	BBB	0.1%	132 5年国債	0.100	2022/06/20	1.1%
その他		0.4%	BB以下・無格付	2.5%	351 10年国債	0.100	2028/06/20	1.0%
合計		99.5%	合計	100.0%	合計			12.8%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.5%保有しております。

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

## 年間収益率の推移

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



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

※2017年※は設定日(1月11日)から年末、2019年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,542,839,820	99.91
内 日本	3,542,839,820	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,359,317	0.09
純資産総額	3,546,199,137	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	3,490,138,726	1.0208 3,562,841,852	1.0151 3,542,839,820	99.91

(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	99.91%
合計	99.91%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	2,166,190,168	2,166,190,168	1.0078	1.0078
第2計算期間末 (2018年11月30日)	3,598,169,224	3,598,169,224	0.9860	0.9860
2018年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	-
7月末日	3,509,441,848	-	1.0478	-
8月末日	3,611,621,819	-	1.0801	-
9月末日	3,543,599,227	-	1.0718	-
10月末日	3,506,555,090	-	1.0582	-
11月末日	3,541,310,451	-	1.0573	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	3,539,153,139	3,539,153,139	1.0567	1.0567
12月末日	3,546,199,137	-	1.0505	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.8
第2計算期間	2.2
第3計算期間	7.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,296,791,192	148,346,007
第2計算期間	2,190,846,317	691,122,259

第3計算期間	1,134,630,067	1,434,493,694
--------	---------------	---------------

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	90,498,143,669	97.11
内 ユーロ	33,956,455,148	36.44
内 シンガポール	411,235,487	0.44
内 マレーシア	315,991,889	0.34
内 ノルウェー	181,329,433	0.19
内 スウェーデン	375,712,408	0.40
内 デンマーク	438,471,274	0.47
内 イギリス	5,828,422,044	6.25
内 ポーランド	500,942,812	0.54
内 カナダ	1,666,056,577	1.79
内 アメリカ	43,756,196,061	46.95
内 メキシコ	775,350,323	0.83
内 南アフリカ	483,189,848	0.52
内 オーストラリア	1,808,790,365	1.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,697,849,305	2.89
純資産総額	93,195,992,974	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
債券先物取引(買建)	1,824,837,430	1.96
内 イギリス	151,606,707	0.16
内 ドイツ	837,192,055	0.90
内 アメリカ	836,038,668	0.90
為替予約取引(売建)	92,117,196,560	98.84
内 日本	92,117,196,560	98.84

(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12月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	30,040,000	102.47 3,372,482,219	102.21 3,364,180,825	3.625000 2021/02/15	3.61
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	22,990,000	100.54 2,532,536,962	100.77 2,538,254,603	2.125000 2021/06/30	2.72
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	16,720,000	99.76 1,827,538,368	100.32 1,837,705,098	1.750000 2022/09/30	1.97
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	15,450,000	99.82 1,689,655,136	100.33 1,698,372,551	1.750000 2022/02/28	1.82
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	15,000,000	99.35 1,632,797,878	100.04 1,644,090,228	1.625000 2022/11/15	1.76
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	15,000,000	98.88 1,625,040,141	99.14 1,629,398,232	1.125000 2021/09/30	1.75
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	13,946,000	100.44 1,534,784,137	100.75 1,539,383,188	2.000000 2021/11/15	1.65
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	12,905,000	103.83 1,468,093,783	104.10 1,471,854,682	2.750000 2023/11/15	1.58
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	12,580,000	103.03 1,420,040,006	103.46 1,425,952,762	2.500000 2024/05/15	1.53
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	11,310,000	103.29 1,279,912,612	103.03 1,276,780,566	2.500000 2023/08/15	1.37
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	11,020,000	99.68 1,203,572,190	100.39 1,212,059,869	1.750000 2023/05/15	1.30
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	9,020,000	100.45 992,707,887	101.42 1,002,273,965	2.000000 2025/08/15	1.08
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	8,700,000	101.85 970,815,213	102.75 979,384,230	2.250000 2025/11/15	1.05

14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	7,900,000	106.65 923,133,277	108.02 934,964,990	2.875000 2028/05/15	1.00
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	8,300,000	101.17 920,069,212	102.04 927,953,260	2.125000 2025/05/15	1.00
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	7,500,000	105.82 869,522,940	110.40 907,206,102	2.875000 2043/05/15	0.97
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	7,810,000	102.28 875,175,030	102.62 878,124,769	2.250000 2024/11/15	0.94
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	7,200,000	101.40 799,902,380	101.92 803,985,462	2.125000 2024/07/31	0.86
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	7,000,000	101.28 776,806,078	100.89 773,806,941	1.875000 2024/08/31	0.83
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	4,900,000	141.60 760,201,561	141.26 758,372,676	6.250000 2030/05/15	0.81
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	4,750,000	131.52 684,458,844	131.80 685,921,196	6.125000 2027/11/15	0.74
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,850,000	101.14 648,268,985	101.34 649,533,636	2.000000 2026/11/15	0.70
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,040,000	114.29 631,128,607	115.42 637,334,447	3.125000 2044/08/15	0.68
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,750,000	97.09 611,696,213	98.20 618,649,439	1.500000 2026/08/15	0.66
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,500,000	101.41 611,076,378	101.36 610,817,268	2.625000 2021/05/15	0.66
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,000,000	111.55 611,120,783	110.35 604,502,778	3.125000 2028/11/15	0.65
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	4,500,000	110.73 545,940,766	116.95 576,601,680	3.125000 2048/05/15	0.62
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,165,000	97.81 553,496,002	99.10 560,790,162	1.625000 2026/05/15	0.60
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,000,000	100.11 548,440,926	100.56 550,878,636	1.875000 2022/01/31	0.59
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ 力	国債証 券	5,000,000	99.76 546,523,626	99.03 542,491,818	1.375000 2023/09/30	0.58

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.11%

合計	97.11%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	T-BOND 2020年3月	買建	8	137,295,136	137,525,190	0.15%
		T-NOTE(10YR) 2020年3月	買建	40	564,259,797	563,823,150	0.60%
		T-NOTE(2YR) 2020年3月	買建	4	94,407,839	94,406,485	0.10%
		T-BOND(ULTRA LONG) 2020年3月	買建	2	40,038,023	40,283,843	0.04%
	イギリス	LONG GILT FUTURE 2020 年3月	買建	8	151,477,001	151,606,707	0.16%
	ドイツ	BUNDS 2020年3月	買建	9	189,659,030	189,261,805	0.20%
		BOBL(5YR) 2020年3月	買建	5	82,127,778	82,095,673	0.09%
		SCHATZ(2YR) 2020年3月	買建	2	27,439,745	27,439,157	0.03%
		BUXL(30YR) 2020年3月	買建	2	49,783,689	49,368,915	0.05%
		BTP 10YR 2020年3月	買建	5	88,204,537	87,536,449	0.09%
	OAT 10YR 2020年3月	買建	20	402,071,876	401,490,056	0.43%	
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2020年1 月	売建	405,724,000	44,292,767,362	44,414,606,280	47.66%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2020年1月	売建	5,579,000	445,530,013	451,954,790	0.48%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	33,446,000	382,371,395	392,656,040	0.42%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2020年1月	売建	18,000,000	502,320,600	517,140,000	0.55%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	14,933,000	177,085,967	185,617,190	0.20%

マレーシア・リングgit 売/円買 2020年1月	売建	11,280,000	298,448,496	299,484,000	0.32%
メキシコ・ペソ売/円買 2020年1月	売建	138,379,000	770,369,730	802,598,200	0.86%
英ポンド売/円買 2020年 1月	売建	41,385,000	5,853,453,015	5,935,436,700	6.37%
ユーロ売/円買 2020年1 月	売建	282,117,000	34,057,305,298	34,567,796,010	37.09%
デンマーク・クローネ 売/円買 2020年1月	売建	28,702,000	463,853,022	470,712,800	0.51%
カナダ・ドル売/円買 2020年1月	売建	20,389,000	1,676,430,474	1,707,170,970	1.83%
南アフリカ・ランド売/ 円買 2020年1月	売建	65,565,000	485,712,076	512,718,300	0.55%
豪ドル売/円買 2020年1 月	売建	24,311,000	1,797,008,342	1,859,305,280	2.00%

(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) 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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,505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	-0.6%
3カ月間	-2.0%
6カ月間	0.7%
1年間	5.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	5.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	467	99.0%	日本円	100.5%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2021/02/15	3.6%
			マレーシア・リングギット	0.0%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2021/06/30	2.7%
コール・ローン、その他		3.0%	メキシコ・ペソ	0.0%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2022/09/30	2.0%
合計	467	-	南アフリカ・ランド	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2022/02/28	1.8%
債券種別構成			シンガポール・ドル	0.0%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	1.8%
国債		97.0%	スウェーデン・クローネ	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2021/09/30	1.7%
			ノルウェー・クローネ	-0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2021/11/15	1.7%
			カナダ・ドル	-0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	1.6%
			ポーランド・ズロチ	-0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	1.5%
			その他	-0.5%	BB	United States Treasury Note/Bond	2023/08/15	1.4%
合計		97.0%	合計	100.0%	合計	合計		19.8%

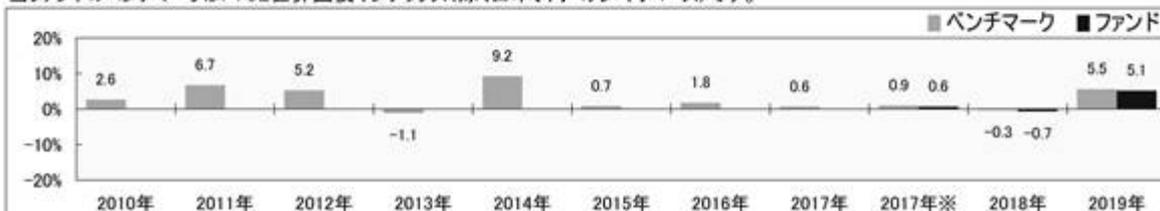
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。



※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12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】(2019年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,870,076,930	99.91
内 日本	2,870,076,930	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,704,324	0.09
純資産総額	2,872,781,254	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	793,297,870	2.8805 2,285,102,698	2.8900 2,292,630,844	79.81
2	ダイワ新興国債券インデック ス・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	395,754,977	1.4080 557,251,009	1.4591 577,446,086	20.10

(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	99.91%
合計	99.91%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,406,787,686	1,406,787,686	1.0477	1.0477
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,442,336,372	2,442,336,372	1.0222	1.0222
2018年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	-
7月末日	2,744,710,491	-	1.0479	-
8月末日	2,741,313,335	-	1.0432	-
9月末日	2,752,572,337	-	1.0526	-
10月末日	2,808,820,026	-	1.0686	-
11月末日	2,829,503,033	-	1.0657	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,833,746,066	2,833,746,066	1.0673	1.0673
12月末日	2,872,781,254	-	1.0775	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,434,988,289	93,204,954

第2計算期間	1,446,419,314	399,973,906
第3計算期間	1,008,953,213	743,168,804

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	189,342,701,140	98.22
内 ユーロ	71,187,944,814	36.93
内 シンガポール	797,074,517	0.41
内 マレーシア	877,392,496	0.46
内 ノルウェー	426,202,518	0.22
内 スウェーデン	660,302,135	0.34
内 デンマーク	939,307,798	0.49
内 イギリス	12,281,158,617	6.37
内 ポーランド	1,087,664,726	0.56
内 カナダ	3,610,410,504	1.87
内 アメリカ	90,974,570,725	47.19
内 メキシコ	1,634,954,101	0.85
内 南アフリカ	1,123,596,842	0.58
内 オーストラリア	3,742,121,347	1.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,436,470,565	1.78
純資産総額	192,779,171,705	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,367,003,990	1.23
内 日本	2,367,003,990	1.23

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

(注2) 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12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,168,000	100.04 895,261,932	100.04 895,261,932	1.625000 2022/11/15	0.46
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,300,000	111.23 889,636,183	110.35 882,574,055	3.125000 2028/11/15	0.46
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,907,000	100.76 872,952,697	100.84 873,628,404	2.250000 2021/04/30	0.45
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,550,000	102.04 844,102,061	101.85 842,555,239	2.125000 2024/03/31	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	108.99 800,057,955	108.19 794,207,561	2.875000 2028/08/15	0.41
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	105.16 795,001,980	104.36 788,976,947	2.375000 2029/05/15	0.41
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	108.81 774,893,776	108.02 769,274,992	2.875000 2028/05/15	0.40
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	107.23 775,404,764	106.38 769,243,986	2.625000 2029/02/15	0.40
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,029,000	99.50 766,300,660	99.10 763,174,065	1.625000 2026/05/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.53 744,919,365	97.82 739,544,461	1.625000 2029/08/15	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	107.65 743,071,855	106.93 738,109,116	2.750000 2028/02/15	0.38
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	101.83 725,207,769	101.34 721,704,040	2.000000 2026/11/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 696,497,657	101.10 696,442,553	2.000000 2022/11/30	0.36
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	103.32 697,576,338	103.11 696,151,858	2.375000 2024/08/15	0.36
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,084,000	182.59 690,058,457	178.66 675,191,346	4.500000 2041/04/25	0.35
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 670,437,300	103.08 666,345,563	2.250000 2027/08/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 667,199,332	102.62 665,733,259	2.250000 2024/11/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 659,773,913	102.75 657,425,736	2.250000 2025/11/15	0.34

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,700,000	104.53 652,837,691	103.96 649,271,842	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,788,000	102.32 648,895,902	102.04 647,107,646	2.125000 2025/05/15	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,800,000	101.58 645,519,850	101.42 644,528,551	2.000000 2024/05/31	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	4,800,000	125.03 657,523,025	122.55 644,496,779	3.375000 2048/11/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,743,000	101.71 640,012,788	101.50 638,685,170	2.000000 2025/02/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,743,000	101.75 640,258,178	101.42 638,144,055	2.000000 2025/08/15	0.33
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,087,000	126.60 634,039,360	125.25 627,288,293	2.500000 2030/05/25	0.33
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,420,000	116.79 632,609,269	115.41 625,134,820	1.500000 2031/05/25	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,500,000	103.78 625,363,549	103.14 621,549,218	2.250000 2027/11/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,340,000	103.55 605,843,091	103.04 602,871,035	2.250000 2027/02/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,229,000	104.47 598,531,762	104.29 597,500,561	2.750000 2024/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	4,850,000	114.37 607,749,862	112.03 595,294,643	2.875000 2049/05/15	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 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	98.22%
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。

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位:円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2020年1月	買建	190,000	14,462,800	14,533,100	0.01%
		南アフリカ・ランド買/円売 2020年2月	買建	5,300,000	41,054,791	41,234,000	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2020年2月	買建	281,000	23,443,239	23,491,600	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2020年1月	買建	180,000	15,033,600	15,075,000	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2020年1月	買建	500,000	8,141,500	8,200,000	0.00%
		ユーロ買/円売 2020年1月	買建	8,864,000	1,073,767,823	1,086,105,920	0.56%
		英ポンド買/円売 2020年2月	買建	305,000	43,636,685	43,700,400	0.02%
		英ポンド買/円売 2020年1月	買建	336,000	47,958,684	48,194,980	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年2月	買建	7,582,000	43,653,888	43,748,140	0.02%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2020年2月	買建	2,816,000	34,869,173	34,918,400	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2020年2月	買建	987,000	28,244,515	28,297,290	0.01%
		米ドル買/円売 2020年1月	買建	3,472,000	380,374,929	380,175,630	0.20%
		米ドル買/円売 2020年2月	買建	5,379,000	586,180,828	587,763,330	0.30%
		南アフリカ・ランド買/円売 2020年1月	買建	600,000	4,646,400	4,692,000	0.00%
		豪ドル買/円売 2020年2月	買建	90,000	6,864,138	6,874,200	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12月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	14,908,917,680	95.87
内 タイ	1,431,321,984	9.20
内 マレーシア	923,257,110	5.94
内 フィリピン	32,860,080	0.21
内 インドネシア	1,494,559,004	9.61
内 ポーランド	1,306,316,652	8.40
内 ロシア	1,348,737,571	8.67
内 ハンガリー	611,719,643	3.93
内 ルーマニア	391,683,493	2.52
内 トルコ	532,704,480	3.43
内 チェコ	562,141,589	3.61
内 メキシコ	1,467,753,295	9.44
内 ドミニカ共和国	23,089,860	0.15
内 コロンビア	953,750,241	6.13
内 ペルー	519,549,760	3.34
内 チリ	425,991,235	2.74
内 ブラジル	1,515,223,131	9.74
内 ウルグアイ	22,759,961	0.15
内 南アフリカ	1,345,498,591	8.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	641,779,792	4.13
純資産総額	15,550,697,472	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)	274,137,840	1.76
内 日本	274,137,840	1.76

(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12月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	30,050,000	112.86 265,895,146	112.29 264,546,256	10.500000 2026/12/21	1.70
2	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	8,210,000	110.55 245,421,451	111.00 246,427,103	10.000000 2023/01/01	1.58
3	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	7,250,000	116.13 227,666,291	117.41 230,176,445	10.000000 2027/01/01	1.48
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	6,390,000	113.61 196,314,779	114.60 198,024,392	10.000000 2025/01/01	1.27
5	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	8,800,000	78.06 185,750,845	81.28 193,428,801	- 2023/07/01	1.24
6	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,240,000	102.91 184,686,849	103.22 185,250,062	2.500000 2026/07/25	1.19
7	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,550,000,000	121.77 183,947,986	118.66 179,256,859	10.000000 2024/07/24	1.15
8	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	7,200,000	86.26 167,939,815	90.12 175,460,613	- 2022/01/01	1.13
9	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,700,000	104.22 170,858,127	105.15 172,382,694	2.750000 2028/04/25	1.11
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	23,520,000	90.96 167,737,152	88.36 162,933,012	8.750000 2048/02/28	1.05
11	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	6,030,000	89.82 146,462,233	93.02 151,680,009	- 2021/07/01	0.98
12	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,335,000,000	106.12 152,732,904	104.48 150,378,340	7.000000 2022/05/04	0.97
13	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	5,030,000	105.74 143,823,683	105.10 142,958,652	10.000000 2021/01/01	0.92
14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,950,000	102.81 137,322,288	106.78 142,626,313	7.750000 2031/05/29	0.92
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	23,230,000	101.20 136,831,799	103.96 140,557,872	7.500000 2027/06/03	0.90
16	Colombian TES	コロンビア	国債証券	3,810,000,000	111.91 141,567,728	109.30 138,264,610	7.500000 2026/08/26	0.89

17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,750,000	103.15 136,576,798	104.22 138,004,407	8.000000 2023/12/07	0.89
18	Colombian TES	コロンビア	国債証券	4,090,000,000	101.94 138,429,621	99.61 135,270,647	6.000000 2028/04/28	0.87
19	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	20,350,000	112.38 133,110,436	113.68 134,646,287	10.000000 2024/12/05	0.87
20	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	29,000,000	118.38 124,627,870	123.84 130,367,420	3.775000 2032/06/25	0.84
21	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	21,950,000	98.32 125,610,481	99.70 127,365,753	6.500000 2021/06/10	0.82
22	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	32,900,000	102.72 122,680,063	105.17 125,610,930	2.125000 2026/12/17	0.81
23	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	26,050,000	125.49 118,667,569	129.94 122,875,104	4.875000 2029/06/22	0.79
24	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,230,000	100.49 122,253,727	100.54 122,320,251	1.750000 2021/07/25	0.79
25	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	30,600,000	104.64 116,240,905	104.77 116,377,531	3.650000 2021/12/17	0.75
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	19,450,000	97.92 110,846,724	99.50 112,638,664	6.500000 2022/06/09	0.72
27	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	25,100,000	116.75 106,374,456	122.81 111,900,430	3.400000 2036/06/17	0.72
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	17,230,000	109.50 109,806,594	111.38 111,690,304	8.500000 2029/05/31	0.72
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	13,150,000,000	106.17 110,294,704	106.98 111,138,250	8.375000 2024/03/15	0.71
30	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	15,100,000	94.91 112,364,219	93.86 111,124,693	8.000000 2030/01/31	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	95.87%
合計	95.87%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ルーマニア・レイ買/円 売 2020年1月	買建	200,000	5,037,000	5,118,000	0.03%
		チェコ・コルナ買/円売 2020年1月	買建	1,900,000	9,121,710	9,139,000	0.06%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2020年1月	買建	15,000,000	5,547,750	5,560,500	0.04%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2020年1月	買建	9,855,000	74,127,161	77,066,100	0.50%
		ポーランド・ズロチ買/ 円売 2020年1月	買建	2,733,000	77,441,570	78,519,090	0.50%
		トルコ・リラ買/円売 2020年1月	買建	1,809,000	34,097,701	33,195,150	0.21%
		メキシコ・ペソ買/円売 2020年1月	買建	11,300,000	63,314,869	65,540,000	0.42%

(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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,775円
純資産総額	28億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.1%
3カ月間	2.4%
6カ月間	3.4%
1年間	6.4%
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	直近1年間分配金合計額: 0円			設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月			
分配金	0円	0円	0円			

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

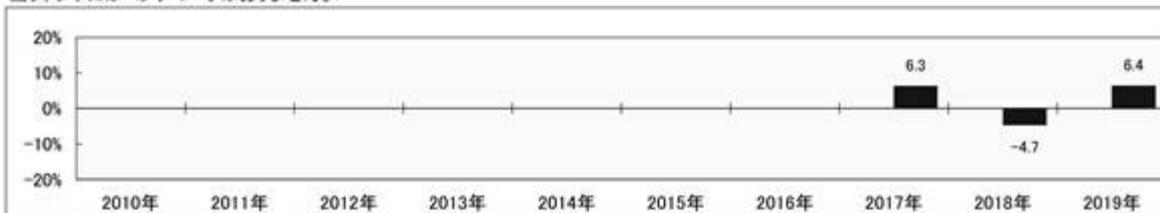
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率	
外国債券	920	97.7%	米ドル	38.2%	直接利回り(%)	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.4%	
			ユーロ	30.1%	最終利回り(%)	2.0	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.3%	英ポンド	5.2%	修正デュレーション	7.2	United States Treasury Note/Bond	2028/11/15	0.4%
合計	920	100.0%	メキシコ・ペソ	2.7%	残存年数	9.2	United States Treasury Note/Bond	2021/04/30	0.4%
債券種別構成		比率	南アフリカ・ランド	2.4%	格付別構成	比率	United States Treasury Note/Bond	2024/03/31	0.3%
国債		97.7%	ポーランド・ズロチ	2.3%	AAA	64.8%	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.3%
			ブラジル・レアル	2.0%	AA	7.5%	United States Treasury Note/Bond	2029/05/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	2.0%	A	17.1%	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	2023/01/01	0.3%
			タイ・バーツ	1.9%	BBB	10.6%	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.3%
			その他	13.2%	BB	0.0%	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.3%
合計		97.7%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		3.5%

※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12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップオンライン J - REITインデックス】

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,156,387,851	99.95
内 日本	1,156,387,851	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	580,720	0.05
純資産総額	1,156,968,571	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	350,378,091	3.3830 1,185,363,342	3.3004 1,156,387,851	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	564,311,815	564,311,815	0.9372	0.9372
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,027,403,305	1,027,403,305	1.0585	1.0585
2018年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	-
7月末日	1,132,698,898	-	1.2053	-
8月末日	1,178,309,406	-	1.2504	-
9月末日	1,182,150,419	-	1.3090	-
10月末日	1,191,673,903	-	1.3520	-
11月末日	1,190,699,689	-	1.3396	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,183,900,381	1,183,900,381	1.3333	1.3333
12月末日	1,156,968,571	-	1.3002	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.3
第2計算期間	12.9
第3計算期間	26.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

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

第3計算期間	281,360,657	364,052,038
--------	-------------	-------------

(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12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	373,725,087,140	98.25
内 日本	373,725,087,140	98.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,672,638,512	1.75
純資産総額	380,397,725,652	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)	6,618,080,000	1.74
内 日本	6,618,080,000	1.74

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

(注2) 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12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 日本ビルファンド	日本	投資証券	33,047	796,606.76 26,325,463,656	795,000.00 26,272,365,000	6.91
2 ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	34,126	718,208.61 24,509,587,167	720,000.00 24,570,720,000	6.46
3 野村不動産マスターF	日本	投資証券	110,169	193,193.30 21,283,913,747	185,600.00 20,447,366,400	5.38
4 オリックス不動産投資	日本	投資証券	67,996	229,198.61 15,584,589,257	235,300.00 15,999,458,800	4.21

5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	76,624	202,835.53 15,542,069,662	203,600.00 15,600,646,400	4.10
6	日本リテールファンド	日本	投資証券	64,498	219,043.82 14,127,888,717	233,300.00 15,047,383,400	3.96
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	49,031	284,955.59 13,971,657,742	276,400.00 13,552,168,400	3.56
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	46,008	293,518.56 13,504,202,178	283,600.00 13,047,868,800	3.43
9	GLP投資法人	日本	投資証券	84,997	135,694.22 11,533,602,168	134,900.00 11,466,095,300	3.01
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	32,367	346,826.15 11,225,722,291	344,000.00 11,134,248,000	2.93
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	21,602	495,288.94 10,699,231,844	476,500.00 10,293,353,000	2.71
12	API投資法人	日本	投資証券	17,100	532,551.07 9,106,623,414	544,000.00 9,302,400,000	2.45
13	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	149,692	63,340.31 9,481,539,046	61,900.00 9,265,934,800	2.44
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	99,782	91,041.53 9,084,306,776	91,400.00 9,120,074,800	2.40
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	109,935	82,265.59 9,043,868,506	81,200.00 8,926,722,000	2.35
16	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	10,557	818,464.44 8,640,529,165	838,000.00 8,846,766,000	2.33
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	11,340	664,293.71 7,533,090,739	686,000.00 7,779,240,000	2.05
18	産業ファンド	日本	投資証券	43,951	154,535.76 6,792,001,383	165,700.00 7,282,680,700	1.91
19	森ヒルズリート	日本	投資証券	39,263	168,568.20 6,618,493,312	180,500.00 7,086,971,500	1.86
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,877	819,842.42 6,457,898,784	834,000.00 6,569,418,000	1.73
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	22,298	268,706.72 5,991,622,621	277,100.00 6,178,775,800	1.62
22	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	29,022	192,232.37 5,578,967,984	197,200.00 5,723,138,400	1.50
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	12,121	453,550.40 5,497,484,498	456,500.00 5,533,236,500	1.45
24	イオンリート投資	日本	投資証券	36,829	138,049.75 5,084,234,384	148,700.00 5,476,472,300	1.44

25	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	30,559	173,573.39 5,304,229,356	175,800.00 5,372,272,200	1.41
26	日本リート投資法人	日本	投資証券	11,085	443,964.18 4,921,343,030	478,000.00 5,298,630,000	1.39
27	MCUBS MidCity 投資法人	日本	投資証券	43,783	115,640.37 5,063,082,397	118,000.00 5,166,394,000	1.36
28	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	31,729	155,224.27 4,925,111,120	161,300.00 5,117,887,700	1.35
29	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	219,243	20,467.42 4,487,339,366	22,480.00 4,928,582,640	1.30
30	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	14,209	344,670.86 4,897,428,327	344,000.00 4,887,896,000	1.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### 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	98.25%
合計	98.25%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2020年3月	買建	3,110	6,661,742,100	6,618,080,000	1.74%

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

(注2) 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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,002円
純資産総額	11億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.9%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	12.6%
1年間	25.2%
3年間	-
5年間	-
設定来	30.0%

※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)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

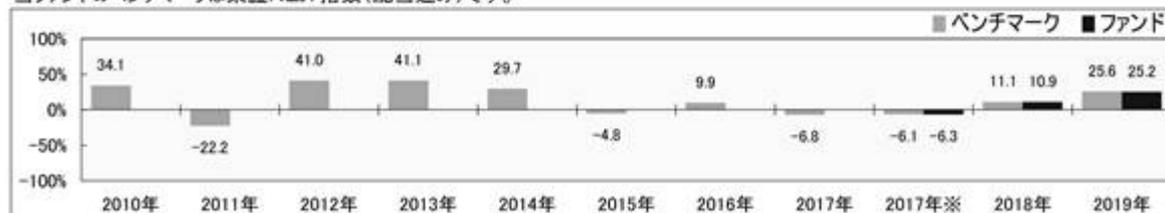
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	63	98.2%	オフィス不動産	32.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.9%
国内リート先物	1	1.7%	各種不動産	28.6%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	6.5%
			工業用不動産	13.5%	野村不動産マスターF	各種不動産	5.4%
			住宅用不動産	8.7%	オリックス不動産投資	オフィス不動産	4.2%
			店舗用不動産	8.7%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	4.1%
			ホテル・リゾート不動産	6.2%	日本リテールファンド	店舗用不動産	4.0%
			ヘルスクエア不動産	0.4%	日本プロロジリート	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	3.4%
					GLP投資法人	工業用不動産	3.0%
コール・ローン、その他		1.8%			アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	2.9%
合計	64	-	合計	98.2%	合計		43.9%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2019年は12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	834,957,033	100.39
内 日本	834,957,033	100.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,266,222	0.39
純資産総額	831,690,811	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)	849,374,236	102.13
内 日本	849,374,236	102.13

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

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

(注3) 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12月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	325,468,556	2.5838 840,956,623	2.5654 834,957,033	100.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.39%
合計	100.39%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2020年1月	売建	747,600	55,398,579	57,168,972	6.87%
		カナダ・ドル売/円買 2020年1月	売建	198,300	16,337,937	16,603,659	2.00%
		ユーロ売/円買 2020年1月	売建	411,100	49,676,938	50,372,083	6.06%
		英ポンド売/円買 2020年1月	売建	318,200	44,985,903	45,633,062	5.49%
		米ドル売/円買 2020年1月	売建	5,727,600	626,171,607	627,000,372	75.39%
		イスラエル・シケル 売/円買 2020年1月	売建	22,800	718,842	721,620	0.09%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2020年1月	売建	50,800	3,578,352	3,731,768	0.45%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2020年1月	売建	386,900	30,941,769	31,338,900	3.77%
		香港ドル売/円買 2020年1月	売建	1,196,000	16,696,160	16,803,800	2.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	451,251,233	451,251,233	1.0301	1.0301
第2計算期間末 (2018年11月30日)	767,151,864	767,151,864	1.0317	1.0317
2018年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	-
7月末日	808,107,974	-	1.1247	-
8月末日	819,742,359	-	1.1399	-
9月末日	827,250,529	-	1.1687	-
10月末日	840,074,198	-	1.1886	-
11月末日	843,044,057	-	1.1784	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	839,510,983	839,510,983	1.1735	1.1735
12月末日	831,690,811	-	1.1577	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	0.2
第3計算期間	13.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	464,575,492	36,518,861
第2計算期間	460,818,025	155,301,672
第3計算期間	207,870,721	236,041,881

(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12月30日現在)

投資状況

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

投資信託受益証券		342,852,682	1.24
内 アメリカ		342,852,682	1.24
投資証券		26,811,231,950	97.06
内 ガーンジー		53,211,045	0.19
内 マン島		7,760,179	0.03
内 韓国		4,347,816	0.02
内 香港		520,594,504	1.88
内 シンガポール		1,128,142,660	4.08
内 イスラエル		18,946,294	0.07
内 イギリス		1,466,783,939	5.31
内 アイルランド		36,285,113	0.13
内 オランダ		65,837,317	0.24
内 ベルギー		269,199,991	0.97
内 フランス		921,956,674	3.34
内 ドイツ		69,538,509	0.25
内 スペイン		172,304,424	0.62
内 イタリア		4,748,474	0.02
内 カナダ		523,702,750	1.90
内 アメリカ		19,585,319,651	70.90
内 オーストラリア		1,841,752,245	6.67
内 ニューージーランド		120,800,365	0.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		470,575,662	1.70
純資産総額		27,624,660,294	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)	532,903,483	1.93
内 ドイツ	177,192,840	0.64
内 アメリカ	355,710,643	1.29
為替予約取引(買建)	317,909,000	1.15
内 日本	317,909,000	1.15

(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12月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	115,202	10,022.32 1,154,600,372	9,714.68 1,119,151,164	4.05
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	15,500	62,040.10 961,622,034	63,818.70 989,189,850	3.58
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	56,347	16,543.01 932,151,475	16,169.96 911,128,759	3.30
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	74,200	9,246.64 686,105,367	8,869.97 658,152,338	2.38
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	27,500	23,071.47 634,468,095	23,187.27 637,650,156	2.31
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	25,600	23,477.83 601,032,903	22,880.51 585,741,066	2.12
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	63,800	9,312.49 594,143,551	8,868.88 565,834,672	2.05
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	37,878	13,234.08 501,280,945	12,947.80 490,436,799	1.78
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	59,217	8,376.51 496,033,635	8,025.27 475,232,414	1.72
10	LINK REIT	香港	投資証券	391,500	1,125.72 440,722,231	1,149.51 450,036,689	1.63
11	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	67,779	6,380.44 432,465,475	6,335.85 429,437,902	1.55
12	UNIBAIL-RODAMCO- WESTFIELD	フランス	投資証券	23,700	17,389.03 412,120,520	17,278.14 409,491,918	1.48
13	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	26,100	15,175.48 396,081,750	15,084.22 393,698,163	1.43
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,967	34,178.88 409,019,478	32,838.41 392,977,358	1.42
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	20,600	17,796.26 366,605,180	17,573.42 362,012,534	1.31
16	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	34,000	9,950.56 338,321,280	10,083.90 342,852,682	1.24
17	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	89,500	3,814.33 341,388,522	3,723.94 333,293,024	1.21

18	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	302,050	1,132.64 342,133,442	1,051.38 317,570,779	1.15
19	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	97,997	3,340.26 327,337,278	3,233.11 316,835,629	1.15
20	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,004,270	301.25 302,590,476	300.72 302,007,690	1.09
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	20,828	14,898.62 310,310,193	14,242.80 296,649,038	1.07
22	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	134,200	1,919.05 257,543,788	2,066.30 277,297,675	1.00
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	31,400	9,116.59 286,262,093	8,719.88 273,804,245	0.99
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	53,400	5,260.30 280,902,966	5,077.01 271,112,355	0.98
25	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,500	18,012.65 297,209,547	16,341.96 269,642,498	0.98
26	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	23,500	11,612.26 272,888,542	11,450.11 269,077,717	0.97
27	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	198,010	1,281.85 253,841,032	1,290.74 255,580,631	0.93
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	33,500	8,099.33 271,329,175	7,615.51 255,119,773	0.92
29	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	66,500	3,851.58 256,130,683	3,762.29 250,192,312	0.91
30	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	84,300	2,709.41 228,410,798	2,765.29 233,114,318	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.24%
投資証券	97.06%
合計	98.30%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2020年3月	買建	89	349,457,725	355,710,643	1.29%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2020年3月	買建	150	172,107,736	177,192,840	0.64%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2020年1 月	買建	1,040,000	126,125,498	127,431,200	0.46%
		米ドル買/円売 2020年1 月	買建	1,740,000	189,727,207	190,477,800	0.69%

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

(注2) 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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,577円
純資産総額	8.3億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.8%
3カ月間	-0.9%
6カ月間	4.9%
1年間	20.2%
3年間	-
5年間	-
設定来	15.8%



※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)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

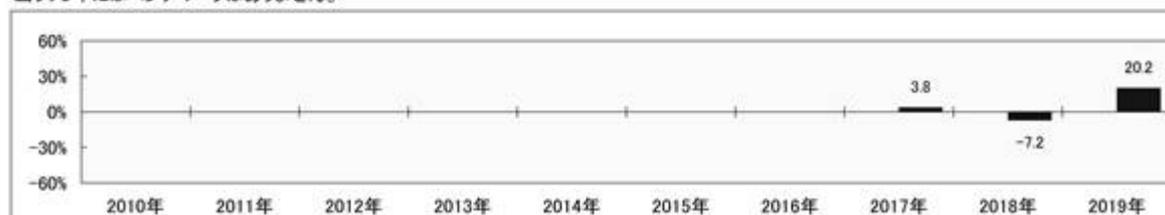
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	306	99.3%	日本円	101.5%	商業施設	20.0%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	4.1%
外国投資信託等	3	1.4%	ユーロ	0.2%	住宅	14.7%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	3.6%
コール・ローン、その他		1.3%	英ポンド	0.1%	オフィス	12.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.3%
合計	309	-	香港ドル	0.0%	産業施設	11.4%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	0.0%	各種不動産	11.2%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.3%
アメリカ		73.7%	韓国ウォン	0.0%	ヘルスケア	9.6%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
オーストラリア		6.7%	ニュージーランド・ドル	-0.0%	特殊用途施設	9.2%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.1%
イギリス		5.3%	イスラエル・シケル	-0.0%	貸倉庫	5.3%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	1.8%
シンガポール		4.1%	カナダ・ドル	-0.1%	ホテル/リゾート	3.9%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
その他		10.8%	その他	-1.7%			LINK REIT	商業施設	香港	1.6%
合計		100.6%	合計	100.0%	合計	97.3%	合計			25.0%

※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12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】 (2019年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	593,268,893	99.99
内 日本	593,268,893	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	37,203	0.01
純資産総額	593,306,096	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12月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	231,257,852	2.5837 597,512,372	2.5654 593,268,893	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	312,291,612	312,291,612	1.0273	1.0273
第2計算期間末 (2018年11月30日)	561,256,874	561,256,874	1.0501	1.0501
2018年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	-
7月末日	556,927,244	-	1.1040	-
8月末日	554,980,999	-	1.0958	-
9月末日	575,271,163	-	1.1413	-
10月末日	593,512,763	-	1.1797	-
11月末日	597,474,293	-	1.1759	-
第3計算期間末 (2019年12月2日)	595,752,247	595,752,247	1.1725	1.1725
12月末日	593,306,096	-	1.1637	-

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	2.2
第3計算期間	11.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

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

第3計算期間	146,810,171	173,148,380
--------	-------------	-------------

(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12月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,637円
純資産総額	5.9億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.0%
3カ月間	2.0%
6カ月間	8.0%
1年間	21.6%
3年間	-
5年間	-
設定来	16.4%



※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)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	306	98.9%	米ドル	73.5%	商業施設	19.9%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	4.1%
外国投資信託等	3	1.3%	豪ドル	6.7%	住宅	14.6%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	3.6%
コール・ローン、その他		1.7%	ユーロ	6.2%	オフィス	11.9%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.3%
合計	309	-	英ポンド	5.5%	産業施設	11.4%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.8%	各種不動産	11.2%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.3%
アメリカ		73.4%	香港ドル	2.0%	ヘルスケア	9.6%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.1%
オーストラリア		6.7%	カナダ・ドル	1.9%	特殊用途施設	9.2%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.0%
イギリス		5.3%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	5.3%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	1.8%
シンガポール		4.1%	イスラエル・シケル	0.1%	ホテル/リゾート	3.9%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
その他		10.7%	その他	-0.2%			LINK REIT	商業施設	香港	1.6%
合計		100.2%	合計	100.0%	合計	96.9%	合計			24.9%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(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12月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 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った契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

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

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

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

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

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時までに受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<sup>\*</sup>）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

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

## 2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに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。

## &lt;一部解約&gt;

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または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<sup>\*</sup>）があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

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

FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	5営業日目
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)	
FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	6営業日目

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

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

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

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

[別表A]

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

[別表B]

ファンド名	価額
FWO TOPIXインデックス FWO 日本債券インデックス FWO J-REITインデックス	申込受付日の基準価額

FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	申込受付日の翌営業日の基準価額
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）	

### 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。<sup>\*</sup>）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。

<sup>\*</sup>「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い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。

- ・お電話によるお問い合わせ先(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) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

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

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

#### 信託約款の変更等

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップオンライン 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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,337,664	-
コール・ローン	2,601,446	3,206,818
親投資信託受益証券	2,014,707,269	2,849,521,064
未収入金	-	2,770,000
流動資産合計	2,018,646,379	2,855,497,882
資産合計	2,018,646,379	2,855,497,882
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,531,637	2,703,040
未払受託者報酬	212,032	286,284
未払委託者報酬	2,014,714	2,720,116
その他未払費用	52,954	72,340
流動負債合計	3,811,337	5,781,780
負債合計	3,811,337	5,781,780
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,797,553,299	2,416,486,034
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	217,281,743	433,230,068
（分配準備積立金）	106,343,778	184,788,890
元本等合計	2,014,835,042	2,849,716,102
純資産合計	2,014,835,042	2,849,716,102
負債純資産合計	2,018,646,379	2,855,497,882

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	9
有価証券売買等損益	100,981,651	168,984,795
営業収益合計	100,981,650	168,984,804
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,334	2,634
受託者報酬	377,289	518,930
委託者報酬	3,585,033	4,930,598
その他費用	94,483	130,525
営業費用合計	4,059,139	5,582,687
営業利益又は営業損失（ ）	105,040,789	163,402,117
経常利益又は経常損失（ ）	105,040,789	163,402,117
当期純利益又は当期純損失（ ）	105,040,789	163,402,117
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	4,286,978	17,114,351
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	202,098,240	217,281,743
剰余金増加額又は欠損金減少額	185,831,267	99,872,900
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	185,831,267	99,872,900
剰余金減少額又は欠損金増加額	69,893,953	64,441,043
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	69,893,953	64,441,043
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	217,281,743	433,230,068

## (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3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,106,392,276円	1,797,553,299円
期中追加設定元本額	1,072,657,156円	1,209,913,301円
期中一部解約元本額	381,496,133円	590,980,566円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,797,553,299口	2,416,486,034口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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す。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(103,549,056円)、投資信託約款に規定される収益調整金(248,443,498円)及び分配準備積立金(81,239,834円)より分配対象額は433,232,388円(1万口当たり1,792.82円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	100,242,073	174,749,313
合計	100,242,073	174,749,313

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1209円	1.1793円
（1万口当たり純資産額）	（11,209円）	（11,793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	2,555,624,273	2,849,521,064	
親投資信託受益証券 合計			2,849,521,064	
合計			2,849,521,064	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2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	11,179,224,344	15,866,424,459
株式	2 3 140,729,270,900	162,602,439,840

派生商品評価勘定		26,461,940	76,885,750
未収入金		76,903,429	44,835,510
未収配当金		875,753,046	717,704,956
未収利息		1,251,373	1,374,718
前払金		21,520,000	-
その他未収収益	4	30,930,674	32,184,457
差入委託証拠金		-	39,360,000
流動資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690
資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		7,672,420	-
前受金		-	86,417,200
未払金		1,030,901,154	1,370,527,390
未払解約金		23,803,900	123,739,000
受入担保金		15,009,839,092	13,103,577,689
その他未払費用		174,575	10,575
流動負債合計		16,072,391,141	14,684,271,854
負債合計		16,072,391,141	14,684,271,854
純資産の部			
元本等			
元本	1	134,890,694,102	147,704,616,967
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,726,591,221	16,992,320,869
元本等合計		142,617,285,323	164,696,937,836
純資産合計		142,617,285,323	164,696,937,836
負債純資産合計		158,689,676,464	179,381,209,690

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	128,627,233,302円	134,890,694,102円
期中追加設定元本額	18,705,077,077円	33,001,020,844円
期中一部解約元本額	12,441,616,277円	20,187,097,979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	4,208,196,163円	3,765,431,907円
ンド		
ダイワ・トピックス・インデッ	8,873,990,627円	7,517,011,572円
クスファンドVA		

適格機関投資家専用・ダイワ・トピックインデックスファンドVA2	50,893,960円	5,764,295円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	65,059,832円	59,609,321円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,060,778,978円	777,014,581円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	59,055,392円	46,976,403円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,449,339,094円	1,145,153,691円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,513,952円	46,927,453円
D-I's TOPIXインデックス	39,579,272円	50,758,188円
為替ヘッジ付米回国債プラス日本株式ファンド	19,750,054円	16,362,055円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	687,039円	7,650,621円
iFree TOPIXインデックス	766,287,386円	1,290,732,581円
iFree 8資産バランス	1,279,701,333円	1,996,082,570円
iFree 年金バランス	18,821,903円	64,246,554円
DCダイワ日本株式インデックス	65,506,653,858円	65,235,675,867円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,604,113,138円	2,856,480,263円
ダイワ・ライフ・バランス50	2,907,019,868円	3,215,288,075円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,813,203,474円	2,971,577,942円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,626,136,087円	4,856,558,312円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	15,110,700円	13,563,401円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	52,614,491円	55,375,861円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	16,862,669円	24,888,377円
ダイワつみたてインデックス日本株式	9,822,989円	266,294,654円
ダイワつみたてインデックスバランス30	- 円	431,467円

ダイワつみたてインデックスバ ランス50	- 円	315,899円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	- 円	2,320,710円
ダイワ世界分散バランスファン ド15VA	350,718円	- 円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA	359,201円	- 円
ダイワ世界分散バランスファン ド20VA(国内株式型)	712,052円	- 円
ダイワ世界分散バランスファン ド25VA	4,149,572円	- 円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA	4,912,940円	- 円
ダイワ世界分散バランスファン ド30VA(国内株式型)	9,756,807円	- 円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	184,587,297円	150,205,619円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	162,072,230円	158,266,050円
ダイワ・バランスファンド35 VA	9,658,927,568円	8,647,121,514円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	11,433,435円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	14,487,998円	- 円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	823,275,779円	730,190,060円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	129,734,372円	124,454,938円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	221,128,598円	216,391,069円
ダイワ・ノーロード TOPI Xファンド	140,301,263円	152,878,769円
ダイワファンドラップ TOP IXインデックス	8,504,620,250円	10,075,963,979円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	292,440,998円	13,126,419,796円
ダイワファンドラップオンライ ン TOPIXインデックス	1,905,520,921円	2,555,624,273円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,400,114,800円	1,351,353,152円

	ダイワライフスタイル25	181,369,214円	182,799,162円
	ダイワライフスタイル50	649,148,174円	662,351,711円
	ダイワライフスタイル75	544,757,466円	530,142,751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）	13,598,340,190円	12,751,961,504円
	計	134,890,694,102円	147,704,616,967円
2.	期末日における受益権の総数	134,890,694,102口	147,704,616,967口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 14,441,000,290円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 12,524,034,910円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 680,300,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 565,900,000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28,279,195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29,453,875円が含まれております。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,360,479,994	8,993,918,872
合計	9,360,479,994	8,993,918,872

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年9月20日から2018年11月30日まで、及び2019年9月20日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200
合計	1,849,310,000	-	1,868,160,000	18,850,000	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200

## (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)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0573円	1.1150円
(1万口当たり純資産額)	(10,573円)	(11,150円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額(円)		備 考
		単 価	金 額	
極 洋	3,300	2,905.00	9,586,500	貸付株式数 100株
日本水産	91,300	666.00	60,805,800	
マル八ニチロ	13,200	2,938.00	38,781,600	
ハウスイ	600	870.00	522,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,800	1,522.00	4,261,600	
サカタのタネ	10,900	3,535.00	38,531,500	
ホクト	7,000	2,001.00	14,007,000	貸付株式数 2,400株
ホクリヨウ	1,400	680.00	952,000	

ヒノキヤグループ	2,300	2,233.00	5,135,900	貸付株式数	800株 (200株)
ショーボンドHD	13,000	4,260.00	55,380,000	貸付株式数	100株
ミライト・ホールディングス	27,200	1,638.00	44,553,600	貸付株式数	10,600株
タマホーム	4,400	1,842.00	8,104,800	貸付株式数	1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	900	679.00	611,100		
日本アクア	3,600	657.00	2,365,200	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
ファーストコーポレーション	2,800	673.00	1,884,400	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,600	1,258.00	2,012,800		
スペースバリューHD	11,100	515.00	5,716,500		
住石ホールディングス	18,400	150.00	2,760,000	貸付株式数	7,100株
日鉄鉱業	2,100	4,570.00	9,597,000		
三井松島HLDGS	3,500	1,203.00	4,210,500		
国際石油開発帝石	366,200	1,061.50	388,721,300		
石油資源開発	11,900	2,839.00	33,784,100		
K&Oエナジーグループ	4,400	1,577.00	6,938,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,000.00	1,700,000		
第一カッター興業	1,100	1,827.00	2,009,700		
安藤・間	54,400	905.00	49,232,000		
東急建設	26,800	784.00	21,011,200		
コムシスホールディングス	32,400	3,190.00	103,356,000		
ミサワホーム	6,300	1,198.00	7,547,400		
ピーアールホールディングス	10,000	484.00	4,840,000		
高松コンストラクショングP	5,700	2,733.00	15,578,100		
東建コーポレーション	2,800	7,300.00	20,440,000		
ソネック	900	807.00	726,300	貸付株式数	100株
ヤマウラ	3,900	879.00	3,428,100		
大成建設	70,300	4,345.00	305,453,500		
大林組	210,700	1,180.00	248,626,000		
清水建設	213,900	1,065.00	227,803,500		
飛鳥建設	6,100	1,470.00	8,967,000		
長谷工コーポレーション	81,600	1,428.00	116,524,800		
松井建設	8,300	782.00	6,490,600		
銭高組	900	4,005.00	3,604,500	貸付株式数	100株
鹿島建設	165,500	1,460.00	241,630,000		
不動テトラ	5,500	1,543.00	8,486,500		
大末建設	2,500	964.00	2,410,000		
鉄建建設	4,600	2,846.00	13,091,600	貸付株式数	1,600株

西松建設	16,300	2,434.00	39,674,200	
三井住友建設	51,200	610.00	31,232,000	貸付株式数 2,100株
大豊建設	4,800	2,999.00	14,395,200	
前田建設	52,900	994.00	52,582,600	貸付株式数 20,600株
佐田建設	4,600	411.00	1,890,600	貸付株式数 1,600株
ナカノフード建設	5,800	476.00	2,760,800	貸付株式数 1,200株
奥村組	11,400	3,095.00	35,283,000	貸付株式数 100株
東鉄工業	9,000	3,275.00	29,475,000	
イチケン	1,500	1,788.00	2,682,000	
富士ピー・エス	3,100	580.00	1,798,000	
浅沼組	2,400	4,375.00	10,500,000	
戸田建設	87,600	682.00	59,743,200	貸付株式数 33,200株
熊谷組	9,800	3,275.00	32,095,000	貸付株式数 2,500株
北野建設	1,300	2,606.00	3,387,800	貸付株式数 100株
植木組	900	2,545.00	2,290,500	
矢作建設	9,300	764.00	7,105,200	
ピーエス三菱	6,900	699.00	4,823,100	貸付株式数 3,000株
日本ハウスHLDGS	14,400	482.00	6,940,800	
大東建託	25,300	13,355.00	337,881,500	貸付株式数 10,300株
新日本建設	9,000	928.00	8,352,000	貸付株式数 200株
NIPPO	17,500	2,256.00	39,480,000	
東亜道路	1,300	3,455.00	4,491,500	貸付株式数 300株
前田道路	22,300	2,602.00	58,024,600	
日本道路	2,000	7,010.00	14,020,000	
東亜建設	6,600	1,577.00	10,408,200	貸付株式数 2,500株
日本国土開発	12,300	626.00	7,699,800	貸付株式数 4,800株
若築建設	3,800	1,701.00	6,463,800	
東洋建設	23,700	504.00	11,944,800	
五洋建設	83,600	637.00	53,253,200	貸付株式数 32,600株
世紀東急	10,100	884.00	8,928,400	
福田組	2,400	4,825.00	11,580,000	貸付株式数 600株
日本ドライケミカル	1,600	1,462.00	2,339,200	貸付株式数 200株
住友林業	53,500	1,594.00	85,279,000	
日本基礎技術	7,000	403.00	2,821,000	
巴コーポレーション	9,300	399.00	3,710,700	貸付株式数 100株
大和ハウス	208,600	3,395.00	708,197,000	
ライト工業	12,100	1,587.00	19,202,700	
積水ハウス	230,500	2,394.50	551,932,250	
日特建設	5,500	788.00	4,334,000	貸付株式数 2,400株
北陸電気工事	3,700	1,048.00	3,877,600	貸付株式数 500株

ユアテック	12,100	677.00	8,191,700	貸付株式数	500株
四電工	1,100	2,785.00	3,063,500		
中電工	8,500	2,582.00	21,947,000		
関電工	30,000	1,054.00	31,620,000		
きんでん	50,100	1,659.00	83,115,900		
東京エネシス	7,000	938.00	6,566,000		
トーエネック	2,100	3,640.00	7,644,000		
住友電設	6,000	2,469.00	14,814,000		
日本電設工業	11,600	2,268.00	26,308,800		
協和エクシオ	32,000	2,877.00	92,064,000	貸付株式数	10,900株
新日本空調	5,600	2,242.00	12,555,200		
日本工営	4,300	3,380.00	14,534,000	貸付株式数	100株
九電工	14,800	3,545.00	52,466,000		
三機工業	15,200	1,480.00	22,496,000		
日揮ホールディングス	64,900	1,622.00	105,267,800	貸付株式数	3,300株
中外炉工業	2,300	1,708.00	3,928,400		
ヤマト	6,700	722.00	4,837,400		
太平電業	5,100	2,333.00	11,898,300		
高砂熱学	18,300	1,901.00	34,788,300		
三晃金属	900	2,630.00	2,367,000		
NEC ネットズエスアイ	6,200	3,445.00	21,359,000		
朝日工業社	1,400	3,470.00	4,858,000	貸付株式数	100株
明星工業	13,600	930.00	12,648,000	貸付株式数	400株
大気社	10,300	3,705.00	38,161,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	5,000	2,632.00	13,160,000		
日比谷総合設備	6,800	1,949.00	13,253,200	貸付株式数	1,000株
東芝プラントシステム	16,100	2,664.00	42,890,400		
日本製粉	19,800	1,716.00	33,976,800		
日清製粉G本社	76,200	2,058.00	156,819,600		
日東富士製粉	500	6,360.00	3,180,000	貸付株式数	100株
昭和産業	6,200	3,230.00	20,026,000	貸付株式数	2,100株
鳥越製粉	6,000	945.00	5,670,000	貸付株式数	100株
中部飼料	8,200	1,390.00	11,398,000		
フィード・ワン	45,400	170.00	7,718,000		
東洋精糖	1,100	1,136.00	1,249,600		
日本甜菜糖	3,500	2,040.00	7,140,000		
三井製糖	5,900	2,320.00	13,688,000		
塩水港精糖	7,300	220.00	1,606,000	貸付株式数	2,800株
日新製糖	3,200	2,019.00	6,460,800	貸付株式数	400株

L I F U L L	22,400	555.00	12,432,000	貸付株式数	7,900株
ジェイエシーリクルートメント	4,300	2,092.00	8,995,600	貸付株式数	1,300株
日本M&Aセンター	48,500	3,750.00	181,875,000	貸付株式数	1,300株
メンバーズ	1,900	2,358.00	4,480,200	貸付株式数	500株
中広	600	546.00	327,600		
アイティメディア	1,900	791.00	1,502,900	貸付株式数	300株
タケエイ	6,200	1,283.00	7,954,600		
E・Jホールディングス	800	1,432.00	1,145,600		
トラスト・テック	7,100	1,353.00	9,606,300		
コシダカホールディングス	15,500	1,609.00	24,939,500	貸付株式数	200株
アルトナー	1,600	754.00	1,206,400		
パソナグループ	7,800	1,707.00	13,314,600	貸付株式数	1,200株
C D S	1,600	1,510.00	2,416,000	貸付株式数	600株
リンクアンドモチベーション	14,200	726.00	10,309,200	貸付株式数	5,000株
G C A	7,700	953.00	7,338,100		
エス・エム・エス	20,000	3,005.00	60,100,000		
サニーサイドアップ	1,400	1,138.00	1,593,200		
パーソルホールディングス	64,200	2,034.00	130,582,800		
リニカル	3,100	1,180.00	3,658,000	貸付株式数	1,200株 (600株)
クックパッド	22,400	372.00	8,332,800		
エスクリ	2,000	802.00	1,604,000		
アイ・ケイ・ケイ	3,100	723.00	2,241,300	貸付株式数	1,100株
森永製菓	15,800	5,610.00	88,638,000		
中村屋	1,800	4,470.00	8,046,000		
江崎グリコ	20,000	5,090.00	101,800,000	貸付株式数	4,600株
名糖産業	3,200	1,315.00	4,208,000		
井村屋グループ	2,900	2,058.00	5,968,200	貸付株式数	500株
不二家	3,800	2,214.00	8,413,200		
山崎製パン	50,600	2,036.00	103,021,600	貸付株式数	11,500株
第一屋製パン	1,200	995.00	1,194,000	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	4,970.00	5,467,000		
亀田製菓	3,800	5,030.00	19,114,000		
寿スピリッツ	6,500	7,660.00	49,790,000		
カルビー	30,700	3,560.00	109,292,000		
森永乳業	12,500	4,635.00	57,937,500		
六甲バター	4,500	1,808.00	8,136,000		
ヤクルト	46,400	6,530.00	302,992,000		
明治ホールディングス	44,600	7,530.00	335,838,000		

雪印メグミルク	16,300	2,666.00	43,455,800	
プリマハム	10,600	2,554.00	27,072,400	貸付株式数 2,700株
日本ハム	25,800	4,650.00	119,970,000	
林兼産業	2,300	729.00	1,676,700	
丸大食品	7,200	2,341.00	16,855,200	貸付株式数 2,500株
S Foods	5,400	3,005.00	16,227,000	
伊藤ハム米久HLDGS	43,400	718.00	31,161,200	貸付株式数 2,100株
学情	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数 900株 (900株)
スタジオアリス	3,200	1,949.00	6,236,800	貸付株式数 900株
クロスキャット	1,700	1,000.00	1,700,000	
シミックホールディングス	3,600	1,818.00	6,544,800	
システナ	23,500	1,756.00	41,266,000	
NJS	1,400	1,728.00	2,419,200	
デジタルアーツ	3,200	6,320.00	20,224,000	貸付株式数 1,200株
日鉄ソリューションズ	9,900	3,810.00	37,719,000	
総合警備保障	25,600	5,810.00	148,736,000	
キューブシステム	3,500	798.00	2,793,000	
いちご	84,300	439.00	37,007,700	
エイジア	1,200	1,319.00	1,582,800	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	72,400	166.00	12,018,400	貸付株式数 5,700株
コア	2,800	1,445.00	4,046,000	貸付株式数 100株
カカクコム	48,100	2,654.00	127,657,400	
アイロムグループ	2,300	1,456.00	3,348,800	貸付株式数 800株
セントケア・ホールディング	4,400	516.00	2,270,400	
サイネックス	1,100	683.00	751,300	貸付株式数 200株
ルネサンス	3,600	1,746.00	6,285,600	
ディップ	9,000	3,115.00	28,035,000	貸付株式数 3,800株
SBSホールディングス	5,800	1,967.00	11,408,600	貸付株式数 2,200株
オプトホールディング	3,500	1,783.00	6,240,500	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
新日本科学	6,900	786.00	5,423,400	
ツクイ	15,100	568.00	8,576,800	
キャリアデザインセンター	1,600	1,331.00	2,129,600	
ベネフィット・ワン	17,600	2,425.00	42,680,000	貸付株式数 6,800株
エムスリー	141,600	3,055.00	432,588,000	貸付株式数 55,300株
ツカダ・グローバルHOLD	4,200	637.00	2,675,400	貸付株式数 1,500株
プラス	700	695.00	486,500	貸付株式数 100株
アウトソーシング	36,700	1,202.00	44,113,400	貸付株式数 13,300株
ウェルネット	6,000	821.00	4,926,000	貸付株式数 700株

ワールドホールディングス	2,100	1,969.00	4,134,900	貸付株式数	600株
ディー・エヌ・エー	31,500	1,780.00	56,070,000		
博報堂DYHLDGS	89,300	1,788.00	159,668,400		
ぐるなび	11,100	1,045.00	11,599,500	貸付株式数	1,500株
タカミヤ	6,900	723.00	4,988,700	貸付株式数	2,600株
ジャパンベストレスキューS	4,400	1,081.00	4,756,400	貸付株式数	1,500株
ファンコミュニケーションズ	17,700	505.00	8,938,500	貸付株式数	500株
ライク	2,500	1,697.00	4,242,500	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,700	346.00	934,200		
エスプール	12,400	711.00	8,816,400		
WDBホールディングス	2,900	2,534.00	7,348,600		
ティア	3,700	596.00	2,205,200		
CDG	700	1,417.00	991,900	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	3,600	2,001.00	7,203,600	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
インフォマート	35,200	1,940.00	68,288,000	貸付株式数	13,400株
サッポロホールディングス	23,100	2,679.00	61,884,900		
アサヒグループホールディング	141,300	5,266.00	744,085,800	貸付株式数	52,100株
麒麟HD	286,100	2,441.50	698,513,150		
宝ホールディングス	50,500	1,074.00	54,237,000		
オエノンホールディングス	17,800	405.00	7,209,000	貸付株式数	6,800株
養命酒	2,100	2,000.00	4,200,000		
コカ・コーラボトラーズJHD	47,300	2,646.00	125,155,800	貸付株式数	18,800株
サントリー食品インター	45,100	4,755.00	214,450,500		
ダイドーグループHD	3,500	4,635.00	16,222,500	貸付株式数	1,300株
伊藤園	20,500	5,540.00	113,570,000	貸付株式数	8,000株
キーコーヒー	6,600	2,399.00	15,833,400		
ユニカフェ	1,700	1,034.00	1,757,800	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	1,000	1,238.00	1,238,000		
日清オイリオグループ	8,700	3,920.00	34,104,000		
不二製油グループ	16,500	3,075.00	50,737,500	貸付株式数	6,000株
かどや製油	700	3,815.00	2,670,500	貸付株式数	100株
J-オイルミルズ	3,500	4,365.00	15,277,500		
ローソン	16,700	6,080.00	101,536,000		
サンエー	5,500	5,050.00	27,775,000	貸付株式数	100株
カワチ薬品	5,100	2,305.00	11,755,500	貸付株式数	700株
エービーシー・マート	10,300	7,460.00	76,838,000		
ハードオフコーポレーション	2,600	810.00	2,106,000		

高千穂交易	2,500	1,093.00	2,732,500	貸付株式数	800株
アスクル	6,900	3,005.00	20,734,500	貸付株式数	1,800株 (100株)
ゲオホールディングス	11,900	1,318.00	15,684,200	貸付株式数	4,600株
アダストリア	9,200	2,536.00	23,331,200		
ジーフット	4,100	622.00	2,550,200	貸付株式数	1,500株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,100	671.00	738,100		
伊藤忠食品	1,700	5,220.00	8,874,000		
くら寿司	3,400	4,885.00	16,609,000		
キャンドウ	3,100	1,635.00	5,068,500	貸付株式数	800株 (600株)
エレマテック	6,100	1,057.00	6,447,700		
パルグループHLDGS	3,400	3,575.00	12,155,000		
JALUX	1,900	2,521.00	4,789,900	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	1,187.00	36,084,800	貸付株式数	6,000株
あらた	5,300	4,315.00	22,869,500		
サーラコーポレーション	13,500	623.00	8,410,500	貸付株式数	3,200株
ワッツ	2,900	616.00	1,786,400	貸付株式数	500株 (400株)
トーメンデバイス	1,000	2,825.00	2,825,000	貸付株式数	200株
ハローズ	2,500	2,580.00	6,450,000		
J Pホールディングス	20,100	294.00	5,909,400	貸付株式数	7,800株
フジオフードシステム	2,800	3,570.00	9,996,000	貸付株式数	1,000株
あみやき亭	1,400	3,645.00	5,103,000		
東京エレクトロンデバイス	2,400	2,255.00	5,412,000		
ひらまつ	12,100	305.00	3,690,500	貸付株式数	4,700株
フィールズ	5,100	499.00	2,544,900		
双日	366,300	351.00	128,571,300		
アルフレッサホールディングス	73,500	2,303.00	169,270,500		
大黒天物産	1,600	3,210.00	5,136,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	1,390.00	8,062,000	貸付株式数	100株
ファーマライズHD	1,500	634.00	951,000		
キッコーマン	48,500	5,600.00	271,600,000		
味の素	149,000	1,836.00	273,564,000		
キューピー	37,500	2,456.00	92,100,000	貸付株式数	14,600株
ハウス食品G本社	25,200	3,840.00	96,768,000	貸付株式数	5,100株
カゴメ	25,600	2,688.00	68,812,800		
焼津水産化工	3,200	1,052.00	3,366,400		

アリアケジャパン	6,200	7,880.00	48,856,000	貸付株式数	1,700株
ピエトロ	900	1,640.00	1,476,000		
エバラ食品工業	1,600	2,186.00	3,497,600		
やまみ	300	2,158.00	647,400		
ニチレイ	32,100	2,581.00	82,850,100		
横浜冷凍	18,600	1,080.00	20,088,000	貸付株式数	600株
東洋水産	34,700	4,745.00	164,651,500		
イトアンド	2,300	1,785.00	4,105,500		
大冷	900	1,969.00	1,772,100		
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,700	1,207.00	4,465,900	貸付株式数	200株
日清食品HD	28,700	8,230.00	236,201,000		
永谷園ホールディングス	3,300	2,152.00	7,101,600		
一正蒲鉾	2,600	1,063.00	2,763,800	貸付株式数	800株 (800株)
フジッコ	7,300	2,011.00	14,680,300		
ロックフィールド	7,300	1,480.00	10,804,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	389,500	2,516.50	980,176,750	貸付株式数	8,100株
ケンコーマヨネーズ	3,800	2,602.00	9,887,600	貸付株式数	1,400株
わらべや日洋HD	4,400	1,819.00	8,003,600		
なとり	3,800	1,700.00	6,460,000		
イフジ産業	1,200	778.00	933,600	貸付株式数	100株
ピクルスコーポレーション	1,500	2,785.00	4,177,500	貸付株式数	100株
北の達人コーポ	23,500	704.00	16,544,000	貸付株式数	9,200株
ユーグレナ	28,800	836.00	24,076,800	貸付株式数	11,200株 (5,200株)
片倉工業	9,500	1,378.00	13,091,000	貸付株式数	700株
グンゼ	4,800	5,200.00	24,960,000	貸付株式数	1,500株
ヒューリック	141,600	1,254.00	177,566,400	貸付株式数	49,500株
神栄	1,000	746.00	746,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,500	890.00	3,115,000		
アルペン	5,000	1,840.00	9,200,000	貸付株式数	1,600株
ハブ	1,900	1,033.00	1,962,700	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	3,200	703.00	2,249,600		
クオールホールディングス	9,800	1,584.00	15,523,200		
アルコニックス	7,000	1,447.00	10,129,000		
神戸物産	22,800	3,390.00	77,292,000	貸付株式数	8,900株
ソリトンシステムズ	2,900	1,099.00	3,187,100		
ジーンズホールディングス	3,500	6,720.00	23,520,000	貸付株式数	100株
ビックカメラ	39,300	1,213.00	47,670,900		

D C Mホールディングス	35,800	1,069.00	38,270,200	貸付株式数	13,100株
ペッパーフードサービス	5,300	1,322.00	7,006,600	貸付株式数	2,000株 (300株)
M o n o t a R O	47,100	3,085.00	145,303,500	貸付株式数	18,200株 (2,500株)
東京一番フーズ	1,600	626.00	1,001,600		
D Dホールディングス	2,600	1,567.00	4,074,200	貸付株式数	1,000株
あい ホールディングス	9,500	1,997.00	18,971,500		
ディーブイエックス	2,300	954.00	2,194,200	貸付株式数	900株
きちりホールディングス	1,700	848.00	1,441,600	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,800	1,871.00	8,980,800		
J . フロント リテイリ ング	79,100	1,473.00	116,514,300	貸付株式数	22,700株
ドトール・日レスHD	10,500	2,233.00	23,446,500		
マツモトキヨシH L D G S	27,400	4,200.00	115,080,000	貸付株式数	10,400株
ブロンコピリー	3,400	2,741.00	9,319,400	貸付株式数	1,300株
Z O Z O	45,500	2,206.00	100,373,000	貸付株式数	27,400株
トレジャー・ファクトリー	1,900	1,120.00	2,128,000	貸付株式数	600株
物語コーポレーション	1,600	8,630.00	13,808,000	貸付株式数	600株 (100株)
ココカラファイン	6,900	6,440.00	44,436,000	貸付株式数	200株
三越伊勢丹HD	115,700	990.00	114,543,000		
東洋紡	26,000	1,622.00	42,172,000		
ユニチカ	19,300	376.00	7,256,800	貸付株式数	7,200株
富士紡ホールディングス	3,200	3,480.00	11,136,000		
日清紡ホールディングス	44,800	1,019.00	45,651,200		
倉敷紡績	6,700	2,582.00	17,299,400	貸付株式数	400株
ダイワボウHD	5,600	5,580.00	31,248,000	貸付株式数	600株
シキボウ	3,400	941.00	3,199,400		
日東紡績	10,000	4,100.00	41,000,000		
トヨタ紡織	19,600	1,726.00	33,829,600	貸付株式数	8,600株
マクニカ・富士エレH L D G S	15,800	1,874.00	29,609,200		
H a m e e	2,000	1,398.00	2,796,000		
ラクト・ジャパン	2,500	3,480.00	8,700,000	貸付株式数	1,000株 (500株)
ウエルシアHD	19,700	6,790.00	133,763,000	貸付株式数	7,600株
クリエイトS D H	9,700	2,676.00	25,957,200		
バイタルK S K H D	12,400	1,108.00	13,739,200	貸付株式数	4,800株
八洲電機	5,100	882.00	4,498,200		

メディアスホールディングス	3,800	830.00	3,154,000	貸付株式数	100株
レスターホールディングス	6,900	2,036.00	14,048,400	貸付株式数	2,600株
ジューテックHD	1,500	1,087.00	1,630,500	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	7,600	376.00	2,857,600	貸付株式数	2,000株
大光	2,800	693.00	1,940,400	貸付株式数	1,000株
OCHIホールディングス	1,900	1,401.00	2,661,900		
TOKAIホールディングス	35,000	1,108.00	38,780,000	貸付株式数	1,400株
黒谷	1,500	450.00	675,000		
ミサワ	1,300	842.00	1,094,600	貸付株式数	400株
ティーライフ	900	869.00	782,100	貸付株式数	300株
Cominix	1,100	820.00	902,000		
エー・ピーカンパニー	1,200	517.00	620,400		
三洋貿易	3,300	2,352.00	7,761,600		
チムニー	2,000	2,308.00	4,616,000	貸付株式数	700株
シュッピン	4,500	1,167.00	5,251,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ビューティガレージ	1,100	2,095.00	2,304,500	貸付株式数	400株
ウイン・パートナーズ	4,800	1,486.00	7,132,800		
ネクステージ	9,500	1,195.00	11,352,500	貸付株式数	3,400株
ジョイフル本田	19,300	1,463.00	28,235,900	貸付株式数	5,400株
鳥貴族	2,200	1,897.00	4,173,400	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,600	2,059.00	5,353,400		
ホットランド	4,400	1,353.00	5,953,200	貸付株式数	1,700株
すかいらーくHD	74,200	2,217.00	164,501,400	貸付株式数	29,000株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,800	2,200.00	6,160,000		
綿半ホールディングス	2,500	2,015.00	5,037,500	貸付株式数	100株
日本毛織	21,600	1,075.00	23,220,000	貸付株式数	2,700株
ダイトウボウ	11,500	85.00	977,500	貸付株式数	2,900株
トーア紡コーポレーション	2,600	581.00	1,510,600	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	8,500	280.00	2,380,000		
ヨシックス	1,100	2,864.00	3,150,400	貸付株式数	400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,300	981.00	18,933,300		
三栄建築設計	2,700	1,625.00	4,387,500	貸付株式数	300株
野村不動産HLDGS	40,200	2,653.00	106,650,600		
三重交通グループHD	13,500	604.00	8,154,000	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,400	2,028.00	19,063,200		
エー・ディー・ワークス	121,800	31.00	3,775,800		
日本商業開発	4,200	1,606.00	6,745,200	貸付株式数	1,600株

プレサンスコーポレーション	10,700	1,756.00	18,789,200		
ユニゾホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000	貸付株式数	3,600株
日本管理センター	4,400	1,319.00	5,803,600		
サンセイランディック	2,000	882.00	1,764,000	貸付株式数	500株 (500株)
エストラスト	900	805.00	724,500	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,300	707.00	9,403,100	貸付株式数	4,900株
オープンハウス	19,200	2,920.00	56,064,000	貸付株式数	7,500株
東急不動産HD	180,400	744.00	134,217,600		
飯田GHD	55,300	1,953.00	108,000,900		
イーグランド	1,100	808.00	888,800		
帝国繊維	7,400	2,042.00	15,110,800		
日本コークス工業	58,200	81.00	4,714,200		
ゴルフダイジェスト・オン	3,000	684.00	2,052,000	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	751.00	1,502,000	貸付株式数	200株
B E E N O S	2,300	1,539.00	3,539,700	貸付株式数	900株
あさひ	4,900	1,263.00	6,188,700	貸付株式数	1,900株
日本調剤	2,000	3,780.00	7,560,000		
コスモス薬品	2,900	22,250.00	64,525,000	貸付株式数	1,100株
シップヘルスケアHD	10,600	4,580.00	48,548,000		
トーエル	3,200	793.00	2,537,600	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトHD	2,900	1,784.00	5,173,600	貸付株式数	200株
オンリー	1,100	801.00	881,100		
セブン&アイ・HLDGS	259,000	4,113.00	1,065,267,000	貸付株式数	106,600株
クリエイト・レストランツ・ホール	17,800	1,841.00	32,769,800	貸付株式数	2,700株
明治電機工業	2,100	1,560.00	3,276,000		
ツルハホールディングス	14,400	13,070.00	188,208,000	貸付株式数	5,600株
デリカフーズHLDGS	2,400	689.00	1,653,600	貸付株式数	200株
スターティアホールディングス	1,500	595.00	892,500	貸付株式数	400株
サンマルクホールディングス	5,200	2,332.00	12,126,400		
フェリシモ	1,400	1,038.00	1,453,200		
トリドールホールディングス	8,200	2,879.00	23,607,800	貸付株式数	3,000株 (3,000株)
帝人	53,700	2,096.00	112,555,200	貸付株式数	21,000株
東レ	476,500	738.00	351,657,000		
クラレ	103,500	1,348.00	139,518,000		
旭化成	436,200	1,224.50	534,126,900		
サカイオーベックス	1,700	1,855.00	3,153,500		

TOKYO BASE	5,900	717.00	4,230,300	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
稲葉製作所	3,700	1,431.00	5,294,700	
宮地エンジニアリングG	2,000	2,085.00	4,170,000	貸付株式数 700株
トーカロ	18,400	1,112.00	20,460,800	
アルファCO	2,300	1,311.00	3,015,300	
SUMCO	79,600	1,691.00	134,603,600	貸付株式数 30,800株
川田テクノロジーズ	1,400	6,850.00	9,590,000	
RS TECHNOLOGIES	1,900	3,715.00	7,058,500	貸付株式数 700株 (400株)
信和	2,800	1,100.00	3,080,000	貸付株式数 100株
ビーロット	1,500	2,031.00	3,046,500	貸付株式数 600株
ファーストブラザーズ	1,500	1,278.00	1,917,000	貸付株式数 100株
ハウスドゥ	3,700	1,619.00	5,990,300	貸付株式数 800株
シーアールイー	1,800	1,066.00	1,918,800	貸付株式数 100株
プロパティエージェント	1,000	1,156.00	1,156,000	貸付株式数 300株
ケイアイスター不動産	2,100	1,996.00	4,191,600	
アグレ都市デザイン	1,100	532.00	585,200	
ジェイ・エス・ビー	700	4,620.00	3,234,000	
テンポイノベーション	700	2,146.00	1,502,200	貸付株式数 100株
グローバルリンクマネジメント	1,100	679.00	746,900	
住江織物	1,900	2,852.00	5,418,800	貸付株式数 700株
日本フェルト	3,700	499.00	1,846,300	
イチカワ	900	1,479.00	1,331,100	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	11,400	133.00	1,516,200	貸付株式数 200株
日東製網	800	1,632.00	1,305,600	
芦森工業	1,400	1,392.00	1,948,800	
アツギ	5,400	829.00	4,476,600	
ウイルプラスHLDGS	1,100	933.00	1,026,300	
ジャパンミート	3,300	2,165.00	7,144,500	
コメダホールディングス	14,400	2,125.00	30,600,000	貸付株式数 400株
サツドラホールディングス	1,000	1,773.00	1,773,000	貸付株式数 300株
デファクトスタンダード	600	447.00	268,200	
アレンザホールディングス	3,300	878.00	2,897,400	貸付株式数 900株
串カツ田中HLDGS	1,000	2,366.00	2,366,000	貸付株式数 300株
パロックジャパン	4,600	946.00	4,351,600	貸付株式数 1,700株
クスリのアオキHLDGS	6,600	8,290.00	54,714,000	貸付株式数 2,500株
ダイニック	2,500	768.00	1,920,000	
共和レザー	3,600	803.00	2,890,800	貸付株式数 1,200株
力の源HD	3,000	872.00	2,616,000	

スシローグローバルHLDGS	7,300	8,560.00	62,488,000	
LIXILビバ	6,500	1,917.00	12,460,500	
セーレン	16,200	1,560.00	25,272,000	
ソトー	2,600	973.00	2,529,800	貸付株式数 1,000株
東海染工	900	1,128.00	1,015,200	
小松マテーレ	10,800	830.00	8,964,000	
ワコールホールディングス	17,200	3,085.00	53,062,000	
ホギメディカル	7,500	3,610.00	27,075,000	
レナウン	16,900	115.00	1,943,500	貸付株式数 500株
クラウドシアHLDGS	1,700	488.00	829,600	
TSIホールディングス	22,000	553.00	12,166,000	
マツオカコーポレーション	1,900	2,197.00	4,174,300	
ワールド	9,300	2,766.00	25,723,800	
TIS	22,000	6,610.00	145,420,000	
ネオス	2,600	828.00	2,152,800	貸付株式数 1,000株
電算システム	2,500	2,985.00	7,462,500	貸付株式数 900株
グリー	45,500	523.00	23,796,500	
コーエーテクモHD	13,500	2,684.00	36,234,000	
三菱総合研究所	2,800	4,190.00	11,732,000	
ボルテージ	1,300	533.00	692,900	貸付株式数 400株
電算	700	2,175.00	1,522,500	貸付株式数 100株 (100株)
AGS	3,700	795.00	2,941,500	
ファインデックス	5,500	1,194.00	6,567,000	
ブレインパッド	1,300	5,750.00	7,475,000	貸付株式数 400株
KL a b	12,700	850.00	10,795,000	貸付株式数 4,900株
ポルトゥウィン・ピットクル	8,000	1,074.00	8,592,000	
イーブックイニシアティブ	900	2,054.00	1,848,600	貸付株式数 300株
ネクソン	187,700	1,501.00	281,737,700	貸付株式数 73,400株
アイスタイル	17,000	809.00	13,753,000	貸付株式数 6,000株
エムアップ	1,900	2,585.00	4,911,500	貸付株式数 800株
エイチーム	4,500	1,138.00	5,121,000	貸付株式数 1,700株
エニグモ	4,600	1,057.00	4,862,200	貸付株式数 1,800株
テクノスジャパン	5,100	525.00	2,677,500	貸付株式数 2,000株
e n i s h	2,900	637.00	1,847,300	貸付株式数 1,100株
コロプラ	21,600	1,273.00	27,496,800	貸付株式数 8,400株 (4,500株)
オルトプラス	4,900	820.00	4,018,000	貸付株式数 1,700株

ブロードリーフ	32,700	709.00	23,184,300	貸付株式数	12,700株
クロス・マーケティングG	2,900	369.00	1,070,100	貸付株式数	500株
デジタルハーツHLDGS	3,500	1,022.00	3,577,000	貸付株式数	1,300株
システム情報	3,300	1,114.00	3,676,200	貸付株式数	1,200株
メディアドゥHLDGS	2,200	3,760.00	8,272,000	貸付株式数	800株
じげん	16,300	554.00	9,030,200		
ブイキューブ	4,000	547.00	2,188,000	貸付株式数	400株
エンカレッジ・テクノロジー	1,100	816.00	897,600	貸付株式数	400株
サイバーリンクス	1,000	1,295.00	1,295,000	貸付株式数	300株
ディー・エル・イー	4,300	183.00	786,900		
フィックスターズ	7,000	1,628.00	11,396,000	貸付株式数	2,700株
CARTAHOLDINGS	3,200	1,362.00	4,358,400	貸付株式数	800株
オプティム	1,700	3,485.00	5,924,500	貸付株式数	1,000株
セレス	2,100	1,219.00	2,559,900		
特種東海製紙	4,200	4,055.00	17,031,000	貸付株式数	500株
ティーガイア	5,900	2,619.00	15,452,100	貸付株式数	1,700株
セック	1,000	3,885.00	3,885,000	貸付株式数	400株
日本アジアグループ	6,900	384.00	2,649,600		
豆蔵ホールディングス	4,500	1,443.00	6,493,500		
テクマトリックス	4,600	2,325.00	10,695,000		
プロシップ	1,900	1,305.00	2,479,500		
ガンホー・オンライン・エンター	15,900	2,397.00	38,112,300	貸付株式数	6,200株
GMOペイメントゲートウェイ	10,900	7,910.00	86,219,000	貸付株式数	4,200株
ザッパラス	3,500	425.00	1,487,500	貸付株式数	1,300株
システムリサーチ	1,700	1,829.00	3,109,300		
インターネットイニシアティブ	9,800	2,553.00	25,019,400		
さくらインターネット	7,000	664.00	4,648,000		
ヴィンクス	1,900	1,261.00	2,395,900	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,200	2,917.00	3,500,400	貸付株式数	400株
SRAホールディングス	3,500	2,546.00	8,911,000		
MINORIソリューションズ	1,200	2,696.00	3,235,200		
システムインテグレータ	2,100	884.00	1,856,400		
朝日ネット	4,600	618.00	2,842,800	貸付株式数	300株
eBASE	3,900	1,197.00	4,668,300		
アバント	4,700	1,036.00	4,869,200		

アドソル日進	2,300	2,385.00	5,485,500	貸付株式数	900株
フリービット	3,900	933.00	3,638,700	貸付株式数	1,500株
コムチュア	7,400	2,402.00	17,774,800		
サイバーコム	1,200	2,125.00	2,550,000		
アステリア	4,100	647.00	2,652,700		
アイル	2,300	1,628.00	3,744,400		
王子ホールディングス	275,100	632.00	173,863,200		
日本製紙	29,100	1,935.00	56,308,500		
三菱製紙	7,500	508.00	3,810,000		
北越コーポレーション	43,600	569.00	24,808,400		
中越パルプ	2,800	1,646.00	4,608,800		
巴川製紙	2,000	929.00	1,858,000	貸付株式数	800株
大王製紙	28,900	1,494.00	43,176,600	貸付株式数	11,200株
阿波製紙	1,700	618.00	1,050,600	貸付株式数	400株 (100株)
マークライズ	3,300	2,090.00	6,897,000		
メディカル・データ・ビジ	5,000	984.00	4,920,000		
g u m i	8,400	721.00	6,056,400	貸付株式数	3,000株
ショーケース	1,500	673.00	1,009,500	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,500	1,396.00	2,094,000		
テラスカイ	2,400	2,851.00	6,842,400		
デジタル・インフォメーション	2,900	1,694.00	4,912,600		
P C Iホールディングス	1,300	2,223.00	2,889,900	貸付株式数	500株
パイブドHD	800	1,884.00	1,507,200	貸付株式数	400株
アイビーシー	1,200	1,257.00	1,508,400		
ネオジャパン	1,200	1,035.00	1,242,000	貸付株式数	400株
P R T I M E S	600	2,462.00	1,477,200	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	1,000	1,074.00	1,074,000		
ダブルスタンダード	800	5,500.00	4,400,000		
オーブンドア	3,300	1,784.00	5,887,200	貸付株式数	1,200株
マイネット	2,100	587.00	1,232,700		
アカツキ	2,300	6,420.00	14,766,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	1,485.00	742,500	貸付株式数	100株 (100株)
UBICOMホールディングス	1,400	1,259.00	1,762,600	貸付株式数	500株
L I N E	15,100	5,140.00	77,614,000	貸付株式数	7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	4,000	726.00	2,904,000		

ノムラシステムコーポレーション	1,400	558.00	781,200	貸付株式数	500株
レンゴー	62,200	826.00	51,377,200		
トーモク	4,100	1,780.00	7,298,000	貸付株式数	1,400株
ザ・パックス	5,000	3,910.00	19,550,000		
チェンジ	1,300	2,516.00	3,270,800	貸付株式数	500株
シンクロ・フード	2,800	531.00	1,486,800		
オークネット	4,100	1,345.00	5,514,500	貸付株式数	1,500株
セグエグループ	1,100	857.00	942,700		
エイトレッド	800	1,513.00	1,210,400	貸付株式数	200株 (200株)
AOI TYO HOLDINGS	6,700	691.00	4,629,700		
マクロミル	11,800	1,025.00	12,095,000		
ビーグリー	1,300	1,283.00	1,667,900	貸付株式数	400株
オロ	1,700	4,295.00	7,301,500	貸付株式数	600株
テモナ	800	480.00	384,000	貸付株式数	300株
ニーズウェル	800	693.00	554,400		
サインポスト	1,000	1,833.00	1,833,000	貸付株式数	300株
昭和電工	46,800	2,965.00	138,762,000	貸付株式数	16,400株
住友化学	482,900	503.00	242,898,700		
住友精化	2,900	3,490.00	10,121,000		
日産化学	36,800	4,440.00	163,392,000		
ラサ工業	2,300	1,524.00	3,505,200	貸付株式数	1,100株
クレハ	5,600	6,550.00	36,680,000		
多木化学	1,900	4,550.00	8,645,000	貸付株式数	700株
テイカ	4,800	1,954.00	9,379,200		
石原産業	11,800	1,184.00	13,971,200		
片倉コープアグリ	1,700	1,184.00	2,012,800		
日本曹達	9,700	2,956.00	28,673,200	貸付株式数	800株
東ソー	101,600	1,659.00	168,554,400		
トクヤマ	19,000	2,976.00	56,544,000		
セントラル硝子	13,400	2,697.00	36,139,800		
東亜合成	41,100	1,275.00	52,402,500	貸付株式数	200株
大阪ソーダ	6,600	3,050.00	20,130,000		
関東電化	15,500	1,053.00	16,321,500		
デンカ	24,000	3,295.00	79,080,000		
イビデン	41,100	2,579.00	105,996,900		
信越化学	115,000	11,905.00	1,369,075,000		
日本カ-バイド	2,200	1,487.00	3,271,400		

堺 化 学	4,200	2,514.00	10,558,800	
第一稀元素化学工	7,100	873.00	6,198,300	
エア・ウォーター	53,800	1,752.00	94,257,600	貸付株式数 21,000株
大陽日酸	63,200	2,450.00	154,840,000	貸付株式数 1,000株
日本化学工業	2,000	3,190.00	6,380,000	貸付株式数 800株
東邦アセチレン	1,000	1,354.00	1,354,000	
日本パ - カライジング	33,000	1,167.00	38,511,000	
高圧ガス	10,300	803.00	8,270,900	
チタン工業	800	2,678.00	2,142,400	貸付株式数 300株
四国化成	10,100	1,294.00	13,069,400	
戸田工業	1,500	2,214.00	3,321,000	貸付株式数 500株
ステラ ケミファ	3,600	3,235.00	11,646,000	貸付株式数 1,400株
保土谷化学	2,400	3,900.00	9,360,000	
日本触媒	10,200	6,870.00	70,074,000	
大日精化	5,800	3,230.00	18,734,000	
カネカ	17,000	3,565.00	60,605,000	貸付株式数 6,600株
協和キリン	67,500	2,341.00	158,017,500	
三菱瓦斯化学	62,000	1,724.00	106,888,000	
三井化学	59,600	2,650.00	157,940,000	
J S R	61,200	1,930.00	118,116,000	
東京応化工業	11,300	4,075.00	46,047,500	
大阪有機化学	6,000	1,399.00	8,394,000	貸付株式数 700株
三菱ケミカルH L D G S	439,800	818.50	359,976,300	
K H ネオケム	11,600	2,514.00	29,162,400	貸付株式数 4,500株
ダイセル	89,900	1,090.00	97,991,000	
住友ベ - クライト	10,300	4,350.00	44,805,000	貸付株式数 100株
積水化学	141,400	1,920.00	271,488,000	
日本ゼオン	59,300	1,405.00	83,316,500	
アイカ工業	19,700	3,520.00	69,344,000	
宇部興産	33,200	2,404.00	79,812,800	
積水樹脂	11,800	2,286.00	26,974,800	貸付株式数 100株
タキロンシーアイ	14,300	676.00	9,666,800	
旭有機材	3,700	1,720.00	6,364,000	
日立化成	30,400	4,015.00	122,056,000	
ニチバン	3,500	1,946.00	6,811,000	
リケンテクノス	16,400	510.00	8,364,000	
大倉工業	3,100	1,945.00	6,029,500	
積水化成成品	8,800	800.00	7,040,000	
群栄化学	1,500	2,499.00	3,748,500	
タイガース ポリマー	3,400	596.00	2,026,400	

ミライアル	2,300	1,377.00	3,167,100		
ダイキアクシス	2,300	999.00	2,297,700	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	13,800	864.00	11,923,200	貸付株式数	1,600株
竹本容器	2,300	1,040.00	2,392,000	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,500	2,379.00	8,326,500	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
日本化薬	40,600	1,388.00	56,352,800		
カーリットホールディングス	7,000	630.00	4,410,000	貸付株式数	600株
E P Sホールディングス	9,700	1,437.00	13,938,900		
ソルクシーズ	2,800	951.00	2,662,800	貸付株式数	1,000株
レグス	1,600	1,468.00	2,348,800	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	24,000	924.00	22,176,000		
フェイス	2,300	864.00	1,987,200		
プロトコーポレーション	5,900	1,041.00	6,141,900		
ハイマックス	800	1,902.00	1,521,600		
アミューズ	3,500	3,120.00	10,920,000		
野村総合研究所	110,200	2,309.00	254,451,800	貸付株式数	43,100株
ドリームインキュベータ	1,900	1,670.00	3,173,000		
サイバネットシステム	4,700	784.00	3,684,800		
クイック	4,000	1,683.00	6,732,000		
T A C	4,100	228.00	934,800	貸付株式数	1,200株
C Eホールディングス	3,800	468.00	1,778,400		
ケネディクス	61,000	586.00	35,746,000		
日本システム技術	1,100	1,263.00	1,389,300	貸付株式数	400株
電通	66,200	4,045.00	267,779,000	貸付株式数	20,700株
インテージホールディングス	8,200	964.00	7,904,800		
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,330.00	3,325,000		
東邦システムサイエンス	1,700	950.00	1,615,000	貸付株式数	200株
ぴあ	1,800	4,820.00	8,676,000	貸付株式数	400株 (400株)
イオンファンタジー	2,500	3,160.00	7,900,000	貸付株式数	200株
ソースネクスト	31,300	491.00	15,368,300	貸付株式数	9,100株
シーティーエス	7,300	753.00	5,496,900	貸付株式数	600株
ネクシーズグループ	2,200	1,882.00	4,140,400		
インフォコム	7,200	2,468.00	17,769,600		
メディカルシステムネット ワーク	6,400	576.00	3,686,400		
日本精化	5,200	1,248.00	6,489,600	貸付株式数	1,900株
扶桑化学工業	6,600	3,075.00	20,295,000	貸付株式数	2,600株
トリケミカル	1,500	7,800.00	11,700,000	貸付株式数	500株

ラクスル	3,500	3,665.00	12,827,500	貸付株式数	1,300株
F I G	7,100	313.00	2,222,300	貸付株式数	2,700株
A D E K A	30,200	1,670.00	50,434,000		
日油	24,700	3,730.00	92,131,000		
ミヨシ油脂	2,500	1,291.00	3,227,500		
新日本理化	10,800	214.00	2,311,200	貸付株式数	1,100株
ハリマ化成グループ	5,400	1,244.00	6,717,600	貸付株式数	600株
アルテリア・ネットワークス	7,300	1,627.00	11,877,100		
ヒト・コミュニケーションズ H D	1,500	1,600.00	2,400,000		
花 王	160,900	8,708.00	1,401,117,200	貸付株式数	59,400株
第一工業製薬	2,400	3,725.00	8,940,000		
石原ケミカル	1,800	1,885.00	3,393,000		
日華化学	2,200	889.00	1,955,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,000	1,705.00	1,705,000	貸付株式数	200株
三洋化成	3,900	5,490.00	21,411,000		
武田薬品	559,300	4,491.00	2,511,816,300		
アステラス製薬	591,200	1,898.00	1,122,097,600		
大日本住友製薬	49,800	2,123.00	105,725,400		
塩野義製薬	85,900	6,517.00	559,810,300		
田辺三菱製薬	80,900	2,003.00	162,042,700		
わかもと製薬	8,200	274.00	2,246,800	貸付株式数	900株
あすか製薬	7,600	1,322.00	10,047,200		
日本新薬	17,600	9,960.00	175,296,000	貸付株式数	6,800株
ビオフェルミン製薬	1,200	2,331.00	2,797,200		
中外製薬	70,000	9,813.00	686,910,000		
科研製薬	11,500	5,970.00	68,655,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
エーザイ	80,500	8,072.00	649,796,000		
理研ビタミン	3,200	4,065.00	13,008,000		
ロート製薬	34,500	3,505.00	120,922,500		
小野薬品	157,400	2,457.50	386,810,500		
久光製薬	19,800	5,410.00	107,118,000		
有機合成薬品	5,000	307.00	1,535,000	貸付株式数	1,900株
持田製薬	9,300	4,475.00	41,617,500	貸付株式数	3,600株
参天製薬	125,100	2,064.00	258,206,400		
扶桑薬品	2,400	2,103.00	5,047,200		
日本ケミファ	900	2,972.00	2,674,800		
ツムラ	20,800	3,195.00	66,456,000		
日医工	19,000	1,350.00	25,650,000		

テ ル モ	190,200	3,910.00	743,682,000	貸付株式数	68,400株
みらかホールディングス	17,900	2,751.00	49,242,900		
キッセイ薬品工業	11,800	3,050.00	35,990,000		
生化学工業	13,000	1,271.00	16,523,000	貸付株式数	2,000株
栄研化学	11,800	1,988.00	23,458,400	貸付株式数	2,700株
日水製薬	2,900	1,308.00	3,793,200		
鳥居薬品	4,200	2,851.00	11,974,200		
J C Rファーマ	4,700	9,350.00	43,945,000		
東和薬品	8,600	2,839.00	24,415,400	貸付株式数	3,300株
富士製薬工業	4,500	1,410.00	6,345,000		
沢井製薬	13,800	6,530.00	90,114,000		
ゼリア新薬工業	12,100	2,178.00	26,353,800	貸付株式数	2,600株
第一三共	192,400	7,012.00	1,349,108,800		
キョーリン製薬H D	14,700	1,879.00	27,621,300		
大幸薬品	2,700	3,370.00	9,099,000		
ダイト	3,900	3,175.00	12,382,500		
大塚ホールディングス	128,000	4,839.00	619,392,000		
大正製薬H D	14,200	8,180.00	116,156,000		
ペプチドリーム	34,000	5,110.00	173,740,000	貸付株式数	13,200株
大日本塗料	7,400	1,166.00	8,628,400		
日本ペイントH O L D	54,300	5,880.00	319,284,000	貸付株式数	20,000株
関西ペイント	73,900	2,797.00	206,698,300	貸付株式数	9,800株
神東塗料	5,000	205.00	1,025,000	貸付株式数	1,100株
中国塗料	18,600	1,034.00	19,232,400		
日本特殊塗料	4,900	1,376.00	6,742,400		
藤倉化成	8,800	572.00	5,033,600		
太陽ホールディングス	4,800	4,175.00	20,040,000		
D I C	27,700	2,998.00	83,044,600		
サカタインクス	14,300	1,197.00	17,117,100		
東洋インキS Cホールディン	13,800	2,681.00	36,997,800	貸付株式数	100株
T & K T O K A	5,000	1,002.00	5,010,000		
アルプス技研	5,700	1,825.00	10,402,500		
サニックス	11,300	379.00	4,282,700	貸付株式数	4,400株 (4,200株)
ダイオーズ	1,200	1,352.00	1,622,400	貸付株式数	300株
日本空調サービス	6,700	783.00	5,246,100		
オリエンタルランド	68,300	15,180.00	1,036,794,000		
フォーカスシステムズ	4,000	902.00	3,608,000	貸付株式数	100株
ダスキン	16,500	3,050.00	50,325,000		
パーク24	35,600	2,575.00	91,670,000	貸付株式数	13,900株

明光ネットワークジャパン	7,500	1,031.00	7,732,500	貸付株式数	2,800株
ファルコホールディングス	3,500	1,763.00	6,170,500	貸付株式数	100株
クレスコ	2,000	3,580.00	7,160,000		
フジ・メディア・HD	63,600	1,497.00	95,209,200		
秀英予備校	1,400	468.00	655,200	貸付株式数	600株
田谷	1,200	609.00	730,800		
ラウンドワン	17,900	1,107.00	19,815,300		
リゾートトラスト	29,400	1,846.00	54,272,400		
オービック	22,900	14,610.00	334,569,000		
ジャストシステム	10,700	5,660.00	60,562,000		
TDCソフト	5,800	899.00	5,214,200		
Zホールディングス	905,700	383.00	346,883,100	貸付株式数	1,500株
ビー・エム・エル	8,300	3,205.00	26,601,500		
ワタベウェディング	1,000	591.00	591,000		
トレンドマイクロ	29,300	6,000.00	175,800,000		
りらいあコミュニケーション	11,600	1,417.00	16,437,200		
IDホールディングス	2,500	1,440.00	3,600,000		
リソー教育	29,300	413.00	12,100,900		
日本オラクル	13,400	10,030.00	134,402,000		
早稲田アカデミー	2,100	966.00	2,028,600		
アルファシステムズ	2,100	2,804.00	5,888,400	貸付株式数	800株
フューチャー	8,000	1,845.00	14,760,000		
CAC HOLDINGS	4,300	1,572.00	6,759,600		
SBテクノロジー	2,400	1,991.00	4,778,400	貸付株式数	400株
トーセ	1,800	936.00	1,684,800	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	71,900	2,131.00	153,218,900	貸付株式数	1,000株
オービックビジネスC	6,700	4,890.00	32,763,000	貸付株式数	1,100株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,000	2,951.00	88,530,000		
アイティフォー	8,000	879.00	7,032,000		
東京個別指導学院	2,300	724.00	1,665,200		
東計電算	1,000	3,640.00	3,640,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	36,900	3,830.00	141,327,000	貸付株式数	14,400株
楽天	299,400	942.00	282,034,800	貸付株式数	96,000株
エクスネット	1,000	964.00	964,000		
クリーク・アンド・リバー社	3,300	1,125.00	3,712,500		
テー・オー・ダブリュー	5,600	840.00	4,704,000		
大塚商会	35,700	4,420.00	157,794,000		
サイボウズ	7,700	1,198.00	9,224,600		
ソフトブレイン	3,800	567.00	2,154,600	貸付株式数	1,500株

山田コンサルティングG P	3,100	1,826.00	5,660,600	貸付株式数 1,200株 (1,100株)
セントラルスポーツ	2,400	3,270.00	7,848,000	貸付株式数 200株
パラカ	1,700	2,033.00	3,456,100	
電通国際情報S	4,100	4,205.00	17,240,500	
デジタルガレージ	11,900	4,135.00	49,206,500	貸付株式数 3,700株
イーエムシステムズ	4,600	2,058.00	9,466,800	貸付株式数 1,800株
ウェザーニューズ	2,200	3,440.00	7,568,000	貸付株式数 800株 (700株)
C I J	4,900	1,005.00	4,924,500	貸付株式数 1,900株
ビジネスエンジニアリング	700	3,035.00	2,124,500	貸付株式数 100株
日本エンタープライズ	6,600	232.00	1,531,200	貸付株式数 2,400株
WOWOW	3,200	2,701.00	8,643,200	
スカラ	4,600	787.00	3,620,200	
インテリジェント ウェイブ	2,400	746.00	1,790,400	貸付株式数 900株
フルキャストホールディングス	6,400	2,485.00	15,904,000	
エン・ジャパン	11,400	5,120.00	58,368,000	
富士フイルムHLDGS	128,900	5,182.00	667,959,800	
コニカミノルタ	146,900	726.00	106,649,400	
資生堂	133,600	8,019.00	1,071,338,400	
ライオン	87,400	2,204.00	192,629,600	
高砂香料	4,200	2,582.00	10,844,400	
マンダム	15,100	3,035.00	45,828,500	貸付株式数 5,900株 (2,900株)
ミルボン	9,000	6,310.00	56,790,000	貸付株式数 100株
ファンケル	27,200	2,934.00	79,804,800	貸付株式数 2,200株
コーセー	12,600	17,630.00	222,138,000	貸付株式数 4,900株
コタ	3,500	1,387.00	4,854,500	貸付株式数 1,300株
シーボン	900	2,519.00	2,267,100	
ポーラ・オルビスHD	28,700	2,722.00	78,121,400	
ノエビアホールディングス	6,400	6,280.00	40,192,000	
アジュバンコスメジャパン	1,500	952.00	1,428,000	貸付株式数 400株
エステー	4,300	1,736.00	7,464,800	
アグロカネショウ	2,100	1,435.00	3,013,500	貸付株式数 800株
コニシ	10,900	1,487.00	16,208,300	
長谷川香料	8,800	1,982.00	17,441,600	
星光PMC	3,800	1,072.00	4,073,600	貸付株式数 1,400株
小林製薬	18,800	9,040.00	169,952,000	貸付株式数 700株
荒川化学工業	6,000	1,581.00	9,486,000	

メック	4,600	1,625.00	7,475,000	貸付株式数 1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,585.00	4,653,000	貸付株式数 300株
タカラバイオ	17,600	2,154.00	37,910,400	
J C U	8,100	2,952.00	23,911,200	貸付株式数 500株
新田ゼラチン	4,200	704.00	2,956,800	貸付株式数 300株
O A Tアグリオ	1,100	1,579.00	1,736,900	貸付株式数 400株
デクセリアルズ	17,200	1,095.00	18,834,000	
アース製薬	5,100	5,700.00	29,070,000	貸付株式数 1,900株
北興化学	6,800	588.00	3,998,400	
大成ラミック	2,200	2,850.00	6,270,000	
クミアイ化学	27,700	1,027.00	28,447,900	貸付株式数 1,300株
日本農薬	11,900	588.00	6,997,200	貸付株式数 4,600株
富士興産	2,000	743.00	1,486,000	貸付株式数 400株 (300株)
ニチレキ	7,900	1,300.00	10,270,000	
ユシロ化学	3,700	1,375.00	5,087,500	
ビービー・カストロール	2,400	1,549.00	3,717,600	
富士石油	17,900	238.00	4,260,200	貸付株式数 7,000株
M O R E S C O	2,400	1,371.00	3,290,400	
出光興産	75,600	2,966.00	224,229,600	
J X T Gホールディングス	1,042,600	487.60	508,371,760	
コスモエネルギーH L D G S	19,500	2,394.00	46,683,000	貸付株式数 2,700株
横浜ゴム	39,000	2,303.00	89,817,000	
T O Y O T I R E	38,600	1,580.00	60,988,000	貸付株式数 12,400株
ブリヂストン	206,600	4,421.00	913,378,600	
住友ゴム	60,400	1,412.00	85,284,800	
藤倉コンポジット	5,800	473.00	2,743,400	
オカモト	4,100	4,180.00	17,138,000	
アキレス	4,600	1,826.00	8,399,600	
フ コ ク	3,000	714.00	2,142,000	
ニッタ	7,600	3,195.00	24,282,000	
クリエートメディック	2,200	1,066.00	2,345,200	
住友理工	13,000	1,023.00	13,299,000	
三ツ星ベルト	8,800	2,111.00	18,576,800	
バンドー化学	11,800	926.00	10,926,800	
A G C	66,400	4,075.00	270,580,000	
日本板硝子	32,200	649.00	20,897,800	貸付株式数 9,300株
石塚硝子	1,300	2,287.00	2,973,100	
有沢製作所	10,500	998.00	10,479,000	貸付株式数 4,000株

日本山村硝子	2,800	1,283.00	3,592,400	
日本電気硝子	27,000	2,380.00	64,260,000	
オハラ	2,700	1,461.00	3,944,700	貸付株式数 200株
住友大阪セメント	12,700	4,690.00	59,563,000	
太平洋セメント	42,500	3,240.00	137,700,000	
リソルホールディングス	700	4,125.00	2,887,500	貸付株式数 200株
日本ヒュ - ム	6,800	821.00	5,582,800	貸付株式数 200株
日本コンクリ - ト	14,300	272.00	3,889,600	貸付株式数 3,900株
三谷セキサン	3,100	3,590.00	11,129,000	
アジアパイルHD	9,500	550.00	5,225,000	貸付株式数 2,900株
東海カーボン	70,400	1,089.00	76,665,600	貸付株式数 27,500株 (100株)
日本カーボン	3,500	4,285.00	14,997,500	貸付株式数 1,300株
東洋炭素	3,900	2,427.00	9,465,300	貸付株式数 1,400株
ノリタケ	3,700	4,760.00	17,612,000	
TOTO	48,000	4,785.00	229,680,000	
日本碍子	81,900	1,857.00	152,088,300	貸付株式数 100株
日本特殊陶業	52,300	2,228.00	116,524,400	貸付株式数 10,100株
ダントーホールディングス	5,400	115.00	621,000	
MARUWA	2,600	7,550.00	19,630,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	3,220.00	5,796,000	貸付株式数 600株
黒崎播磨	1,300	5,820.00	7,566,000	
ヨータイ	5,300	694.00	3,678,200	
イソライト	3,400	694.00	2,359,600	
東京窯業	8,500	341.00	2,898,500	貸付株式数 3,300株
ニッカトー	3,000	762.00	2,286,000	
フジインコーポレーテッド	6,000	2,889.00	17,334,000	
クニミネ工業	2,800	1,195.00	3,346,000	
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,272.00	1,399,200	
ニチアス	18,400	2,611.00	48,042,400	
日本製鉄	297,500	1,628.50	484,478,750	
神戸製鋼所	121,800	569.00	69,304,200	貸付株式数 47,500株
中山製鋼所	9,200	497.00	4,572,400	
合同製鐵	3,600	2,634.00	9,482,400	
JFEホールディングス	179,600	1,412.00	253,595,200	
東京製鐵	32,300	836.00	27,002,800	
共英製鋼	7,500	2,100.00	15,750,000	
大和工業	14,100	2,755.00	38,845,500	
東京鐵鋼	2,700	1,532.00	4,136,400	貸付株式数 600株
大阪製鐵	3,500	1,449.00	5,071,500	

淀川製鋼所	9,000	2,129.00	19,161,000	
丸一鋼管	21,600	3,180.00	68,688,000	
モリ工業	2,000	2,504.00	5,008,000	
大同特殊鋼	10,900	4,965.00	54,118,500	貸付株式数 4,200株
日本高周波	2,400	432.00	1,036,800	
日本冶金工	5,500	2,330.00	12,815,000	
山陽特殊製鋼	4,800	1,497.00	7,185,600	
愛知製鋼	3,700	3,640.00	13,468,000	
日立金属	71,600	1,537.00	110,049,200	
日本金属	1,600	968.00	1,548,800	
大平洋金属	4,500	2,418.00	10,881,000	貸付株式数 1,700株
新日本電工	42,400	181.00	7,674,400	貸付株式数 16,700株
栗本鉄工所	3,300	1,981.00	6,537,300	
虹 技	1,000	1,450.00	1,450,000	貸付株式数 300株
日本鑄鉄管	700	1,376.00	963,200	貸付株式数 200株
日本製鋼所	20,200	2,265.00	45,753,000	
三菱製鋼	4,900	1,140.00	5,586,000	
日亜鋼業	9,600	342.00	3,283,200	
日本精線	1,100	2,995.00	3,294,500	
エンビプロHD	2,500	762.00	1,905,000	貸付株式数 500株
大紀アルミニウム	10,800	783.00	8,456,400	
日本軽金属HD	168,200	227.00	38,181,400	
三井金属	17,900	2,761.00	49,421,900	
東邦亜鉛	3,400	2,135.00	7,259,000	
三菱マテリアル	43,900	2,952.00	129,592,800	
住友鉱山	84,900	3,301.00	280,254,900	
DOWAホールディングス	16,800	3,950.00	66,360,000	
古河機金	11,800	1,516.00	17,888,800	
エス・サイエンス	29,700	51.00	1,514,700	
大阪チタニウム	6,900	1,573.00	10,853,700	
東邦チタニウム	11,900	970.00	11,543,000	貸付株式数 4,600株
UACJ	10,100	2,487.00	25,118,700	貸付株式数 3,800株 (3,800株)
CKサンエツ	1,400	3,005.00	4,207,000	
古河電工	20,700	3,030.00	62,721,000	
住友電工	248,400	1,674.50	415,945,800	
フジクラ	80,300	459.00	36,857,700	
昭和電線HLDGS	7,700	1,015.00	7,815,500	
東京特殊電線	1,000	2,237.00	2,237,000	
タツタ電線	13,200	587.00	7,748,400	

カナレ電気	1,100	1,879.00	2,066,900	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	2,500	1,354.00	3,385,000		
リョービ	8,200	2,103.00	17,244,600		
アーレステイ	8,700	534.00	4,645,800		
アサヒHD	11,700	2,607.00	30,501,900		
東洋製罐グループHD	42,300	1,942.00	82,146,600		
ホッカンホールディングス	3,600	1,960.00	7,056,000		
コロナ	3,700	1,190.00	4,403,000		
横河ブリッジHLDGS	12,400	1,891.00	23,448,400		
OSJBHD	33,300	271.00	9,024,300		
駒井ハルテック	1,200	1,695.00	2,034,000		
高田機工	600	2,587.00	1,552,200	貸付株式数	200株
三和ホールディングス	63,700	1,220.00	77,714,000		
文化シャツタ-	19,600	971.00	19,031,600	貸付株式数	7,600株
三協立山	9,200	1,248.00	11,481,600		
アルインコ	4,800	1,197.00	5,745,600		
東洋シャツタ-	1,600	756.00	1,209,600		
LIXILグループ	98,100	1,885.00	184,918,500		
日本ファイルコン	5,000	530.00	2,650,000	貸付株式数	1,900株
ノーリツ	13,800	1,408.00	19,430,400		
長府製作所	6,800	2,461.00	16,734,800		
リンナイ	12,900	8,430.00	108,747,000		
ユニプレス	13,000	1,688.00	21,944,000		
ダイニチ工業	3,500	687.00	2,404,500		
日東精工	9,100	654.00	5,951,400	貸付株式数	1,600株
三洋工業	900	2,039.00	1,835,100		
岡部	13,500	926.00	12,501,000	貸付株式数	200株
ジーテクト	8,300	1,736.00	14,408,800		
東プレ	12,400	1,729.00	21,439,600		
高周波熱錬	12,700	887.00	11,264,900	貸付株式数	1,000株
東京製綱	4,800	1,156.00	5,548,800		
サンコール	3,700	489.00	1,809,300		
モリテックスチル	5,200	429.00	2,230,800		
パイオラックス	9,800	2,216.00	21,716,800	貸付株式数	500株
エイチワン	6,500	845.00	5,492,500	貸付株式数	600株
日本発条	71,300	982.00	70,016,600	貸付株式数	21,500株
中央発条	800	2,916.00	2,332,800		
アドバネクス	900	1,652.00	1,486,800		
三浦工業	28,700	3,695.00	106,046,500		
タクマ	22,500	1,278.00	28,755,000		

テクノプロ・ホールディング	12,900	7,480.00	96,492,000		
アトラ	1,500	392.00	588,000	貸付株式数	500株
インターワークス	1,300	522.00	678,600		
アイ・アールジャパンHD	2,600	4,210.00	10,946,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
K e e P e r 技研	2,300	1,369.00	3,148,700		
ファーストロジック	1,500	636.00	954,000	貸付株式数	400株
三機サービス	1,400	1,025.00	1,435,000	貸付株式数	100株
G u n o s y	4,500	1,658.00	7,461,000	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	1,200	342.00	410,400	貸付株式数	400株
イー・ガーディアン	3,200	2,244.00	7,180,800	貸付株式数	1,200株
リブセンス	4,100	310.00	1,271,000	貸付株式数	1,600株 (300株)
ジャパンマテリアル	19,800	1,510.00	29,898,000	貸付株式数	2,600株
ベクトル	8,000	1,139.00	9,112,000	貸付株式数	3,100株
ウチヤマホールディングス	3,200	554.00	1,772,800		
チャームケアコーポレーション	2,100	1,953.00	4,101,300	貸付株式数	800株 (100株)
ライクキッズ	1,500	884.00	1,326,000	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,100	559.00	1,173,900	貸付株式数	800株
I B J	4,300	1,076.00	4,626,800		
アサンテ	2,600	2,027.00	5,270,200	貸付株式数	900株
N・フィールド	4,400	703.00	3,093,200	貸付株式数	1,700株
バリューHR	1,300	3,505.00	4,556,500	貸付株式数	400株
M & Aキャピタルパートナー	4,600	4,300.00	19,780,000		
ライドオンエクスプレスHD	2,400	1,942.00	4,660,800		
E R Iホールディングス	1,800	800.00	1,440,000		
アビスト	1,000	2,688.00	2,688,000	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	4,400	2,251.00	9,904,400	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
ウィルグループ	4,200	1,157.00	4,859,400	貸付株式数	1,500株
エスクローAJ	8,700	239.00	2,079,300	貸付株式数	3,400株
リクルートホールディングス	460,100	3,978.00	1,830,277,800		
エラン	3,800	1,710.00	6,498,000	貸付株式数	1,400株
ツガミ	13,700	1,131.00	15,494,700	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,700	6,150.00	47,355,000		
東芝機械	7,500	2,801.00	21,007,500		
アマダホールディングス	84,300	1,247.00	105,122,100		
アイダエンジニア	17,900	1,002.00	17,935,800		

滝澤鉄工所	2,000	1,397.00	2,794,000		
F U J I	28,500	1,947.00	55,489,500	貸付株式数	11,000株
牧野フライス	7,800	5,410.00	42,198,000		
オーエスジー	30,700	2,257.00	69,289,900	貸付株式数	12,000株
ダイジェット	700	1,471.00	1,029,700		
旭ダイヤモンド	17,300	656.00	11,348,800		
D M G 森精機	42,100	1,753.00	73,801,300	貸付株式数	16,400株
ソデイツク	15,600	1,022.00	15,943,200	貸付株式数	300株
ディスコ	9,000	23,550.00	211,950,000		
日東工器	3,600	2,227.00	8,017,200		
日進工具	1,900	2,325.00	4,417,500		
パンチ工業	5,900	574.00	3,386,600		
富士ダイス	2,900	662.00	1,919,800		
土木管理総合試験	2,800	447.00	1,251,600	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	2,300	1,068.00	2,456,400		
日本郵政	526,400	1,036.50	545,613,600		
ベルシステム24HLDGS	10,800	1,719.00	18,565,200	貸付株式数	1,000株
鎌倉新書	4,800	1,928.00	9,254,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
S M N	1,000	911.00	911,000		
一蔵	700	750.00	525,000		
L I T A L I C O	2,200	2,682.00	5,900,400	貸付株式数	500株
グローバルキッズCOMP	900	755.00	679,500	貸付株式数	300株
エポラブルアジア	2,900	2,203.00	6,388,700		
アトラエ	1,700	3,835.00	6,519,500	貸付株式数	600株
ストライク	2,400	4,380.00	10,512,000		
ソラスト	17,700	1,307.00	23,133,900	貸付株式数	6,900株
セラク	2,000	796.00	1,592,000	貸付株式数	700株
インソース	3,100	3,435.00	10,648,500	貸付株式数	1,000株
豊田自動織機	54,400	6,470.00	351,968,000		
豊和工業	3,600	748.00	2,692,800	貸付株式数	300株
O K K	2,800	678.00	1,898,400	貸付株式数	500株
石川製作所	1,600	1,347.00	2,155,200	貸付株式数	600株
東洋機械金属	4,700	573.00	2,693,100		
津田駒工業	1,300	1,295.00	1,683,500		
エンシュウ	1,600	1,366.00	2,185,600	貸付株式数	300株
島精機製作所	10,700	2,779.00	29,735,300	貸付株式数	4,100株
オプトラン	7,400	2,933.00	21,704,200	貸付株式数	2,600株
N C ホールディングス	2,000	614.00	1,228,000	貸付株式数	700株
イワキポンプ	3,100	1,146.00	3,552,600		

フリー	6,400	1,050.00	6,720,000	
ヤマシンフィルタ	14,400	876.00	12,614,400	貸付株式数 4,100株 (2,100株)
日阪製作所	8,100	1,000.00	8,100,000	
やまびこ	12,900	1,141.00	14,718,900	貸付株式数 2,700株
平田機工	3,100	7,970.00	24,707,000	貸付株式数 1,200株
ペガサスミシン製造	6,700	513.00	3,437,100	
マルマエ	2,700	1,043.00	2,816,100	貸付株式数 1,000株
タツモ	3,100	1,198.00	3,713,800	貸付株式数 1,200株
ナブテスコ	39,200	3,410.00	133,672,000	
三井海洋開発	7,100	2,497.00	17,728,700	
レオン自動機	6,500	1,657.00	10,770,500	貸付株式数 100株
S M C	21,100	49,930.00	1,053,523,000	
ヤマハモーターロボH L D G S	5,800	564.00	3,271,200	貸付株式数 1,800株
ホソカワミクロン	2,300	4,515.00	10,384,500	
ユニオンツール	2,500	3,290.00	8,225,000	
オイレス工業	8,600	1,692.00	14,551,200	
日精エーエスビー	2,200	4,895.00	10,769,000	貸付株式数 800株
サト - ホールディングス	9,500	3,370.00	32,015,000	
技研製作所	5,800	4,440.00	25,752,000	
日本エアーテック	2,100	707.00	1,484,700	
カワタ	1,900	1,144.00	2,173,600	貸付株式数 700株
日精樹脂工業	5,500	1,026.00	5,643,000	
オカダアイヨン	2,100	1,239.00	2,601,900	貸付株式数 200株
ワイエイシイホールディング ス	2,900	715.00	2,073,500	貸付株式数 1,100株
小松製作所	304,400	2,587.00	787,482,800	貸付株式数 117,000株
住友重機械	38,400	3,165.00	121,536,000	
日立建機	26,900	2,951.00	79,381,900	貸付株式数 7,600株
日工	9,100	751.00	6,834,100	
巴工業	2,800	2,282.00	6,389,600	
井関農機	6,700	1,657.00	11,101,900	貸付株式数 2,400株
T O W A	6,800	1,150.00	7,820,000	貸付株式数 2,100株
丸山製作所	1,500	1,238.00	1,857,000	
北川鉄工所	3,000	2,268.00	6,804,000	貸付株式数 100株
シンニッタン	10,300	446.00	4,593,800	
ローツェ	2,900	3,925.00	11,382,500	貸付株式数 1,100株
タカキタ	2,300	556.00	1,278,800	貸付株式数 800株
クボタ	356,600	1,725.50	615,313,300	

荏原実業	1,700	2,266.00	3,852,200	
東洋エンジニア	8,900	722.00	6,425,800	貸付株式数 900株 (700株)
三菱化工機	2,300	1,906.00	4,383,800	貸付株式数 100株
月島機械	12,400	1,706.00	21,154,400	
帝国電機製作所	5,500	1,322.00	7,271,000	
東京機械	2,700	371.00	1,001,700	貸付株式数 400株
新東工業	15,800	1,038.00	16,400,400	貸付株式数 700株
渋谷工業	5,900	3,160.00	18,644,000	貸付株式数 2,200株
アイチ コーポレーション	11,500	723.00	8,314,500	貸付株式数 4,400株
小森コーポレーション	16,900	1,161.00	19,620,900	貸付株式数 6,200株
鶴見製作所	5,200	2,056.00	10,691,200	
住友精密	1,000	3,450.00	3,450,000	
日本ギア工業	2,000	414.00	828,000	貸付株式数 700株
酒井重工業	1,300	3,065.00	3,984,500	
荏原製作所	29,600	3,345.00	99,012,000	
石井鉄工所	900	2,539.00	2,285,100	
西島製作所	6,700	962.00	6,445,400	貸付株式数 900株
北越工業	6,900	1,278.00	8,818,200	貸付株式数 400株
ダイキン工業	85,600	15,770.00	1,349,912,000	
オルガノ	2,400	6,540.00	15,696,000	貸付株式数 700株
ト - ヨ - カネツ	2,900	2,284.00	6,623,600	
栗田工業	36,300	3,135.00	113,800,500	
椿本チエイン	9,600	3,820.00	36,672,000	
大同工業	3,200	837.00	2,678,400	
日 機 装	20,100	1,348.00	27,094,800	
木村化工機	5,500	623.00	3,426,500	貸付株式数 2,100株
レイズネクスト	11,300	1,242.00	14,034,600	
アネスト岩田	10,400	1,016.00	10,566,400	貸付株式数 4,000株
ダイフク	34,300	6,590.00	226,037,000	貸付株式数 13,400株
サムコ	1,800	1,216.00	2,188,800	
加藤製作所	3,700	1,841.00	6,811,700	
油研工業	1,100	1,700.00	1,870,000	
タダノ	32,400	1,091.00	35,348,400	貸付株式数 12,600株
フジテック	24,400	1,745.00	42,578,000	
C K D	18,700	1,855.00	34,688,500	貸付株式数 2,700株
キトー	5,100	1,651.00	8,420,100	
平和	18,800	2,269.00	42,657,200	
理想科学工業	5,900	1,893.00	11,168,700	
S A N K Y O	15,000	3,720.00	55,800,000	

日本金銭機械	7,400	929.00	6,874,600	貸付株式数	600株
マースグループHLDGS	4,300	2,036.00	8,754,800	貸付株式数	200株
福島工業	4,200	3,500.00	14,700,000		
オーイズミ	2,800	575.00	1,610,000	貸付株式数	500株
ダイコク電機	3,100	1,682.00	5,214,200		
竹内製作所	11,200	1,692.00	18,950,400		
アマノ	17,600	3,285.00	57,816,000		
JUKI	9,300	914.00	8,500,200	貸付株式数	2,700株
サンデンホールディングス	8,800	766.00	6,740,800	貸付株式数	2,900株 (2,900株)
蛇の目マシン	6,300	409.00	2,576,700		
ブラザー工業	82,100	2,201.00	180,702,100	貸付株式数	32,100株
マックス	10,200	2,106.00	21,481,200		
モリタホールディングス	11,700	1,756.00	20,545,200		
グローリー	18,600	3,330.00	61,938,000		
新晃工業	6,300	1,891.00	11,913,300		
大和冷機工業	9,700	1,292.00	12,532,400		
セガサミーホールディングス	66,700	1,585.00	105,719,500		
日本ピストンリング	2,500	1,441.00	3,602,500		
リケン	3,100	4,295.00	13,314,500	貸付株式数	300株
TPR	9,100	2,091.00	19,028,100	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	13,700	1,716.00	23,509,200		
ホシザキ	19,700	9,610.00	189,317,000		
大豊工業	5,500	874.00	4,807,000	貸付株式数	800株
日本精工	126,600	1,077.00	136,348,200		
NTN	155,700	346.00	53,872,200		
ジェイテクト	64,400	1,384.00	89,129,600		
不二越	6,200	5,140.00	31,868,000	貸付株式数	2,400株
ミネベアミツミ	124,700	2,159.00	269,227,300		
日本トムソン	19,800	499.00	9,880,200		
THK	39,100	3,120.00	121,992,000		
ユーシン精機	5,200	1,059.00	5,506,800		
前澤給装工業	2,400	2,147.00	5,152,800		
イーグル工業	8,400	1,086.00	9,122,400	貸付株式数	2,000株
前澤工業	4,400	391.00	1,720,400	貸付株式数	600株
日本ピラ - 工業	6,800	1,512.00	10,281,600		
キッツ	27,200	762.00	20,726,400	貸付株式数	400株
日立	323,000	4,309.00	1,391,807,000		
三菱電機	672,200	1,534.50	1,031,490,900		
富士電機	40,500	3,425.00	138,712,500		

東洋電機製造	2,600	1,565.00	4,069,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,300	4,065.00	293,899,500	貸付株式数	29,900株
シンフォニアテクノロジー	8,700	1,377.00	11,979,900		
明電舎	12,400	2,148.00	26,635,200		
オリジン	1,800	1,517.00	2,730,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,200	5,460.00	17,472,000		
デンヨー	5,700	2,090.00	11,913,000		
ベйкаレントコンサルティング	3,900	5,960.00	23,244,000	貸付株式数	1,200株
ORCHESTRA HLDGS	1,300	1,118.00	1,453,400	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,000	713.00	1,426,000	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,600	434.00	1,128,400	貸付株式数	1,000株
MS - Japan	2,100	1,512.00	3,175,200	貸付株式数	100株
船場	1,000	1,146.00	1,146,000		
グレイステクノロジー	2,900	2,961.00	8,586,900	貸付株式数	1,100株
ジャパンエレベーターSHD	6,800	2,933.00	19,944,400		
フルテック	900	1,395.00	1,255,500	貸付株式数	300株 (300株)
グリーンズ	2,400	1,222.00	2,932,800	貸付株式数	900株
ツナググループHLDGS	800	618.00	494,400		
ソウルドアウト	1,000	1,775.00	1,775,000		
MS & CONSULTING	900	1,067.00	960,300		
日総工産	4,300	1,083.00	4,656,900		
キュービーネットHLDGS	3,900	2,498.00	9,742,200	貸付株式数	1,500株
RPAホールディングス	3,600	1,253.00	4,510,800	貸付株式数	1,400株
三桜工業	8,500	1,340.00	11,390,000	貸付株式数	3,300株
マキタ	87,600	3,705.00	324,558,000		
東芝テック	8,400	4,460.00	37,464,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
マブチモーター	18,500	4,225.00	78,162,500	貸付株式数	2,000株
日本電産	80,900	16,325.00	1,320,692,500	貸付株式数	31,600株
ユーエムシーエレクトロニクス	4,000	548.00	2,192,000	貸付株式数	1,500株
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,469.00	5,729,100	貸付株式数	200株
東光高岳	3,700	1,197.00	4,428,900		
ダブル・スコープ	10,100	833.00	8,413,300	貸付株式数	3,800株 (100株)
宮越ホールディングス	2,500	1,028.00	2,570,000	貸付株式数	900株

ダイヘン	7,400	3,695.00	27,343,000		
ヤーマン	9,800	702.00	6,879,600	貸付株式数	3,800株
JVCケンウッド	54,900	275.00	15,097,500		
ミマキエンジニアリング	6,000	528.00	3,168,000		
第一精工	2,400	2,645.00	6,348,000	貸付株式数	900株 (500株)
日新電機	15,800	1,152.00	18,201,600		
大崎電気	13,300	745.00	9,908,500		
オムロン	62,500	6,540.00	408,750,000		
日東工業	9,900	2,504.00	24,789,600		
I D E C	9,700	2,365.00	22,940,500	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	1,600	832.00	1,331,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	800	1,275.00	1,020,000	貸付株式数	300株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,400	2,304.00	51,609,600		
サクサホールディングス	1,500	1,978.00	2,967,000		
メルコホールディングス	2,300	3,100.00	7,130,000	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,500	2,101.00	3,151,500	貸付株式数	200株
日本電気	81,500	4,440.00	361,860,000	貸付株式数	13,200株
富士通	64,800	10,050.00	651,240,000		
沖電気	27,300	1,530.00	41,769,000		
岩崎通信機	2,900	805.00	2,334,500		
電気興業	3,200	3,115.00	9,968,000		
サンケン電気	7,300	3,170.00	23,141,000	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,300	1,675.00	2,177,500		
アイホン	3,800	1,906.00	7,242,800		
ルネサスエレクトロニクス	320,700	719.00	230,583,300		
セイコーエプソン	83,400	1,662.00	138,610,800	貸付株式数	1,400株
ワコム	45,300	448.00	20,294,400		
アルバック	13,400	4,300.00	57,620,000	貸付株式数	200株
アクセル	2,800	706.00	1,976,800	貸付株式数	900株
E I Z O	5,200	4,180.00	21,736,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	71.00	4,380,700	貸付株式数	55,600株
日本信号	17,100	1,304.00	22,298,400		
京三製作所	15,800	516.00	8,152,800	貸付株式数	300株
能美防災	8,900	2,383.00	21,208,700		
ホーチキ	4,900	1,667.00	8,168,300		
星和電機	3,400	558.00	1,897,200		
エレコム	7,300	4,145.00	30,258,500		
パナソニック	768,000	1,032.00	792,576,000		

シャープ	77,800	1,656.00	128,836,800	貸付株式数	30,400株
アンリツ	43,300	2,072.00	89,717,600	貸付株式数	16,900株
富士通ゼネラル	18,300	2,107.00	38,558,100	貸付株式数	7,300株
ソ ニ ー	424,900	6,998.00	2,973,450,200		
T D K	32,400	11,690.00	378,756,000		
帝国通信工業	3,000	1,205.00	3,615,000	貸付株式数	400株
タムラ製作所	22,300	660.00	14,718,000	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	59,500	2,487.00	147,976,500		
池上通信機	2,100	1,046.00	2,196,600	貸付株式数	900株
日本電波工業	6,000	668.00	4,008,000	貸付株式数	2,000株
鈴木	3,600	816.00	2,937,600	貸付株式数	1,400株
日本トリム	900	4,960.00	4,464,000	貸付株式数	200株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,700	2,175.00	8,047,500	貸付株式数	1,400株
フオスタ - 電機	7,000	2,023.00	14,161,000		
S M K	1,700	2,979.00	5,064,300		
ヨコオ	4,300	3,255.00	13,996,500	貸付株式数	600株
ティアック	4,900	231.00	1,131,900	貸付株式数	1,800株
ホシデン	18,300	1,318.00	24,119,400		
ヒロセ電機	10,400	13,710.00	142,584,000		
日本航空電子	15,400	2,104.00	32,401,600		
T O A	7,200	1,100.00	7,920,000	貸付株式数	300株
マクセルホールディングス	14,500	1,494.00	21,663,000		
古野電気	8,700	1,263.00	10,988,100		
ユニデンホールディングス	1,800	1,837.00	3,306,600		
スミダコーポレーション	5,100	1,325.00	6,757,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
アイコム	3,700	2,588.00	9,575,600		
リオン	2,800	2,964.00	8,299,200	貸付株式数	400株
本多通信工業	5,700	545.00	3,106,500		
船井電機	6,800	740.00	5,032,000	貸付株式数	2,600株 (1,800株)
横河電機	61,700	2,014.00	124,263,800		
新電元工業	2,400	3,685.00	8,844,000		
アズビル	42,400	3,185.00	135,044,000	貸付株式数	1,000株
東亜ディーケーケー	3,300	860.00	2,838,000	貸付株式数	1,200株
日本光電工業	27,800	2,969.00	82,538,200		
チ ノ ー	2,300	1,422.00	3,270,600		
共和電業	7,000	443.00	3,101,000		
日本電子材料	2,700	868.00	2,343,600		

堀場製作所	13,300	7,350.00	97,755,000	
アドバンテスト	50,000	5,320.00	266,000,000	貸付株式数 7,700株
小野測器	2,800	537.00	1,503,600	
エスベック	5,900	2,132.00	12,578,800	
キーエンス	60,900	37,970.00	2,312,373,000	
日置電機	3,500	3,740.00	13,090,000	貸付株式数 200株
シスメックス	48,000	7,761.00	372,528,000	
日本マイクロニクス	11,700	1,154.00	13,501,800	
メガチップス	6,300	2,462.00	15,510,600	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,500	3,885.00	13,597,500	
IMAGICA GROUP	5,600	644.00	3,606,400	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
澤藤電機	800	2,133.00	1,706,400	貸付株式数 300株
デンソー	148,000	4,953.00	733,044,000	
原田工業	3,200	975.00	3,120,000	
コーセル	8,100	1,251.00	10,133,100	貸付株式数 3,200株
イリソ電子工業	5,600	5,300.00	29,680,000	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,000	1,622.00	17,842,000	貸付株式数 1,800株
千代田インテグレ	3,100	2,395.00	7,424,500	
アイ・オー・データ	2,500	1,022.00	2,555,000	
レーザーテック	13,800	9,580.00	132,204,000	貸付株式数 4,900株
スタンレー電気	47,400	3,105.00	147,177,000	
岩崎電気	2,600	1,425.00	3,705,000	貸付株式数 200株
ウシオ電機	38,900	1,643.00	63,912,700	貸付株式数 15,200株
岡谷電機	5,200	381.00	1,981,200	貸付株式数 1,300株
ヘリオステクノH	6,100	500.00	3,050,000	貸付株式数 1,300株
エノモト	2,000	1,155.00	2,310,000	
日本セラミック	6,800	2,861.00	19,454,800	
遠藤照明	3,400	704.00	2,393,600	
古河電池	4,800	783.00	3,758,400	
双信電機	3,200	512.00	1,638,400	貸付株式数 1,100株
山一電機	4,800	1,595.00	7,656,000	貸付株式数 100株
函 研	4,400	2,510.00	11,044,000	
日本電子	13,300	3,090.00	41,097,000	
カ シ オ	59,500	2,080.00	123,760,000	貸付株式数 23,200株
ファナック	63,900	21,240.00	1,357,236,000	
日本シイエムケイ	15,700	658.00	10,330,600	貸付株式数 2,800株
エンプラス	3,400	3,650.00	12,410,000	
大真空	2,400	1,649.00	3,957,600	貸付株式数 300株

ローム	29,800	9,170.00	273,266,000	
浜松ホトニクス	48,200	4,455.00	214,731,000	
三井ハイテック	7,400	2,051.00	15,177,400	貸付株式数 300株 (200株)
新光電気工業	22,600	1,096.00	24,769,600	
京セラ	94,500	7,445.00	703,552,500	
協栄産業	800	1,540.00	1,232,000	
太陽誘電	29,900	2,975.00	88,952,500	貸付株式数 11,600株
村田製作所	197,500	6,529.00	1,289,477,500	
双葉電子工業	10,500	1,389.00	14,584,500	
日東電工	46,300	6,210.00	287,523,000	
北陸電気工業	2,700	1,124.00	3,034,800	
東海理化電機	17,700	2,163.00	38,285,100	
ニチコン	22,700	1,235.00	28,034,500	
日本ケミコン	5,100	2,081.00	10,613,100	
K O A	10,100	1,440.00	14,544,000	
三井E & S H D	21,700	922.00	20,007,400	
日立造船	53,300	435.00	23,185,500	貸付株式数 3,000株
三菱重工業	112,600	4,244.00	477,874,400	
川崎重工業	52,300	2,481.00	129,756,300	
I H I	48,400	2,584.00	125,065,600	
名村造船所	21,500	287.00	6,170,500	貸付株式数 8,400株
サノヤスホールディングス	8,000	181.00	1,448,000	貸付株式数 200株
スプリックス	2,200	1,260.00	2,772,000	貸付株式数 800株
日本車輛	2,400	3,175.00	7,620,000	貸付株式数 800株
三菱ロジスネクスト	10,500	1,226.00	12,873,000	貸付株式数 3,800株
近畿車輛	1,000	1,501.00	1,501,000	貸付株式数 200株
F P G	20,800	1,069.00	22,235,200	
島根銀行	1,300	704.00	915,200	貸付株式数 300株 (300株)
じもとホールディングス	45,000	107.00	4,815,000	
全国保証	18,700	4,410.00	82,467,000	
めぶきフィナンシャルG	344,400	284.00	97,809,600	貸付株式数 134,800株
東京きらぼしF G	9,000	1,532.00	13,788,000	
九州フィナンシャルG	108,900	493.00	53,687,700	貸付株式数 100株
かんぼ生命保険	23,500	1,876.00	44,086,000	貸付株式数 100株
ゆうちょ銀行	187,500	1,070.00	200,625,000	
富山第一銀行	15,900	346.00	5,501,400	
コンコルディア・フィナンシャル	389,900	447.00	174,285,300	

ジェイリース	1,800	324.00	583,200	
西日本フィナンシャルHD	45,300	856.00	38,776,800	
マーキュリアインベストメント	2,900	742.00	2,151,800	貸付株式数 1,100株
イントラスト	2,300	699.00	1,607,700	
日本モーゲージサービス	1,300	1,624.00	2,111,200	
C a s a	2,800	1,263.00	3,536,400	
アルヒ	10,500	2,515.00	26,407,500	貸付株式数 4,100株
プレミアグループ	3,600	2,336.00	8,409,600	貸付株式数 1,300株
日産自動車	792,800	688.30	545,684,240	
いすゞ自動車	194,800	1,290.50	251,389,400	
トヨタ自動車	749,200	7,738.00	5,797,309,600	
日野自動車	84,000	1,102.00	92,568,000	
三菱自動車工業	249,200	496.00	123,603,200	貸付株式数 83,400株
エフテック	4,700	755.00	3,548,500	
レシップホールディングス	2,600	659.00	1,713,400	
GMB	1,200	795.00	954,000	
ファルテック	1,200	1,260.00	1,512,000	
武蔵精密工業	15,000	1,523.00	22,845,000	貸付株式数 200株
日産車体	13,100	1,138.00	14,907,800	貸付株式数 4,400株
新明和工業	18,000	1,460.00	26,280,000	
極東開発工業	12,500	1,631.00	20,387,500	
日信工業	13,500	2,224.00	30,024,000	
トピー工業	5,600	2,084.00	11,670,400	
ティラド	2,400	2,035.00	4,884,000	
タチエス	11,000	1,442.00	15,862,000	
N O K	36,100	1,729.00	62,416,900	
フタバ産業	18,800	826.00	15,528,800	
K Y B	7,500	3,315.00	24,862,500	貸付株式数 100株
市光工業	10,000	868.00	8,680,000	
大同メタル工業	13,000	728.00	9,464,000	
プレス工業	33,300	444.00	14,785,200	
ミクニ	8,600	345.00	2,967,000	
太平洋工業	14,100	1,513.00	21,333,300	
ケーヒン	15,300	2,572.00	39,351,600	
河西工業	9,100	873.00	7,944,300	
アイシン精機	55,400	4,245.00	235,173,000	
マ ッ ダ	197,900	977.00	193,348,300	
今仙電機製作所	6,300	941.00	5,928,300	貸付株式数 500株
本田技研	529,300	3,104.00	1,642,947,200	

スズキ	133,200	4,755.00	633,366,000	
S U B A R U	208,700	2,873.50	599,699,450	
安永	3,200	1,293.00	4,137,600	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	87,700	2,307.00	202,323,900	
ショーワ	15,700	2,277.00	35,748,900	
小糸製作所	40,300	5,700.00	229,710,000	
T B K	8,000	431.00	3,448,000	
エクセディ	9,200	2,508.00	23,073,600	
ミツバ	12,400	741.00	9,188,400	貸付株式数 2,300株
豊田合成	21,700	2,604.00	56,506,800	
愛三工業	10,600	866.00	9,179,600	
盟和産業	1,000	1,122.00	1,122,000	貸付株式数 300株
日本プラスト	5,200	718.00	3,733,600	貸付株式数 2,000株
ヨ ロ ズ	6,300	1,446.00	9,109,800	
エフ・シー・シー	11,000	2,412.00	26,532,000	
新家工業	1,500	1,443.00	2,164,500	
シマノ	25,200	17,920.00	451,584,000	貸付株式数 9,600株
テイ・エス テック	15,600	3,415.00	53,274,000	
関西みらいFG	38,800	732.00	28,401,600	貸付株式数 1,000株
3 3 F G	6,200	1,708.00	10,589,600	
第四北越フィナンシャルG	11,500	3,005.00	34,557,500	貸付株式数 100株
ジャムコ	3,400	1,510.00	5,134,000	貸付株式数 400株
小 野 建	5,900	1,348.00	7,953,200	
はるやまHLDGS	3,100	846.00	2,622,600	
南 陽	1,400	1,804.00	2,525,600	
ノ ジ マ	11,800	2,281.00	26,915,800	貸付株式数 200株
佐鳥電機	4,800	915.00	4,392,000	貸付株式数 1,100株
カップ・クリエイト	9,300	1,465.00	13,624,500	貸付株式数 3,600株 (3,000株)
エコートレーディング	1,700	542.00	921,400	貸付株式数 500株
伯東	4,000	1,311.00	5,244,000	
コンドーテック	5,100	1,102.00	5,620,200	
中山福	3,800	540.00	2,052,000	貸付株式数 300株
ライトオン	4,900	633.00	3,101,700	貸付株式数 1,900株 (1,400株)
ナガイレーベン	9,600	2,561.00	24,585,600	貸付株式数 2,400株
ジーンズメイト	2,000	338.00	676,000	貸付株式数 700株
三菱食品	7,300	2,932.00	21,403,600	
良品計画	87,900	2,498.00	219,574,200	貸付株式数 32,900株
三城ホールディングス	6,900	287.00	1,980,300	貸付株式数 2,700株

松田産業	4,800	1,567.00	7,521,600	
第一興商	9,800	5,420.00	53,116,000	
メディバルHD	71,400	2,372.00	169,360,800	
アドヴァン	10,100	1,308.00	13,210,800	
S P K	1,400	2,850.00	3,990,000	
萩原電気HLDGS	2,400	2,830.00	6,792,000	貸付株式数 800株
アルビス	2,500	2,293.00	5,732,500	
アズワン	4,300	9,560.00	41,108,000	貸付株式数 1,600株
スズデン	2,300	1,464.00	3,367,200	貸付株式数 800株
尾家産業	1,900	1,347.00	2,559,300	貸付株式数 800株
シモジマ	4,000	1,240.00	4,960,000	
ドウシシャ	6,200	1,810.00	11,222,000	
小津産業	1,400	1,807.00	2,529,800	貸付株式数 500株
コナカ	7,700	406.00	3,126,200	貸付株式数 400株
高速	3,900	1,184.00	4,617,600	
ハウス ローゼ	800	1,671.00	1,336,800	貸付株式数 100株
G-7ホールディングス	1,900	4,500.00	8,550,000	
たけびし	2,300	1,461.00	3,360,300	貸付株式数 900株
イオン北海道	6,700	799.00	5,353,300	貸付株式数 200株
コジマ	11,400	459.00	5,232,600	
ヒマラヤ	2,300	836.00	1,922,800	貸付株式数 900株
コーナン商事	9,400	2,548.00	23,951,200	貸付株式数 3,300株
ネットワンシステムズ	25,100	3,150.00	79,065,000	
エコス	2,400	1,683.00	4,039,200	
ワタミ	7,800	1,312.00	10,233,600	貸付株式数 2,000株
マルシェ	1,700	781.00	1,327,700	貸付株式数 600株
リックス	1,500	1,632.00	2,448,000	貸付株式数 300株
システムソフト	15,400	112.00	1,724,800	
パンパシフィックHD	158,700	1,798.00	285,342,600	
丸文	6,000	604.00	3,624,000	
西松屋チェーン	14,500	1,005.00	14,572,500	
ゼンショーホールディングス	31,700	2,514.00	79,693,800	
ハピネット	5,500	1,432.00	7,876,000	
幸楽苑ホールディングス	4,200	2,117.00	8,891,400	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	1,044.00	1,461,600	貸付株式数 500株
橋本総業HLDGS	1,300	1,763.00	2,291,900	貸付株式数 200株
日本ライフライン	19,600	1,544.00	30,262,400	貸付株式数 6,300株
サイゼリヤ	10,900	2,631.00	28,677,900	貸付株式数 4,100株
タカショー	3,200	500.00	1,600,000	

エクセル	1,900	1,256.00	2,386,400	貸付株式数	900株
V Tホールディングス	27,500	473.00	13,007,500	貸付株式数	800株
マルカ	2,300	2,298.00	5,285,400	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,600	3,335.00	18,676,000		
魚力	1,800	1,530.00	2,754,000		
I D O M	17,800	530.00	9,434,000	貸付株式数	6,900株 (2,100株)
日本エム・ディ・エム	3,900	2,327.00	9,075,300	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,900	531.00	1,008,900	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,700	2,324.00	3,950,800		
ユナイテッドアローズ	6,900	3,340.00	23,046,000		
進和	3,900	2,352.00	9,172,800	貸付株式数	1,300株
エスケイジャパン	1,400	466.00	652,400		
ダイトロン	2,800	1,697.00	4,751,600		
ハイデイ日高	9,500	2,187.00	20,776,500	貸付株式数	2,600株
シークス	8,400	1,554.00	13,053,600	貸付株式数	3,200株
京都きもの友禅	4,200	350.00	1,470,000	貸付株式数	1,500株
コロワイド	22,000	2,216.00	48,752,000	貸付株式数	7,900株
ピーシーデポコーポ	8,700	478.00	4,158,600	貸付株式数	3,400株
田中商事	2,100	713.00	1,497,300		
オーハシテクニカ	3,700	1,462.00	5,409,400		
壱番屋	4,700	5,280.00	24,816,000	貸付株式数	1,700株
白銅	2,300	1,448.00	3,330,400		
トップカルチャー	2,400	340.00	816,000	貸付株式数	800株 (600株)
P L A N T	1,700	656.00	1,115,200	貸付株式数	500株
スギホールディングス	13,200	6,170.00	81,444,000	貸付株式数	5,500株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,532.00	7,342,800	貸付株式数	900株
島津製作所	80,300	3,315.00	266,194,500		
J M S	5,600	743.00	4,160,800		
クボテック	1,700	437.00	742,900	貸付株式数	600株 (100株)
長野計器	4,900	783.00	3,836,700		
ブイ・テクノロジー	3,100	6,010.00	18,631,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,500	1,549.00	16,264,500	貸付株式数	3,900株
東京計器	4,200	1,015.00	4,263,000		
愛知時計	900	4,305.00	3,874,500		
インターアクション	3,600	2,502.00	9,007,200	貸付株式数	100株
オーバル	6,000	252.00	1,512,000	貸付株式数	2,300株
東京精密	12,200	3,935.00	48,007,000	貸付株式数	1,400株

マニー	26,800	2,935.00	78,658,000	貸付株式数	10,400株
ニコン	108,800	1,506.00	163,852,800	貸付株式数	40,700株
トプコン	33,900	1,471.00	49,866,900		
オリンパス	372,000	1,634.00	607,848,000		
理研計器	5,900	2,325.00	13,717,500		
S C R E E Nホールディングス	11,700	7,600.00	88,920,000	貸付株式数	100株
キヤノン電子	7,000	2,075.00	14,525,000		
タムロン	5,400	2,529.00	13,656,600		
HOYA	135,300	10,025.00	1,356,382,500		
シード	2,900	1,079.00	3,129,100	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	4,500	1,896.00	8,532,000	貸付株式数	1,700株
エー・アンド・デイ	6,100	803.00	4,898,300		
朝日インテック	57,000	3,195.00	182,115,000	貸付株式数	22,100株
キヤノン	361,800	3,046.00	1,102,042,800	貸付株式数	141,500株
リコー	171,100	1,124.00	192,316,400		
シチズン時計	78,700	610.00	48,007,000	貸付株式数	28,000株
リズム時計	2,100	939.00	1,971,900		
大研医器	4,600	630.00	2,898,000		
メニコン	9,200	4,350.00	40,020,000		
シンシア	800	608.00	486,400	貸付株式数	200株
中本パックス	1,700	1,490.00	2,533,000	貸付株式数	100株
スノーピーク	3,000	1,096.00	3,288,000	貸付株式数	1,200株
パラマウントベッドHD	7,100	4,310.00	30,601,000		
トランザクション	4,300	1,000.00	4,300,000		
S H O B I	2,000	395.00	790,000	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	3,100	2,819.00	8,738,900	貸付株式数	1,200株 (800株)
前田工織	7,400	1,950.00	14,430,000	貸付株式数	2,700株
永大産業	8,700	341.00	2,966,700		
アートネイチャー	7,200	773.00	5,565,600		
バンダイナムコHLDGS	69,500	6,688.00	464,816,000		
アイフィスジャパン	1,700	777.00	1,320,900	貸付株式数	100株
共立印刷	11,600	164.00	1,902,400		
S H O E I	3,200	5,060.00	16,192,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	9,500	1,022.00	9,709,000		
マーベラス	10,000	758.00	7,580,000	貸付株式数	3,900株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	11,700	4,270.00	49,959,000		

萩原工業	3,700	1,617.00	5,982,900	貸付株式数 300株 (300株)
エイベックス	11,400	1,334.00	15,207,600	
トッパン・フォームズ	14,400	1,162.00	16,732,800	
フジシールインターナショナル	15,100	2,487.00	37,553,700	貸付株式数 1,800株
タカラトミー	30,100	1,345.00	40,484,500	
廣済堂	4,700	880.00	4,136,000	
エステールホールディングス	1,900	679.00	1,290,100	
アーク	26,100	97.00	2,531,700	
レック	7,200	1,300.00	9,360,000	貸付株式数 2,600株
タカノ	2,600	823.00	2,139,800	
三光合成	7,600	432.00	3,283,200	貸付株式数 500株
プロネクサス	5,800	1,206.00	6,994,800	
ホクシン	4,200	172.00	722,400	貸付株式数 100株
ウッドワン	2,300	1,189.00	2,734,700	
大建工業	4,600	1,974.00	9,080,400	
きもと	11,500	191.00	2,196,500	
凸版印刷	94,800	2,178.00	206,474,400	
大日本印刷	87,900	2,940.00	258,426,000	
共同印刷	2,100	2,950.00	6,195,000	貸付株式数 200株
N I S S H A	13,800	1,133.00	15,635,400	貸付株式数 5,300株 (2,200株)
光村印刷	600	1,769.00	1,061,400	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	3,530.00	21,180,000	
ヴィア・ホールディングス	8,100	667.00	5,402,700	貸付株式数 200株
TAKARA & COMPANY	3,200	1,702.00	5,446,400	
前澤化成工業	4,200	1,197.00	5,027,400	
未来工業	3,600	2,243.00	8,074,800	
アシックス	55,500	1,786.00	99,123,000	貸付株式数 22,800株
ツツミ	2,100	2,097.00	4,403,700	
ウェーブロックHLDGS	2,300	780.00	1,794,000	貸付株式数 400株
ジェイ エス ピー	4,000	1,905.00	7,620,000	
ニチハ	9,400	2,777.00	26,103,800	
エフピコ	7,400	6,650.00	49,210,000	貸付株式数 400株 (400株)
小松ウオール工業	2,000	2,408.00	4,816,000	
ヤマハ	40,000	6,130.00	245,200,000	
河合楽器	2,100	3,675.00	7,717,500	

クリナップ	6,200	705.00	4,371,000		
ピジヨン	40,600	5,070.00	205,842,000	貸付株式数	15,800株
天馬	4,500	2,012.00	9,054,000		
兼松サステック	400	1,780.00	712,000	貸付株式数	100株
キングジム	5,600	892.00	4,995,200		
象印マホービン	19,700	1,798.00	35,420,600	貸付株式数	7,700株
リンテック	16,000	2,463.00	39,408,000		
信越ポリマー	12,000	968.00	11,616,000		
東リ	16,700	316.00	5,277,200		
イトーキ	14,300	517.00	7,393,100		
任天堂	41,200	43,240.00	1,781,488,000		
三菱鉛筆	11,100	1,737.00	19,280,700		
松風	3,000	1,700.00	5,100,000	貸付株式数	1,100株
タカラスタンダード	13,900	2,007.00	27,897,300	貸付株式数	4,700株
コクヨ	32,300	1,635.00	52,810,500		
ナカバヤシ	6,600	594.00	3,920,400		
ニフコ	24,600	3,050.00	75,030,000	貸付株式数	9,500株
立川ブラインド	2,900	1,437.00	4,167,300	貸付株式数	1,100株
グローブライド	3,000	2,703.00	8,109,000		
オカムラ	23,500	1,080.00	25,380,000	貸付株式数	7,300株
バルカー	5,400	2,624.00	14,169,600	貸付株式数	800株
MUTOHホールディングス	1,000	1,796.00	1,796,000		
伊藤忠	463,000	2,438.00	1,128,794,000	貸付株式数	127,400株
丸紅	689,400	825.20	568,892,880		
スクロール	10,100	350.00	3,535,000		
高島	1,100	1,721.00	1,893,100		
ヨンドシーホールディングス	6,700	2,613.00	17,507,100	貸付株式数	2,700株
三陽商会	3,500	1,407.00	4,924,500		
長瀬産業	37,100	1,628.00	60,398,800		
ナイガイ	2,500	441.00	1,102,500	貸付株式数	900株
蝶理	4,200	1,974.00	8,290,800	貸付株式数	100株
豊田通商	73,900	3,885.00	287,101,500		
オンワードホールディングス	39,700	643.00	25,527,100		
三共生興	10,000	601.00	6,010,000		
兼松	24,800	1,412.00	35,017,600		
美津濃	6,100	2,805.00	17,110,500		
ツカモトコーポレーション	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	100株
ファミリーマート	52,900	2,601.00	137,592,900		
ルックホールディングス	2,200	1,233.00	2,712,600	貸付株式数	800株
三井物産	581,800	1,967.50	1,144,691,500		

日本紙パルプ	3,800	4,060.00	15,428,000	
東京エレクトロン	44,800	22,570.00	1,011,136,000	
日立ハイテクノロジーズ	23,000	7,170.00	164,910,000	
カメイ	8,600	1,227.00	10,552,200	
東都水産	900	2,662.00	2,395,800	
OUGホールディングス	1,000	2,719.00	2,719,000	貸付株式数 300株
スターゼン	2,500	4,405.00	11,012,500	貸付株式数 900株
セイコーHD	9,500	2,816.00	26,752,000	貸付株式数 3,800株
山 善	25,900	1,045.00	27,065,500	
椿本興業	1,200	4,020.00	4,824,000	
住友商事	417,800	1,656.50	692,085,700	
日本ユニシス	20,600	3,595.00	74,057,000	
内田洋行	2,800	5,240.00	14,672,000	
三菱商事	464,500	2,907.50	1,350,533,750	
第一実業	3,200	3,715.00	11,888,000	
キヤノンマーケティングJPN	18,900	2,510.00	47,439,000	貸付株式数 5,900株
西華産業	3,700	1,409.00	5,213,300	
佐藤商事	5,400	912.00	4,924,800	
菱洋エレクトロ	6,800	2,046.00	13,912,800	貸付株式数 2,400株
東京産業	5,900	561.00	3,309,900	貸付株式数 1,100株
ユアサ商事	6,300	3,500.00	22,050,000	
神鋼商事	1,700	2,654.00	4,511,800	
小林産業	3,900	313.00	1,220,700	
阪和興業	12,400	2,840.00	35,216,000	
正栄食品	4,300	3,385.00	14,555,500	
カナデン	5,400	1,325.00	7,155,000	
菱電商事	4,800	1,655.00	7,944,000	
ニプロ	46,600	1,327.00	61,838,200	貸付株式数 16,700株
フルサト工業	3,600	1,646.00	5,925,600	
岩谷産業	14,700	3,675.00	54,022,500	貸付株式数 5,600株
すてきナイスグループ	2,500	1,090.00	2,725,000	貸付株式数 600株
昭光通商	2,300	717.00	1,649,100	貸付株式数 200株
ニチモウ	1,000	1,987.00	1,987,000	貸付株式数 300株
極東貿易	1,900	2,194.00	4,168,600	
イワキ	8,600	476.00	4,093,600	貸付株式数 1,900株
兼松エレクトロニクス	3,600	3,425.00	12,330,000	
三愛石油	16,300	1,059.00	17,261,700	
稲畑産業	14,600	1,586.00	23,155,600	
G S Iクレオス	1,600	1,118.00	1,788,800	貸付株式数 300株

明和産業	6,100	620.00	3,782,000	
クワザワ	2,400	606.00	1,454,400	
ゴ-ルドウイン	11,900	7,940.00	94,486,000	貸付株式数 4,600株 (3,000株)
ユニ・チャ-ム	129,600	3,634.00	470,966,400	貸付株式数 51,200株
デサント	12,800	1,810.00	23,168,000	
キ-ング	3,100	530.00	1,643,000	
ワ-キ-タ	14,100	1,095.00	15,439,500	貸付株式数 1,900株
ヤマトインタ-ナショナル	4,100	396.00	1,623,600	貸付株式数 100株
東邦ホールディングス	21,200	2,537.00	53,784,400	貸付株式数 8,300株
サンゲツ	18,200	2,135.00	38,857,000	
ミツウロコグループ	9,700	1,420.00	13,774,000	貸付株式数 3,800株
シナネンホールディングス	2,700	1,932.00	5,216,400	
伊藤忠エネクス	14,700	895.00	13,156,500	
サンリオ	18,600	2,234.00	41,552,400	貸付株式数 7,200株
サンワ-テクノス	4,600	1,199.00	5,515,400	貸付株式数 100株
リョ-サン	7,300	2,947.00	21,513,100	
新光商事	10,300	900.00	9,270,000	
ト-ホ-	3,000	1,873.00	5,619,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
三信電気	3,500	1,700.00	5,950,000	
東陽テクニカ	7,600	1,140.00	8,664,000	
モスフード-サービス	8,700	3,070.00	26,709,000	貸付株式数 3,300株 (100株)
加賀電子	6,600	2,468.00	16,288,800	
三益半導体	5,900	2,012.00	11,870,800	
ソーダニツカ	6,800	611.00	4,154,800	
立花エレテック	4,800	1,758.00	8,438,400	
木曾路	8,600	2,880.00	24,768,000	貸付株式数 1,700株
S R Sホールディングス	7,700	1,044.00	8,038,800	貸付株式数 3,000株
千-趣-会	12,000	432.00	5,184,000	貸付株式数 4,600株
タカキュー	5,000	189.00	945,000	貸付株式数 1,900株 (1,600株)
ケーヨー	13,600	539.00	7,330,400	貸付株式数 2,300株
上新電機	7,800	2,465.00	19,227,000	
日本瓦斯	10,500	3,440.00	36,120,000	
ロイヤルホールディングス	11,600	2,542.00	29,487,200	貸付株式数 4,500株
東-天-紅	500	1,250.00	625,000	
いなげや	8,200	1,480.00	12,136,000	
島-忠	13,900	3,005.00	41,769,500	貸付株式数 4,800株

チヨダ	7,000	1,617.00	11,319,000	
ライフコーポレーション	5,000	2,504.00	12,520,000	
リンガーハット	8,100	2,484.00	20,120,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
MrMaxHD	9,100	499.00	4,540,900	
テナアライド	6,000	441.00	2,646,000	貸付株式数 2,300株
AOKIホールディングス	13,200	1,134.00	14,968,800	
オークワ	10,400	1,443.00	15,007,200	貸付株式数 900株
コメリ	10,200	2,363.00	24,102,600	
青山商事	13,700	1,677.00	22,974,900	
しまむら	7,700	8,970.00	69,069,000	
はせがわ	3,500	402.00	1,407,000	貸付株式数 100株
高島屋	48,300	1,304.00	62,983,200	
松屋	13,400	854.00	11,443,600	貸付株式数 2,500株
エイチ・ツー・オーリテイリング	31,400	1,233.00	38,716,200	
近鉄百貨店	2,500	3,610.00	9,025,000	貸付株式数 900株
パルコ	6,400	1,364.00	8,729,600	
丸井グループ	60,700	2,651.00	160,915,700	貸付株式数 21,500株
クレディセゾン	46,400	1,810.00	83,984,000	
アクシアルリテイリング	5,500	3,870.00	21,285,000	
井筒屋	3,700	241.00	891,700	
イオン	254,800	2,265.00	577,122,000	貸付株式数 90,700株
イズミ	13,500	4,270.00	57,645,000	
フオーバル	2,900	1,059.00	3,071,100	
平和堂	13,500	2,115.00	28,552,500	
フジ	8,000	1,971.00	15,768,000	
ヤオコー	7,500	5,110.00	38,325,000	貸付株式数 400株
ゼビオホールディングス	8,000	1,328.00	10,624,000	
ケーズホールディングス	63,900	1,366.00	87,287,400	
PALTAC	10,600	5,400.00	57,240,000	貸付株式数 1,300株
三谷産業	8,700	346.00	3,010,200	
OLYMPICグループ	3,400	651.00	2,213,400	
日産東京販売HD	9,800	278.00	2,724,400	
新生銀行	48,700	1,717.00	83,617,900	
あおぞら銀行	39,600	2,818.00	111,592,800	
三菱UFJフィナンシャルG	4,564,700	582.10	2,657,111,870	
りそなホールディングス	728,000	466.80	339,830,400	
三井住友トラストHD	125,400	4,195.00	526,053,000	

三井住友フィナンシャルG	458,600	4,008.00	1,838,068,800	
千葉銀行	227,900	624.00	142,209,600	
群馬銀行	130,200	390.00	50,778,000	
武蔵野銀行	9,800	1,961.00	19,217,800	
千葉興業銀行	18,300	344.00	6,295,200	貸付株式数 2,500株
筑波銀行	27,600	243.00	6,706,800	
七十七銀行	22,400	1,794.00	40,185,600	
青森銀行	5,200	2,831.00	14,721,200	貸付株式数 1,500株
秋田銀行	4,300	2,259.00	9,713,700	
山形銀行	7,500	1,659.00	12,442,500	
岩手銀行	4,400	2,965.00	13,046,000	
東邦銀行	59,500	278.00	16,541,000	貸付株式数 19,800株
東北銀行	3,100	1,034.00	3,205,400	
みちのく銀行	4,300	1,567.00	6,738,100	貸付株式数 1,600株 (1,600株)
ふくおかフィナンシャルG	55,900	2,092.00	116,942,800	貸付株式数 5,000株
静岡銀行	164,100	839.00	137,679,900	
十六銀行	8,300	2,662.00	22,094,600	
スルガ銀行	63,000	545.00	34,335,000	貸付株式数 15,200株 (7,000株)
八十二銀行	160,100	475.00	76,047,500	貸付株式数 15,000株
山梨中央銀行	7,700	1,154.00	8,885,800	
大垣共立銀行	13,100	2,550.00	33,405,000	
福井銀行	5,700	1,734.00	9,883,800	
北國銀行	6,800	3,510.00	23,868,000	
清水銀行	2,700	2,180.00	5,886,000	
富山銀行	1,300	2,641.00	3,433,300	
滋賀銀行	13,300	2,743.00	36,481,900	貸付株式数 5,100株
南都銀行	11,000	2,763.00	30,393,000	
百五銀行	60,000	354.00	21,240,000	貸付株式数 1,500株
京都銀行	23,700	4,580.00	108,546,000	
紀陽銀行	23,500	1,724.00	40,514,000	貸付株式数 2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,100	1,134.00	50,009,400	
広島銀行	98,100	545.00	53,464,500	
山陰合同銀行	39,400	687.00	27,067,800	
中国銀行	57,100	1,097.00	62,638,700	貸付株式数 22,300株
鳥取銀行	2,200	1,382.00	3,040,400	
伊予銀行	94,600	608.00	57,516,800	貸付株式数 2,100株
百十四銀行	7,100	2,258.00	16,031,800	
四国銀行	10,100	1,045.00	10,554,500	貸付株式数 200株

阿波銀行	10,800	2,706.00	29,224,800	貸付株式数	3,700株
大分銀行	3,800	2,854.00	10,845,200		
宮崎銀行	4,400	2,655.00	11,682,000		
佐賀銀行	4,000	1,740.00	6,960,000		
沖縄銀行	6,100	3,675.00	22,417,500		
琉球銀行	15,300	1,258.00	19,247,400	貸付株式数	2,500株
セブン銀行	221,300	341.00	75,463,300		
みずほフィナンシャルG	9,009,900	169.70	1,528,980,030		
高知銀行	2,500	933.00	2,332,500		
山口フィナンシャルG	82,800	757.00	62,679,600	貸付株式数	30,200株
芙蓉総合リース	7,000	7,230.00	50,610,000		
みずほリース	10,300	3,280.00	33,784,000		
東京センチュリー	13,300	5,990.00	79,667,000	貸付株式数	5,000株
SBIホールディングス	74,100	2,258.00	167,317,800	貸付株式数	30,300株
日本証券金融	29,200	543.00	15,855,600		
アイフル	101,100	252.00	25,477,200		
日本アジア投資	5,600	290.00	1,624,000	貸付株式数	2,100株
長野銀行	2,100	1,713.00	3,597,300		
名古屋銀行	5,300	3,390.00	17,967,000		
北洋銀行	100,000	241.00	24,100,000		
愛知銀行	2,400	3,845.00	9,228,000		
中京銀行	2,700	2,257.00	6,093,900	貸付株式数	200株
大光銀行	2,200	1,751.00	3,852,200		
愛媛銀行	9,300	1,224.00	11,383,200	貸付株式数	2,900株
トマト銀行	2,500	1,069.00	2,672,500		
京葉銀行	28,400	629.00	17,863,600	貸付株式数	4,500株
栃木銀行	31,800	231.00	7,345,800		
北日本銀行	2,100	2,195.00	4,609,500	貸付株式数	700株
東和銀行	11,700	888.00	10,389,600	貸付株式数	1,100株
福島銀行	6,200	303.00	1,878,600	貸付株式数	2,400株
大東銀行	3,400	631.00	2,145,400	貸付株式数	1,200株
リコーリース	5,200	3,910.00	20,332,000		
イオンフィナンシャルサービ ス	40,500	1,685.00	68,242,500		
アコム	133,000	458.00	60,914,000		
ジャックス	7,300	2,696.00	19,680,800		
オリコ	179,500	162.00	29,079,000		
日立キャピタル	15,600	2,695.00	42,042,000		
アプラスフィナンシャル	32,500	93.00	3,022,500	貸付株式数	2,400株
オリックス	414,700	1,797.50	745,423,250	貸付株式数	170,000株

三菱UFJリース	168,200	705.00	118,581,000	貸付株式数	8,500株
ジャフコ	10,200	4,230.00	43,146,000	貸付株式数	100株
九州リースサービス	3,200	602.00	1,926,400		
トモニホールディングス	51,300	419.00	21,494,700		
大和証券G本社	532,300	556.10	296,012,030		
野村ホールディングス	1,166,600	562.30	655,979,180	貸付株式数	448,200株
岡三証券グループ	56,700	406.00	23,020,200	貸付株式数	300株
丸三証券	19,700	547.00	10,775,900	貸付株式数	7,700株
東洋証券	23,600	173.00	4,082,800	貸付株式数	9,200株
東海東京HD	76,400	338.00	25,823,200	貸付株式数	29,200株
光世証券	1,600	677.00	1,083,200	貸付株式数	400株
水戸証券	19,200	283.00	5,433,600	貸付株式数	5,500株
いちよし証券	12,300	682.00	8,388,600		
松井証券	37,900	888.00	33,655,200		
SOMPOホールディングス	124,700	4,371.00	545,063,700		
だいこう証券ビジ	3,200	649.00	2,076,800		
日本取引所グループ	190,200	1,874.00	356,434,800		
マネックスG	50,100	281.00	14,078,100	貸付株式数	19,500株
極東証券	8,900	785.00	6,986,500		
岩井コスモホールディング	6,300	1,282.00	8,076,600	貸付株式数	1,200株
藍澤證券	11,900	738.00	8,782,200	貸付株式数	1,100株
フィデアホール	64,900	134.00	8,696,600		
池田泉州HD	76,600	203.00	15,549,800		
アニコムホールディングス	5,500	3,585.00	19,717,500	貸付株式数	1,900株
MS&AD	173,400	3,560.00	617,304,000		
SONY FH	54,500	2,573.00	140,228,500		
マネーパートナーズGP	7,000	250.00	1,750,000	貸付株式数	1,900株
スパークス・グループ	22,900	249.00	5,702,100		
小林洋行	1,900	267.00	507,300		
第一生命HLDS	375,200	1,761.50	660,914,800		
東京海上HD	237,100	6,020.00	1,427,342,000	貸付株式数	91,100株
アドバンテッジリスクマネ	3,200	990.00	3,168,000	貸付株式数	900株
イー・ギャランティ	7,100	1,416.00	10,053,600	貸付株式数	2,300株
アサックス	3,400	653.00	2,220,200	貸付株式数	1,300株
NECキャピタルソリューション	2,700	2,463.00	6,650,100		
T&Dホールディングス	205,100	1,295.00	265,604,500		
アドバンスクリエイト	1,600	1,864.00	2,982,400		
三井不動産	331,000	2,731.50	904,126,500		
三菱地所	464,500	2,010.00	933,645,000		

平和不動産	12,200	2,614.00	31,890,800	
東京建物	72,500	1,653.00	119,842,500	
ダイビル	17,100	1,172.00	20,041,200	
京阪神ビルディング	10,800	1,437.00	15,519,600	貸付株式数 1,000株
住友不動産	149,000	3,839.00	572,011,000	
太平洋興発	2,600	808.00	2,100,800	貸付株式数 200株
テーオーシー	13,000	895.00	11,635,000	
東京楽天地	1,100	6,140.00	6,754,000	
スターツコーポレーション	9,000	2,691.00	24,219,000	
フジ住宅	7,700	711.00	5,474,700	
空港施設	6,700	540.00	3,618,000	
明和地所	3,600	589.00	2,120,400	
ゴールドクレスト	5,200	2,162.00	11,242,400	貸付株式数 2,000株
リログループ	35,100	2,986.00	104,808,600	貸付株式数 13,700株
エスリード	2,600	2,171.00	5,644,600	
日神不動産	9,900	496.00	4,910,400	
日本エスコン	12,000	989.00	11,868,000	貸付株式数 1,600株
タカラレーベン	30,300	489.00	14,816,700	
サンヨーハウジ 名古屋	3,700	995.00	3,681,500	貸付株式数 800株
イオンモール	33,200	1,775.00	58,930,000	
毎日コムネット	1,400	832.00	1,164,800	
ファースト住建	2,800	1,319.00	3,693,200	
ランド	359,700	12.00	4,316,400	貸付株式数 36,900株
カチタス	8,200	4,920.00	40,344,000	貸付株式数 500株 (500株)
東祥	4,000	2,454.00	9,816,000	貸付株式数 1,500株
トーセイ	9,100	1,333.00	12,130,300	貸付株式数 100株
穴吹興産	700	3,280.00	2,296,000	
サンフロンティア不動産	9,200	1,274.00	11,720,800	
インテリックス	1,900	711.00	1,350,900	
ランドビジネス	2,800	761.00	2,130,800	
日本社宅サービス	1,700	1,107.00	1,881,900	貸付株式数 400株
グランディハウス	5,100	470.00	2,397,000	貸付株式数 300株
東武鉄道	70,900	4,055.00	287,499,500	
相鉄ホールディングス	21,500	3,040.00	65,360,000	
東急	169,500	2,177.00	369,001,500	
京浜急行	86,300	2,242.00	193,484,600	
小田急電鉄	100,000	2,708.00	270,800,000	
京王電鉄	34,900	7,060.00	246,394,000	
京成電鉄	46,800	4,535.00	212,238,000	

富士急行	9,200	4,265.00	39,238,000	貸付株式数 3,500株 (900株)
新京成電鉄	1,800	2,303.00	4,145,400	
東日本旅客鉄道	118,300	10,085.00	1,193,055,500	
西日本旅客鉄道	59,900	9,675.00	579,532,500	
東海旅客鉄道	55,900	22,245.00	1,243,495,500	
西武ホールディングス	90,200	1,930.00	174,086,000	
鴻池運輸	10,700	1,663.00	17,794,100	
西日本鉄道	18,700	2,629.00	49,162,300	
ハマキョウレックス	5,200	3,665.00	19,058,000	
サカイ引越センター	3,500	6,970.00	24,395,000	貸付株式数 100株
近鉄グループHLDGS	63,700	6,150.00	391,755,000	
阪急阪神HLDGS	84,900	4,745.00	402,850,500	
南海電鉄	30,200	3,040.00	91,808,000	
京阪ホールディングス	28,300	5,450.00	154,235,000	貸付株式数 2,200株
神戸電鉄	1,600	3,990.00	6,384,000	貸付株式数 100株
名古屋鉄道	52,400	3,495.00	183,138,000	貸付株式数 15,600株
山陽電鉄	4,600	2,248.00	10,340,800	
トランコム	1,800	7,800.00	14,040,000	
日本通運	22,500	7,010.00	157,725,000	貸付株式数 8,100株
ヤマトホールディングス	111,600	1,901.00	212,151,600	
山 九	17,700	5,690.00	100,713,000	
日 新	5,500	1,743.00	9,586,500	
丸 運	3,600	274.00	986,400	貸付株式数 1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,110.00	16,172,000	
センコーグループHLDGS	35,200	917.00	32,278,400	
トナミホールディングス	1,500	5,120.00	7,680,000	
ニッコンホールディングス	22,800	2,730.00	62,244,000	
日石輸送	700	2,781.00	1,946,700	
福山通運	8,100	4,185.00	33,898,500	貸付株式数 2,600株
セイノーホールディングス	47,700	1,479.00	70,548,300	
エスライン	1,900	997.00	1,894,300	貸付株式数 100株
神奈川中央交通	1,600	4,015.00	6,424,000	
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
丸和運輸機関	6,700	2,570.00	17,219,000	貸付株式数 1,800株 (1,600株)
C & F ロジホールディングス	6,400	1,408.00	9,011,200	
日本郵船	53,300	1,925.00	102,602,500	
商船三井	40,300	2,942.00	118,562,600	貸付株式数 5,000株

川崎汽船	19,600	1,879.00	36,828,400	貸付株式数	7,600株
N S ユナイテッド海運	3,500	2,319.00	8,116,500		
明治海運	6,700	342.00	2,291,400		
飯野海運	30,400	360.00	10,944,000		
共栄タンカー	600	1,778.00	1,066,800		
九州旅客鉄道	56,800	3,780.00	214,704,000		
S G ホールディングス	66,800	2,633.00	175,884,400		
日本航空	116,600	3,391.00	395,390,600		
A N A ホールディングス	116,400	3,758.00	437,431,200		
パスコ	1,200	1,860.00	2,232,000		
西本W I S M E T T A C H D	1,200	3,915.00	4,698,000	貸付株式数	400株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	600	1,502.00	901,200		
G E N K Y D R U G S T O R E S	3,200	2,539.00	8,124,800	貸付株式数	1,200株
国際紙パルプ商事	15,700	301.00	4,725,700		
総合メディカルH D	5,800	2,065.00	11,977,000		
ブックオフG H D	3,800	1,066.00	4,050,800	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,835.00	57,267,000		
三井倉庫H O L D	7,300	1,999.00	14,592,700		
住友倉庫	23,500	1,510.00	35,485,000		
渋沢倉庫	3,500	2,149.00	7,521,500		
ヤマタネ	3,300	1,504.00	4,963,200	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	11,300	336.00	3,796,800		
乾汽船	3,700	1,148.00	4,247,600	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	14,100	548.00	7,726,800	貸付株式数	1,000株
ケイヒン	1,200	1,328.00	1,593,600		
中央倉庫	3,900	1,238.00	4,828,200	貸付株式数	100株
川西倉庫	1,200	1,054.00	1,264,800		
安田倉庫	5,200	995.00	5,174,000		
ファイズホールディングス	1,300	640.00	832,000	貸付株式数	200株
東洋埠頭	1,900	1,412.00	2,682,800		
宇徳	5,400	537.00	2,899,800		
上 組	36,400	2,444.00	88,961,600		
サンリツ	1,500	700.00	1,050,000	貸付株式数	500株
キムラユニティー	1,700	1,102.00	1,873,400		
キューソー流通システム	1,600	1,877.00	3,003,200	貸付株式数	600株 (300株)
近鉄エクスプレス	13,500	1,944.00	26,244,000	貸付株式数	3,500株

東海運	3,600	283.00	1,018,800	貸付株式数	100株
エーアイテイー	4,500	968.00	4,356,000		
内外トランスライン	2,200	1,471.00	3,236,200	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	700	736.00	515,200	貸付株式数	200株
日本コンセプト	2,000	1,430.00	2,860,000	貸付株式数	200株
東京放送HD	40,100	1,750.00	70,175,000		
日本テレビHLD S	55,100	1,452.00	80,005,200		
朝日放送グループHD	6,600	749.00	4,943,400	貸付株式数	300株
テレビ朝日HD	18,100	1,769.00	32,018,900		
スカパーJ S A T H D	43,500	464.00	20,184,000	貸付株式数	1,200株
テレビ東京HD	5,400	2,303.00	12,436,200		
日本BS放送	2,200	1,084.00	2,384,800	貸付株式数	700株 (700株)
ビジョン	6,100	1,793.00	10,937,300	貸付株式数	2,200株
スマートバリュー	1,900	814.00	1,546,600	貸付株式数	700株
USEN - NEXT HLD G S	2,500	1,111.00	2,777,500	貸付株式数	900株
ワイヤレスゲート	3,100	659.00	2,042,900	貸付株式数	1,200株
コネクシオ	3,800	1,525.00	5,795,000		
日本通信	51,100	220.00	11,242,000	貸付株式数	22,900株 (1,000株)
クロップス	1,200	750.00	900,000		
日本電信電話	440,900	5,598.00	2,468,158,200		
K D D I	491,600	3,150.00	1,548,540,000		
ソフトバンク	599,600	1,483.50	889,506,600	貸付株式数	234,400株
光通信	6,800	25,880.00	175,984,000		
N T T ドコモ	487,300	3,007.00	1,465,311,100	貸付株式数	190,500株
エムティーアイ	6,400	692.00	4,428,800	貸付株式数	1,100株
GMOインターネット	26,000	2,269.00	58,994,000		
ファイバーゲート	1,300	1,385.00	1,800,500	貸付株式数	400株
アイドママーケティングコ ミュ	2,000	727.00	1,454,000		
K A D O K A W A	17,800	1,776.00	31,612,800		
学研ホールディングス	2,200	7,490.00	16,478,000		
ゼンリン	13,100	1,907.00	24,981,700	貸付株式数	4,000株
昭文社	3,100	421.00	1,305,100		
インプレスホールディングス	5,300	183.00	969,900		
東京電力HD	536,700	483.00	259,226,100	貸付株式数	1,900株
中部電力	205,600	1,535.50	315,698,800		
関西電力	254,700	1,251.00	318,629,700		

中国電力	93,000	1,456.00	135,408,000	貸付株式数	36,300株
北陸電力	61,600	790.00	48,664,000		
東北電力	168,000	1,105.00	185,640,000		
四国電力	60,600	1,059.00	64,175,400		
九州電力	138,700	971.00	134,677,700		
北海道電力	63,000	532.00	33,516,000		
沖縄電力	12,500	2,003.00	25,037,500		
電源開発	53,500	2,678.00	143,273,000		
エフオン	3,100	785.00	2,433,500	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,500	1,747.00	16,596,500	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
レノバ	11,100	1,160.00	12,876,000		
東京瓦斯	129,200	2,653.00	342,767,600		
大阪瓦斯	130,400	2,077.00	270,840,800		
東邦瓦斯	33,300	4,170.00	138,861,000		
北海道瓦斯	3,600	1,586.00	5,709,600	貸付株式数	400株
広島ガス	14,100	359.00	5,061,900		
西部瓦斯	7,600	2,520.00	19,152,000		
静岡ガス	19,100	928.00	17,724,800	貸付株式数	100株
メタウォーター	3,200	4,070.00	13,024,000	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,400	1,525.00	5,185,000		
松竹	4,400	16,230.00	71,412,000	貸付株式数	1,600株
東宝	39,400	4,465.00	175,921,000	貸付株式数	14,700株
エイチ・アイ・エス	10,000	3,070.00	30,700,000	貸付株式数	3,900株
東映	2,500	17,170.00	42,925,000	貸付株式数	700株
ラックランド	1,300	2,450.00	3,185,000	貸付株式数	400株
NTTデータ	175,600	1,518.00	266,560,800		
共立メンテナンス	10,600	5,200.00	55,120,000	貸付株式数	4,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	7,200	1,415.00	10,188,000	貸付株式数	1,400株
建設技術研究所	4,400	2,030.00	8,932,000		
スペース	4,100	1,317.00	5,399,700		
長大	2,400	1,181.00	2,834,400		
アインホールディングス	8,900	6,880.00	61,232,000	貸付株式数	3,400株
燦ホールディングス	2,800	1,348.00	3,774,400		
ピー・シー・エー	800	4,480.00	3,584,000	貸付株式数	300株
スバル興業	400	7,880.00	3,152,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,500	1,393.00	3,482,500	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,200	1,279.00	1,534,800	貸付株式数	100株
ビジネスB太田昭和	1,100	2,377.00	2,614,700	貸付株式数	200株

ナガワ	2,000	7,530.00	15,060,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	4,540.00	6,356,000		
東京都競馬	4,200	3,475.00	14,595,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,667.00	4,334,200	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,500	3,165.00	33,232,500	貸付株式数	4,100株
東京ドーム	26,100	1,013.00	26,439,300	貸付株式数	8,600株
D T S	14,700	2,352.00	34,574,400		
スクウェア・エニックス・H D	28,100	5,470.00	153,707,000		
シーイーシー	7,100	2,261.00	16,053,100		
カプコン	31,100	2,623.00	81,575,300		
西尾レントオール	6,500	3,085.00	20,052,500		
アイ・エス・ビー	1,300	1,995.00	2,593,500		
アゴーラ・ホスピタリティ G	41,500	34.00	1,411,000		
日本空港ビルデング	21,200	5,830.00	123,596,000	貸付株式数	8,200株
トランス・コスモス	6,100	2,874.00	17,531,400		
乃村工藝社	27,500	1,410.00	38,775,000		
ジャステック	4,200	1,120.00	4,704,000		
S C S K	15,200	5,770.00	87,704,000		
藤田観光	2,800	2,868.00	8,030,400	貸付株式数	100株
K N T - C Tホールディング ス	4,000	1,511.00	6,044,000		
日本管財	6,900	1,951.00	13,461,900		
トーカイ	6,200	2,869.00	17,787,800		
白洋舎	700	2,864.00	2,004,800	貸付株式数	200株
セコム	68,100	9,486.00	645,996,600		
日本システムウエア	2,200	2,574.00	5,662,800		
セントラル警備保障	3,100	6,460.00	20,026,000	貸付株式数	1,200株
アイネス	6,500	1,365.00	8,872,500		
丹青社	12,100	1,232.00	14,907,200		
メイテック	7,900	5,830.00	46,057,000		
T K C	5,600	5,130.00	28,728,000		
富士ソフト	8,400	4,275.00	35,910,000		
応用地質	6,900	1,400.00	9,660,000		
船井総研ホールディング ン	13,300	2,546.00	33,861,800		
N S D	10,800	3,590.00	38,772,000		
進学会ホールディングス	2,500	533.00	1,332,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,756.00	1,229,200	貸付株式数	200株
オオバ	5,000	798.00	3,990,000	貸付株式数	1,900株

コナミホールディングス	24,000	4,860.00	116,640,000	貸付株式数	800株
いであ	1,200	2,320.00	2,784,000	貸付株式数	400株
学 究 社	1,900	1,332.00	2,530,800		
ベネッセホールディングス	21,400	2,908.00	62,231,200		
イオンディライト	7,900	3,870.00	30,573,000		
ナック	3,600	1,056.00	3,801,600		
福井コンピュータHLD S	2,600	3,875.00	10,075,000	貸付株式数	900株 (800株)
ニチイ学館	9,200	1,621.00	14,913,200		
ダイセキ	10,800	3,260.00	35,208,000	貸付株式数	4,100株
ステップ	2,300	1,567.00	3,604,100		
日鉄物産	4,800	5,070.00	24,336,000		
泉州電業	2,000	2,919.00	5,838,000		
元気寿司	1,700	2,994.00	5,089,800		
トラスコ中山	13,800	2,799.00	38,626,200	貸付株式数	5,300株
ヤマダ電機	201,700	557.00	112,346,900		
オートバックスセブン	24,500	1,801.00	44,124,500	貸付株式数	2,100株
モリト	4,800	800.00	3,840,000		
アークランドサカモト	10,300	1,281.00	13,194,300		
ニトリホールディングス	28,700	17,260.00	495,362,000		
グルメ杵屋	4,700	1,195.00	5,616,500		
愛 眼	5,200	247.00	1,284,400		
ケーユーホールディングス	3,500	931.00	3,258,500		
吉野家ホールディングス	21,700	2,756.00	59,805,200	貸付株式数	6,600株 (5,200株)
加藤産業	10,400	3,665.00	38,116,000		
北恵	1,200	918.00	1,101,600		
イノテック	3,900	1,052.00	4,102,800		
イエローハット	12,500	2,004.00	25,050,000		
松屋フーズHLD G S	3,200	4,510.00	14,432,000		
J B C Cホールディングス	4,500	1,863.00	8,383,500	貸付株式数	300株
J Kホールディングス	6,100	647.00	3,946,700		
サガミホールディングス	8,800	1,376.00	12,108,800	貸付株式数	100株
日 伝	5,900	2,096.00	12,366,400		
関西スーパーマーケット	5,500	1,086.00	5,973,000	貸付株式数	200株
ミロク情報サービス	5,800	3,385.00	19,633,000	貸付株式数	2,400株 (100株)
北沢産業	5,000	288.00	1,440,000	貸付株式数	1,100株
杉本商事	3,500	2,005.00	7,017,500	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,800	2,671.00	50,214,800		

王将フードサービス	4,900	6,620.00	32,438,000	
プレナス	7,400	1,936.00	14,326,400	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
ミニストップ	4,900	1,472.00	7,212,800	貸付株式数 1,800株
アークス	13,600	2,284.00	31,062,400	
パローホールディングス	14,700	2,064.00	30,340,800	
東 テ ク	2,200	2,426.00	5,337,200	
ミスミグループ本社	82,900	2,738.00	226,980,200	
藤 久	500	817.00	408,500	貸付株式数 100株
アルテック	5,200	229.00	1,190,800	
ベ ル ク	3,300	5,230.00	17,259,000	
大 庄	3,500	1,605.00	5,617,500	貸付株式数 100株
タキヒヨー	2,000	1,938.00	3,876,000	
ファーストリテイリング	8,900	67,800.00	603,420,000	貸付株式数 3,300株
ソフトバンクグループ	523,500	4,236.00	2,217,546,000	貸付株式数 40,600株
蔵王産業	1,300	1,444.00	1,877,200	
スズケン	28,000	4,890.00	136,920,000	
サンドラッグ	24,900	3,870.00	96,363,000	
サクスパーホールディング	5,600	905.00	5,068,000	
ジェコス	4,600	955.00	4,393,000	貸付株式数 600株
ヤマザワ	1,500	1,666.00	2,499,000	貸付株式数 400株
や ま や	1,400	2,207.00	3,089,800	貸付株式数 500株
グローセル	6,700	456.00	3,055,200	
ベルーナ	14,300	712.00	10,181,600	
合計			162,602,439,840	

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

ソ ニ ー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
三菱UFJフィナンシャルG	200,000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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,781,446	-
コール・ローン	3,464,498	5,188,312
親投資信託受益証券	2,197,794,321	2,352,940,005
流動資産合計	2,203,040,265	2,358,128,317
資産合計	2,203,040,265	2,358,128,317
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,228,009	1,135,269
未払受託者報酬	234,030	246,432
未払委託者報酬	3,335,461	3,512,238
その他未払費用	58,465	62,268
流動負債合計	4,855,965	4,956,207
負債合計	4,855,965	4,956,207
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,924,332,921	1,803,208,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	273,851,379	549,963,489
（分配準備積立金）	58,139,791	296,310,511
元本等合計	2,198,184,300	2,353,172,110
純資産合計	2,198,184,300	2,353,172,110
負債純資産合計	2,203,040,265	2,358,128,317

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日		自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
営業収益				
受取利息		-		5
有価証券売買等損益		2,453,172		316,715,684
営業収益合計		2,453,172		316,715,689
営業費用				
支払利息		3,022		3,241
受託者報酬		403,526		485,725
委託者報酬		5,751,395		6,922,945
その他費用		101,109		122,143
営業費用合計		6,259,052		7,534,054
営業利益又は営業損失（ ）		8,712,224		309,181,635
経常利益又は経常損失（ ）		8,712,224		309,181,635
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,712,224		309,181,635
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		10,155,564		40,059,991
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		155,298,380		273,851,379
剰余金増加額又は欠損金減少額		190,474,884		106,635,362
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		190,474,884		106,635,362
剰余金減少額又は欠損金増加額		53,054,097		99,644,896
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		53,054,097		99,644,896
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		273,851,379		549,963,489

## (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3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,139,363,470円	1,924,332,921円
期中追加設定元本額	1,148,408,392円	570,028,310円
期中一部解約元本額	363,438,941円	691,152,610円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,924,332,921口	1,803,208,621口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(256,062,759円)、投資信託約款に規定される収益調整金(253,655,729円)及び分配準備積立金(40,247,752円)より分配対象額は549,966,240円(1万口当たり3,049.93円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,592,489	290,744,938
合計	4,592,489	290,744,938

## (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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1423円 (11,423円)	1.3050円 (13,050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	1,127,210,887	2,352,940,005	
親投資信託受益証券 合計			2,352,940,005	
合計			2,352,940,005	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	509,287,039	168,607,416
金銭信託	483,926,548	-
コール・ローン	941,124,553	1,859,345,653
株式	35,303,993,367	47,526,836,374
投資証券	970,437,547	1,442,585,740
派生商品評価勘定	14,499,310	44,934,029
未収入金	323,147	3,756,315
未収配当金	67,945,267	81,534,869
差入委託証拠金	661,940,856	438,313,323
流動資産合計	38,953,477,634	51,565,913,719
資産合計	38,953,477,634	51,565,913,719
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	377,280,834	14,026,742
未払金	-	671,432,684
その他未払費用	12,983	1,776
流動負債合計	377,293,817	685,461,202
負債合計	377,293,817	685,461,202
純資産の部		
元本等		
元本	1 21,183,891,958	24,374,861,574
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,392,291,859	26,505,590,943
元本等合計	38,576,183,817	50,880,452,517
純資産合計	38,576,183,817	50,880,452,517
負債純資産合計	38,953,477,634	51,565,913,719

## 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 至 2019年12月2日
----	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	14,973,926,481円	21,183,891,958円
期中追加設定元本額	8,674,912,394円	7,928,013,825円
期中一部解約元本額	2,464,946,917円	4,737,044,209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）	18,413,212,043円	19,758,559,458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）	1,206,916,157円	1,127,210,887円
iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	212,178,578円	450,959,556円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	26,245,147円	- 円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	54,785,252円	- 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）	1,270,554,781円	3,038,131,673円
計	21,183,891,958円	24,374,861,574円
2. 期末日における受益権の総数	21,183,891,958口	24,374,861,574口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
-----	------------------------------

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	1,271,807,298	6,657,866,619
投資証券	13,793,630	197,897,479
合計	1,285,600,928	6,855,764,098

（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（2018年1月11日から2018年11月30日まで、及び2019年1月11日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買 建	2,681,646,444	-	2,636,051,921	45,594,523	1,897,988,165	-	1,941,062,835	43,074,670
合計	2,681,646,444	-	2,636,051,921	45,594,523	1,897,988,165	-	1,941,062,835	43,074,670

## （注） 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株値指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

	2018年11月30日 現在	2019年12月2日 現在

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	36,415,975,016	-	36,733,162,017	317,187,001	49,746,495,589	-	49,758,662,972	12,167,383
アメリカ・ドル	24,935,326,974	-	25,133,324,382	197,997,408	34,459,932,754	-	34,468,961,085	9,028,331
イギリス・ポンド	2,435,684,907	-	2,439,125,952	3,441,045	2,944,929,704	-	2,945,334,552	404,848
イスラエル・ シェケル	43,145,697	-	43,382,738	237,041	66,588,374	-	66,526,112	62,262
オーストラリ ア・ドル	906,669,264	-	940,605,355	33,936,091	1,253,805,486	-	1,254,091,794	286,308
カナダ・ドル	1,316,986,281	-	1,314,493,404	2,492,877	1,779,659,826	-	1,780,472,617	812,791
シンガポー ル・ドル	183,301,554	-	186,704,792	3,403,238	243,343,854	-	243,420,683	76,829
スイス・フラン	1,148,830,400	-	1,168,648,170	19,817,770	1,649,858,436	-	1,649,956,392	97,956
スウェーデ ン・クローナ	394,475,705	-	400,263,705	5,788,000	495,067,378	-	494,937,700	129,678
デンマーク・ クローネ	241,414,152	-	244,036,380	2,622,228	343,572,015	-	343,531,650	40,365
ニュージー ランド・ドル	32,551,226	-	34,412,004	1,860,778	55,227,406	-	55,302,444	75,038
ノルウェー・ クローネ	115,938,512	-	115,028,341	910,171	114,991,308	-	114,923,400	67,908
ユーロ	4,196,728,856	-	4,243,989,294	47,260,438	5,730,251,890	-	5,731,703,963	1,452,073
香港・ドル	464,921,488	-	469,147,500	4,226,012	609,267,158	-	609,500,580	233,422
合計	36,415,975,016	-	36,733,162,017	317,187,001	49,746,495,589	-	49,758,662,972	12,167,383

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.8210円	2.0874円
(1万口当たり純資産額)	(18,210円)	(20,874円)

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	1,100	123.710	136,081.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,198	227.220	272,209.560	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,271	107.030	243,065.130	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	72.760	115,979.440	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	151.120	83,116.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,200	37.410	231,942.000	
	ABBOTT LABORATORIES	20,107	85.450	1,718,143.150	
	ARCONIC INC	3,950	30.960	122,292.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,596	147.480	235,378.080	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,229	62.750	202,619.750	
	AMPHENOL CORP-CL A	3,188	104.000	331,552.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,048	138.150	973,681.200	
	QORVO INC	1,179	104.210	122,863.590	
	AFLAC INC	8,123	54.840	445,465.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,248	118.440	147,813.120		

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	69.810	128,101.350	
ADOBE INC	5,665	309.530	1,753,487.450	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,872	46.210	132,715.120	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,299	225.690	293,171.310	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,409	16.500	72,748.500	
GARMIN LTD	1,318	97.690	128,755.420	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,448	236.330	578,535.840	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,924	178.550	1,414,830.200	
WR BERKLEY CORP	1,771	68.000	120,428.000	
AUTOZONE INC	291	1,177.920	342,774.720	
DOLLAR TREE INC	2,399	91.460	219,412.540	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,683	10.420	100,896.860	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,508	87.390	131,784.120	
CELANESE CORP	1,297	125.570	162,864.290	
DR HORTON INC	4,397	55.350	243,373.950	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,249	30.880	38,569.120	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	56.540	138,523.000	
AUTODESK INC	2,581	180.900	466,902.900	
MOODY'S CORP	1,782	226.670	403,925.940	
DEVON ENERGY CORP	4,868	21.890	106,560.520	
ALBEMARLE CORP	1,668	65.380	109,053.840	
ATMOS ENERGY CORP	1,654	106.960	176,911.840	
ALLIANT ENERGY CORP	2,200	53.000	116,600.000	
CITIGROUP INC	26,351	75.120	1,979,487.120	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,742	170.780	809,838.760	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,657	91.350	516,766.950	
ALLEGHANY CORP	203	780.040	158,348.120	
DOMINO'S PIZZA INC	526	294.300	154,801.800	
HESS CORP	2,896	62.090	179,812.640	
DAVITA INC	1,000	71.770	71,770.000	
DANAHER CORP	7,015	145.980	1,024,049.700	
FORTIVE CORP	3,044	72.170	219,685.480	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,949	94.170	560,217.330	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,093	18.890	77,316.770	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,701	17.300	29,427.300	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,074	42.930	260,756.820	
BUNGE LTD	1,838	53.380	98,112.440	
TE CONNECTIVITY LTD	3,844	92.710	356,377.240	
APPLE INC	50,777	267.250	13,570,153.250	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,359	84.870	285,078.330	
BOEING CO/THE	6,058	366.180	2,218,318.440	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,063	107.050	220,844.150	
BECTON DICKINSON AND CO	3,011	258.500	778,343.500	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,500	21.280	31,920.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	90.840	127,176.000	
CDK GLOBAL INC	1,100	53.550	58,905.000	
NISOURCE INC	4,026	26.450	106,487.700	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,708	76.850	131,259.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,683	48.970	474,176.510	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	46,447	60.240	2,797,967.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	14,492	220.300	3,192,587.600	
ANSYS INC	989	254.690	251,888.410	
BB&T CORP	7,763	54.720	424,791.360	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	7,786	54.220	422,156.920	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	26,266	56.940	1,495,586.040	
JPMORGAN CHASE & CO	36,264	131.760	4,778,144.640	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,759	123.560	340,902.040	
LKQ CORP	3,300	35.280	116,424.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	188.330	103,016.510	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,665	67.820	248,560.300	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,614	70.250	253,883.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,611	163.870	263,994.570	
DOLLAR GENERAL CORP	2,672	157.360	420,465.920	
SERVICENOW INC	2,083	283.040	589,572.320	
CATERPILLAR INC	6,565	144.730	950,152.450	
BROWN & BROWN INC	2,493	37.740	94,085.820	
AQUA AMERICA INC	2,201	44.270	97,438.270	
CMS ENERGY CORP	3,384	61.300	207,439.200	
MOSAIC CO/THE	5,209	19.050	99,231.450	
DELTA AIR LINES INC	1,650	57.310	94,561.500	
CORNING INC	8,399	29.040	243,906.960	
CISCO SYSTEMS INC	48,358	45.310	2,191,100.980	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,265	63.960	80,909.400	

MORGAN STANLEY	13,989	49.480	692,175.720	
WABCO HOLDINGS INC	940	134.750	126,665.000	
MSCI INC	975	259.190	252,710.250	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	255.850	115,132.500	
MIDDLEBY CORP	918	115.760	106,267.680	
COTY INC-CL A	4,757	11.540	54,895.780	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,507	60.050	150,545.350	
BROADCOM INC	4,531	316.210	1,432,747.510	
ACUITY BRANDS INC	350	130.780	45,773.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,416	117.140	165,870.240	
ARAMARK	3,173	43.640	138,469.720	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,612	28.470	45,893.640	
DTE ENERGY COMPANY	1,933	124.940	241,509.020	
CENTENE CORP	5,113	60.470	309,183.110	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,358	118.900	161,466.200	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,532	38.460	212,760.720	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,232	93.270	208,178.640	
GARTNER INC	1,174	160.460	188,380.040	
SPLUNK INC	1,710	149.220	255,166.200	
DOMINION ENERGY INC	8,941	83.110	743,086.510	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,436	59.820	265,361.520	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	48.400	67,760.000	
DEERE & CO	3,362	168.050	564,984.100	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,387	181.100	613,385.700	
VMWARE INC-CLASS A	833	155.620	129,631.460	
BURLINGTON STORES INC	700	225.000	157,500.000	
NASDAQ INC	1,427	104.800	149,549.600	
VAIL RESORTS INC	390	242.670	94,641.300	
EAST WEST BANCORP INC	1,461	45.820	66,943.020	
TARGA RESOURCES CORP	1,633	36.530	59,653.490	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	894	165.460	147,921.240	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	109.710	95,886.540	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	405	68.680	27,815.400	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,648	86.890	316,974.720	
COGNEX CORP	2,439	50.180	122,389.020	
TELEFLEX INC	485	353.340	171,369.900	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	806	115.620	93,189.720	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	852	147.030	125,269.560	
BIO-RAD LABORATORIES-A	300	369.380	110,814.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	500	322.070	161,035.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,570	149.180	234,212.600	
IDEX CORP	700	162.740	113,918.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,132	67.820	619,332.240	
ROLLINS INC	1,050	35.850	37,642.500	
AMETEK INC	2,597	99.010	257,128.970	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,883	70.240	202,501.920	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,000	36.990	36,990.000	
HEICO CORP	535	129.890	69,491.150	
XPO LOGISTICS INC	1,060	82.690	87,651.400	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	398	259.650	103,340.700	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,422	92.540	316,671.880	
TYLER TECHNOLOGIES INC	417	290.170	121,000.890	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,883	299.810	1,463,972.230	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	121.830	137,424.240	
GRUBHUB INC	1,000	43.120	43,120.000	
EPAM SYSTEMS INC	549	211.850	116,305.650	
RPM INTERNATIONAL INC	1,750	73.730	129,027.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	310	813.920	252,315.200	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,800	20.900	58,520.000	
UGI CORP	2,085	43.550	90,801.750	
CUMMINS INC	1,604	182.860	293,307.440	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,714	54.830	477,788.620	
SABRE CORP	4,326	22.430	97,032.180	
CDW CORP/DE	1,792	135.050	242,009.600	
SIGNATURE BANK	769	123.360	94,863.840	
COSTAR GROUP INC	492	612.860	301,527.120	
SVB FINANCIAL GROUP	690	231.730	159,893.700	
AMERCO	70	362.220	25,355.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	826	191.590	158,253.340	
MERCADOLIBRE INC	480	580.580	278,678.400	
HANESBRANDS INC	2,900	15.070	43,703.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	151.940	127,173.780	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,881	105.000	302,505.000	
IPG PHOTONICS CORP	250	142.090	35,522.500	
DEXCOM INC	1,172	227.310	266,407.320	
COPART INC	2,495	89.000	222,055.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,591	77.340	123,047.940	
SEATTLE GENETICS INC	1,545	120.350	185,940.750	
ALIGN TECHNOLOGY INC	963	277.340	267,078.420	
TRANSDIGM GROUP INC	500	567.100	283,550.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,203	116.610	140,281.830	
NIELSEN HOLDINGS PLC	4,347	19.550	84,983.850	
KINDER MORGAN INC	22,594	19.610	443,068.340	
HCA HEALTHCARE INC	3,138	138.660	435,115.080	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	382	403.820	154,259.240	
CABOT OIL & GAS CORP	4,608	15.940	73,451.520	
T-MOBILE US INC	4,203	78.550	330,145.650	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	39.150	69,921.900	
COCA-COLA CO/THE	45,442	53.400	2,426,602.800	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,575	50.460	129,934.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,946	74.760	145,482.960	
EATON VANCE CORP	1,250	47.170	58,962.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	27.490	105,863.990	
CSX CORP	8,151	71.540	583,122.540	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	172.290	180,904.500	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	101.660	158,894.580	
AUTOLIV INC	800	81.720	65,376.000	
AMAZON.COM INC	4,747	1,800.800	8,548,397.600	
FLOWSERVE CORP	1,986	48.700	96,718.200	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,203	244.940	539,602.820	
EXXON MOBIL CORP	47,945	68.130	3,266,492.850	
FLIR SYSTEMS INC	1,613	53.560	86,392.280	
AES CORP	8,341	18.910	157,728.310	
EVEREST RE GROUP LTD	571	271.260	154,889.460	
EOG RESOURCES INC	6,476	70.900	459,148.400	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,914	87.120	166,747.680	
ABIOMED INC	555	196.180	108,879.900	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,989	87.910	174,852.990	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,458	80.770	279,302.660	

FORD MOTOR CO	43,381	9.060	393,031.860	
DISCOVERY INC - A	1,100	32.940	36,234.000	
EXACT SCIENCES CORP	1,721	81.010	139,418.210	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	22.550	54,480.800	
DISCOVERY INC-C	4,554	30.520	138,988.080	
AERCAP HOLDINGS NV	1,824	61.810	112,741.440	
FORTINET INC	1,595	105.110	167,650.450	
MARKEL CORP	158	1,135.550	179,416.900	
NEXTERA ENERGY INC	5,164	233.820	1,207,446.480	
FREEMPORT-MCMORAN INC	15,025	11.380	170,984.500	
INSULET CORP	769	185.700	142,803.300	
US BANCORP	16,520	60.030	991,695.600	
UNITED RENTALS INC	1,055	153.050	161,467.750	
F5 NETWORKS INC	550	145.710	80,140.500	
FASTENAL CO	5,814	35.520	206,513.280	
FISERV INC	6,456	116.240	750,445.440	
GENERAL ELECTRIC CO	98,888	11.270	1,114,467.760	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,149	53.640	115,272.360	
GENERAL MOTORS CO	13,643	36.000	491,148.000	
TRIPADVISOR INC	700	28.400	19,880.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,611	181.740	474,523.140	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,627	221.350	802,836.450	
ALPHABET INC-CL A	3,274	1,304.090	4,269,590.660	
ALPHABET INC-CL C	3,595	1,304.960	4,691,331.200	
OWENS CORNING	1,763	67.060	118,226.780	
GENERAL MILLS INC	6,595	53.320	351,645.400	
FIRSTENERGY CORP	5,661	47.690	269,973.090	
GENUINE PARTS CO	1,770	104.370	184,734.900	
IHS MARKIT LTD	4,211	72.650	305,929.150	
FIFTH THIRD BANCORP	8,100	30.190	244,539.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,409	201.090	484,425.810	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	950	28.740	27,303.000	
HALLIBURTON CO	10,230	20.990	214,727.700	
HOME DEPOT INC	12,415	220.510	2,737,631.650	
ASSURANT INC	840	132.870	111,610.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	9,584	14.890	142,705.760	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	350	251.670	88,084.500	

HERSHEY CO/THE	1,725	148.160	255,576.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	1,400	36.380	50,932.000	
HUMANA INC	1,485	341.230	506,726.550	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,354	115.580	387,655.320	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	172.470	158,154.990	
HENRY SCHEIN INC	1,870	68.900	128,843.000	
HP INC	16,133	20.080	323,950.640	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	13,250	15.830	209,747.500	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,100	48.510	53,361.000	
HOLLYFRONTIER CORP	1,783	51.550	91,913.650	
LIBERTY MEDIA ORP-LIBERTY-C	2,762	45.090	124,538.580	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	48.700	98,763.600	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,011	41.970	210,311.670	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,725	30.500	235,612.500	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,654	134.450	1,297,980.300	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	46.340	187,537.980	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	63.260	94,890.000	
ZOETIS INC	5,145	120.520	620,075.400	
INGERSOLL-RAND PLC	2,548	131.110	334,068.280	
CHENIERE ENERGY INC	2,484	60.540	150,381.360	
ALLEGION PLC	1,110	120.030	133,233.300	
LEGGETT & PLATT INC	1,572	52.320	82,247.040	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	21.500	109,822.000	
WASTE CONNECTIONS INC	2,665	90.550	241,315.750	
JUNIPER NETWORKS INC	4,912	25.060	123,094.720	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	864	112.490	97,191.360	
JM SMUCKER CO/THE	1,393	105.090	146,390.370	
JOHNSON & JOHNSON	29,677	137.490	4,080,290.730	
ABBVIE INC	16,654	87.730	1,461,055.420	
HOLOGIC INC	3,042	51.320	156,115.440	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,932	136.340	536,088.880	
KROGER CO	9,480	27.340	259,183.200	
KLA CORP	1,919	163.860	314,447.340	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,950	391.030	1,153,538.500	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	936	306.920	287,277.120	
LOWE'S COS INC	8,596	117.310	1,008,396.760	

ELI LILLY & CO	9,852	117.350	1,156,132.200	
LAM RESEARCH CORP	1,724	266.830	460,014.920	
JONES LANG LASALLE INC	587	166.330	97,635.710	
LOEWS CORP	3,591	50.900	182,781.900	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,643	59.050	156,069.150	
MCDONALD'S CORP	8,607	194.480	1,673,889.360	
3M CO	6,395	169.770	1,085,679.150	
FACEBOOK INC-CLASS A	27,031	201.640	5,450,530.840	
MANPOWERGROUP INC	650	92.640	60,216.000	
S&P GLOBAL INC	2,618	264.650	692,853.700	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	767	268.400	205,862.800	
CONCHO RESOURCES INC	2,552	72.560	185,173.120	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,900	34.240	65,056.000	
PHILLIPS 66	5,060	114.720	580,483.200	
TECHNIPFMC PLC	4,561	18.840	85,929.240	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,659	31.950	180,805.050	
DXC TECHNOLOGY CO	2,429	37.330	90,674.570	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,375	169.250	232,718.750	
MYLAN NV	4,888	18.780	91,796.640	
METLIFE INC	8,635	49.910	430,972.850	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,617	26.370	227,230.290	
ARISTA NETWORKS INC	593	195.130	115,712.090	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,419	45.020	108,903.380	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,771	167.300	296,288.300	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	284	719.410	204,312.440	
BAKER HUGHES CO	8,446	22.420	189,359.320	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,460	195.840	285,926.400	
MERCK & CO. INC.	28,553	87.180	2,489,250.540	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,320	64.810	539,219.200	
MASCO CORP	3,543	46.550	164,926.650	
M & T BANK CORP	1,323	164.740	217,951.020	
MARSH & MCLENNAN COS	5,585	108.070	603,570.950	
BLACK KNIGHT INC	1,644	63.010	103,588.440	
HEICO CORP-CLASS A	707	100.440	71,011.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,180	140.360	446,344.800	
WORKDAY INC-CLASS A	1,878	179.120	336,387.360	

WAYFAIR INC- CLASS A	600	84.920	50,952.000	
SQUARE INC - A	3,626	69.120	250,629.120	
TRANSUNION	2,029	86.310	175,122.990	
VISTRA ENERGY CORP	4,285	26.530	113,681.050	
CAPRI HOLDINGS LTD	1,100	37.140	40,854.000	
BEIGENE LTD-ADR	350	203.290	71,151.500	
NETAPP INC	2,300	60.590	139,357.000	
NIKE INC -CL B	14,218	93.490	1,329,240.820	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,843	193.500	550,120.500	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,626	94.540	248,262.040	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,749	89.820	157,095.180	
ALLY FINANCIAL INC	5,094	31.840	162,192.960	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,772	351.770	623,336.440	
APTIV PLC	2,680	93.880	251,598.400	
NEWMONT GOLDCORP CORP	9,173	38.400	352,243.200	
MCKESSON CORP	2,161	144.640	312,567.040	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,257	56.670	184,574.190	
XYLEM INC	1,972	77.510	152,849.720	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	17,114	82.930	1,419,264.020	
NUCOR CORP	3,692	56.360	208,081.120	
WESTERN UNION CO	3,600	26.880	96,768.000	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	66.380	128,113.400	
NEWELL BRANDS INC	4,058	19.220	77,994.760	
EVERGY INC	3,243	63.270	205,184.610	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,238	38.570	394,879.660	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	169.300	45,541.700	
OKTA INC	1,010	129.780	131,077.800	
LIBERTY BROADBAND-C	1,350	119.490	161,311.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	27.710	135,141.670	
LINDE PLC	5,796	206.210	1,195,193.160	
WIX.COM LTD	500	120.890	60,445.000	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	6,184	24.740	152,992.160	
KKR & CO INC -A	4,996	29.490	147,332.040	
PAYCHEX INC	3,300	86.120	284,196.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	827	442.280	365,765.560	
ALTRIA GROUP INC	20,729	49.700	1,030,231.300	
PFIZER INC	62,373	38.520	2,402,607.960	
CIGNA CORP	4,050	199.920	809,676.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	1,917	48.490	92,955.330	

ALTICE USA INC- A	1,038	25.580	26,552.040	
XCEL ENERGY INC	5,381	61.490	330,877.690	
STERIS PLC	897	151.140	135,572.580	
FOX CORP - CLASS B	1,530	34.980	53,519.400	
FOX CORP - CLASS A	5,267	35.760	188,347.920	
STRYKER CORP	3,738	204.860	765,766.680	
DOW INC	8,815	53.370	470,456.550	
PARKER HANNIFIN CORP	1,239	198.790	246,300.810	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,648	29.600	48,780.800	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,203	127.840	281,631.520	
POLARIS INC	989	97.700	96,625.300	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	27,825	122.060	3,396,319.500	
EXELON CORP	9,859	44.400	437,739.600	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,652	113.940	302,168.880	
NVR INC	45	3,791.890	170,635.050	
CONOCOPHILLIPS	12,228	59.940	732,946.320	
TWILIO INC - A	1,331	103.280	137,465.680	
DOCUSIGN INC	1,027	71.210	73,132.670	
PAYCOM SOFTWARE INC	491	276.810	135,913.710	
MATCH GROUP INC	928	70.480	65,405.440	
PEPSICO INC	15,620	135.830	2,121,664.600	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	122.550	50,122.950	
DROPBOX INC-CLASS A	2,392	18.490	44,228.080	
MONGODB INC	390	148.700	57,993.000	
SNAP INC - A	6,889	15.250	105,057.250	
CORTEVA INC	7,509	26.020	195,384.180	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,288	93.620	401,442.560	
AMCOR PLC	17,457	10.260	179,108.820	
ROKU INC	939	160.370	150,587.430	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	121.030	253,194.760	
ACCENTURE PLC-CL A	7,280	201.160	1,464,444.800	
PENTAIR PLC	1,575	44.350	69,851.250	
QUALCOMM INC	13,403	83.550	1,119,820.650	
INVESCO LTD	3,700	17.560	64,972.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	819	157.080	128,648.520	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	55.100	175,934.300	
RAYTHEON COMPANY	3,116	217.420	677,480.720	

DISH NETWORK CORP-RTS	161	0.680	109.480	
REGENERON PHARMACEUTICALS	925	369.000	341,325.000	
REPUBLIC SERVICES INC	2,667	88.650	236,429.550	
BOOKING HOLDINGS INC	486	1,904.030	925,358.580	
ROSS STORES INC	4,129	116.150	479,583.350	
PACKAGING CORP OF AMERICA	844	111.900	94,443.600	
RESMED INC	1,383	149.600	206,896.800	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,812	106.550	193,068.600	
ROBERT HALF INTL INC	1,499	58.200	87,241.800	
RALPH LAUREN CORP	400	107.340	42,936.000	
PERKINELMER INC	1,163	92.900	108,042.700	
REGIONS FINANCIAL CORP	9,250	16.640	153,920.000	
CHEVRON CORP	21,352	117.130	2,500,959.760	
EDISON INTERNATIONAL	3,864	69.100	267,002.400	
TESLA INC	1,651	329.940	544,730.940	
NORTONLIFELOCK INC	7,944	24.900	197,805.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,581	157.740	249,386.940	
SYNOPSYS INC	1,582	141.040	223,125.280	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	1,817	470.010	854,008.170	
CBRE GROUP INC - A	3,849	57.020	219,469.980	
TWITTER INC	8,484	30.910	262,240.440	
SOUTHERN CO/THE	11,305	61.990	700,796.950	
SYSCO CORP	4,860	80.550	391,473.000	
TRAVELERS COS INC/THE	2,860	136.720	391,019.200	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,925	64.530	124,220.250	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	33.730	77,579.000	
SCHLUMBERGER LTD	14,999	36.200	542,963.800	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	51.490	104,318.740	
AT&T INC	81,815	37.380	3,058,244.700	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,758	57.640	101,331.120	
ON SEMICONDUCTOR CORP	3,627	21.470	77,871.690	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	834	583.130	486,330.420	
SEMPRA ENERGY	3,160	147.270	465,373.200	
TIFFANY & CO	1,086	133.800	145,306.800	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,349	59.680	140,188.320	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,574	120.210	1,271,100.540	
SALESFORCE.COM INC	9,620	162.890	1,567,001.800	

WESTROCK CO	2,321	40.330	93,605.930	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,906	42.830	424,273.980	
TERADYNE INC	2,096	62.590	131,188.640	
UNION PACIFIC CORP	8,049	175.990	1,416,543.510	
MARATHON OIL CORP	10,244	11.650	119,342.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	7,061	60.640	428,179.040	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	9,033	148.340	1,339,955.220	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,087	119.730	968,256.510	
UNUM GROUP	1,900	30.740	58,406.000	
SPRINT CORP	11,474	5.920	67,926.080	
IQVIA HOLDINGS INC	1,781	145.980	259,990.380	
VOYA FINANCIAL INC	1,800	58.280	104,904.000	
AMEREN CORPORATION	2,861	74.330	212,658.130	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,726	279.870	3,001,885.620	
VERISIGN INC	1,085	190.740	206,952.900	
VALERO ENERGY CORP	4,540	95.490	433,524.600	
ULTA BEAUTY INC	635	233.860	148,501.100	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	47.630	143,271.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	992	139.490	138,374.080	
ANTHEM INC	2,908	288.660	839,423.280	
WALT DISNEY CO/THE	20,184	151.580	3,059,490.720	
WELLS FARGO & CO	47,667	54.460	2,595,944.820	
WASTE MANAGEMENT INC	4,690	112.910	529,547.900	
WILLIAMS COS INC	12,523	22.720	284,522.560	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,591	94.440	150,254.040	
WHIRLPOOL CORP	870	143.100	124,497.000	
WALMART INC	15,896	119.090	1,893,054.640	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	900	86.990	78,291.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,365	145.280	343,587.200	
WYNN RESORTS LTD	1,145	120.850	138,373.250	
XEROX HOLDINGS CORP	1,988	38.930	77,392.840	
WABTEC CORP	1,898	78.570	149,125.860	
TJX COMPANIES INC	13,181	61.130	805,754.530	
WATERS CORP	650	222.070	144,345.500	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	992	92.800	92,057.600	
ALLERGAN PLC	3,847	184.940	711,464.180	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	555	250.940	139,271.700	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,976	59.600	534,969.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,511	196.440	296,820.840	
WESTERN DIGITAL CORP	3,531	50.330	177,715.230	
WEC ENERGY GROUP INC	3,467	88.650	307,349.550	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,077	59.310	301,116.870	
VISA INC-CLASS A SHARES	19,327	184.510	3,566,024.770	
PPL CORP	7,394	34.030	251,617.820	
PULTEGROUP INC	3,556	39.650	140,995.400	
PPG INDUSTRIES INC	2,434	128.840	313,596.560	
NORTHERN TRUST CORP	2,062	107.240	221,128.880	
NVIDIA CORP	6,391	216.740	1,385,185.340	
IAC/INTERACTIVECORP	859	222.700	191,299.300	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,994	153.210	765,130.740	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	2,482	39.820	98,833.240	
TYSON FOODS INC-CL A	3,211	89.890	288,636.790	
NETFLIX INC	5,012	314.660	1,577,075.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,393	313.950	1,379,182.350	
NRG ENERGY INC	3,000	39.730	119,190.000	
GLOBE LIFE INC	1,215	102.760	124,853.400	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,856	109.900	203,974.400	
TEXTRON INC	2,210	46.240	102,190.400	
NEWS CORP - CLASS A	7,999	12.880	103,027.120	
OGE ENERGY CORP	2,452	42.060	103,131.120	
OMNICOM GROUP	2,546	79.480	202,356.080	
ORACLE CORP	26,118	56.140	1,466,264.520	
MASTERCARD INC - A	10,141	292.230	2,963,504.430	
ONEOK INC	4,566	71.050	324,414.300	
CENTURYLINK INC	9,747	14.490	141,234.030	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,269	360.370	457,309.530	
YUM! BRANDS INC	3,271	100.670	329,291.570	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,191	121.350	144,527.850	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	400	106.910	42,764.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,775	50.480	89,602.000	

NOBLE ENERGY INC	6,274	20.760	130,248.240	
BANK OF AMERICA CORP	101,268	33.320	3,374,249.760	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	418	341.990	142,951.820	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,127	80.710	171,670.170	
NORDSTROM INC	800	38.170	30,536.000	
AMERICAN EXPRESS CO	7,262	120.120	872,311.440	
ANALOG DEVICES INC	3,930	112.950	443,893.500	
ADVANCED MICRO DEVICES	11,447	39.150	448,150.050	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,480	51.830	180,368.400	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,460	52.660	498,163.600	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,283	98.300	224,418.900	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,784	120.020	214,115.680	
AVERY DENNISON CORP	1,131	130.370	147,448.470	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,207	64.110	397,930.770	
EMERSON ELECTRIC CO	6,346	73.860	468,715.560	
AON PLC	2,641	203.610	537,734.010	
AMGEN INC	6,670	234.720	1,565,582.400	
TAPESTRY INC	2,550	26.890	68,569.500	
EATON CORP PLC	4,803	92.500	444,277.500	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,784	186.060	331,931.040	
APPLIED MATERIALS INC	10,264	57.900	594,285.600	
CME GROUP INC	4,137	202.730	838,694.010	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,389	22.550	76,421.950	
ECOLAB INC	2,912	186.670	543,583.040	
EQUIFAX INC	1,256	139.640	175,387.840	
GAP INC/THE	2,820	16.610	46,840.200	
GILEAD SCIENCES INC	14,404	67.240	968,524.960	
HORMEL FOODS CORP	3,315	44.530	147,616.950	
STATE STREET CORP	3,948	75.100	296,494.800	
SUNTRUST BANKS INC	4,615	70.840	326,926.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	12,807	49.500	633,946.500	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,175	81.970	424,194.750	
CAMPBELL SOUP CO	1,300	46.570	60,541.000	
CROWN HOLDINGS INC	1,145	75.900	86,905.500	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	55.030	182,644.570	
FEDEX CORP	2,893	160.050	463,024.650	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,181	100.010	518,151.810	
FMC CORP	1,142	97.960	111,870.320	

FLEX LTD	4,500	11.870	53,415.000	
CERNER CORP	4,133	71.590	295,881.470	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,163	141.230	164,250.490	
CITRIX SYSTEMS INC	1,350	112.810	152,293.500	
INTEL CORP	49,706	58.050	2,885,433.300	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,231	22.400	117,174.400	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,866	61.860	301,010.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,591	174.330	626,019.030	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	6.980	106,794.000	
ILLUMINA INC	1,654	320.760	530,537.040	
SEALED AIR CORP	1,450	37.730	54,708.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,238	592.900	734,010.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,790	117.880	211,005.200	
SNAP-ON INC	500	160.460	80,230.000	
CARMAX INC	1,990	97.260	193,547.400	
COMERICA INC	1,187	70.410	83,576.670	
INGREDION INC	530	83.170	44,080.100	
DUKE ENERGY CORP	8,201	88.170	723,082.170	
TARGET CORP	5,574	125.010	696,805.740	
DOVER CORP	1,713	111.480	190,965.240	
WW GRAINGER INC	588	316.950	186,366.600	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,750	92.090	161,157.500	
CINTAS CORP	995	257.060	255,774.700	
CONAGRA BRANDS INC	5,567	28.870	160,719.290	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,500	83.980	125,970.000	
CLOROX COMPANY	1,278	148.230	189,437.940	
ENTERGY CORP	2,114	116.390	246,048.460	
MICROSOFT CORP	80,983	151.380	12,259,206.540	
INCYTE CORP	1,993	94.160	187,660.880	
CVS HEALTH CORP	14,772	75.270	1,111,888.440	
MEDTRONIC PLC	14,877	111.390	1,657,149.030	
MICRON TECHNOLOGY INC	12,991	47.510	617,202.410	
BLACKROCK INC	1,360	494.910	673,077.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	5,636	24.560	138,420.160	
HASBRO INC	1,449	101.700	147,363.300	
KELLOGG CO	2,620	65.120	170,614.400	
KEYCORP	11,782	19.390	228,452.980	

KANSAS CITY SOUTHERN	1,176	152.420	179,245.920	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	16,575	52.540	870,850.500	
KOHL'S CORP	1,650	47.010	77,566.500	
COOPER COS INC/THE	572	313.090	179,087.480	
APACHE CORP	3,673	22.280	81,834.440	
CHUBB LTD	5,052	151.480	765,276.960	
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	79.640	79,640.000	
ALLSTATE CORP	3,999	111.350	445,288.650	
EBAY INC	9,053	35.520	321,562.560	
PAYPAL HOLDINGS INC	12,927	108.010	1,396,245.270	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,283	78.370	100,548.710	
XILINX INC	2,583	92.780	239,650.740	
DISH NETWORK CORP-A	2,984	34.170	101,963.280	
ZIONS BANCORP NA	1,900	49.780	94,582.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,340	195.470	457,399.800	
TRIMBLE INC	2,200	40.530	89,166.000	
LENNAR CORP-A	3,394	59.650	202,452.100	
LEAR CORP	600	120.310	72,186.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,917	44.300	173,523.100	
PROGRESSIVE CORP	6,474	73.050	472,925.700	
PACCAR INC	3,525	81.370	286,829.250	
PVH CORP	618	96.960	59,921.280	
BIOGEN INC	2,130	299.810	638,595.300	
IDEXX LABORATORIES INC	937	251.580	235,730.460	
STARBUCKS CORP	13,062	85.430	1,115,886.660	
PTC INC	1,200	76.600	91,920.000	
PERRIGO CO PLC	1,929	51.230	98,822.670	
EVERSOURCE ENERGY	3,423	82.640	282,876.720	
INTUIT INC	2,846	258.890	736,800.940	
BORGWARNER INC	3,081	42.050	129,556.050	
BEST BUY CO INC	2,300	80.640	185,472.000	
BALL CORP	3,580	66.060	236,494.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,247	43.250	702,682.750	
ELECTRONIC ARTS INC	3,677	101.010	371,413.770	
VULCAN MATERIALS CO	1,606	141.870	227,843.220	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,856	221.750	633,318.000	
VF CORP	3,882	88.540	343,712.280	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	3,903	40.380	157,603.140	

	VIACOM INC-CLASS B	3,071	24.070	73,918.970	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	942	139.370	131,286.540	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,003	133.730	134,131.190	
	CARNIVAL CORP	4,992	45.080	225,039.360	
	COMCAST CORP-CLASS A	51,046	44.150	2,253,680.900	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	31.750	66,675.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	56.220	123,684.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	5,600	5.850	32,760.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,100	5.500	127,050.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 300,306,561.940 (32,937,623,713)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	TUI AG-DI	4,802	10.635	51,069.270	
	BP PLC	230,965	4.802	1,109,093.930	
	UNILEVER PLC	12,091	45.780	553,525.980	
	BARCLAYS PLC	180,173	1.715	309,068.760	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	17,745	7.116	126,273.420	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	32,428	1.943	63,023.810	
	PRUDENTIAL PLC	30,322	13.765	417,382.330	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	50,836	2.262	114,991.030	
	EVRAZ PLC	7,441	3.704	27,561.460	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	28.740	50,524.920	
	BAE SYSTEMS PLC	37,796	5.734	216,722.260	
	AVIVA PLC	44,349	4.038	179,081.260	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	45.580	51,961.200	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	54,629	17.540	958,192.660	
	INFORMA PLC	16,200	7.914	128,206.800	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	4,204	11.328	47,622.910	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	64,335	2.296	147,713.160	
	AUTO TRADER GROUP PLC	14,499	5.620	81,484.380	
	DCC PLC	938	66.080	61,983.040	
	OCADO GROUP PLC	4,417	13.250	58,525.250	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	89.250	66,045.000	
	HALMA PLC	3,978	21.060	83,776.680	
	GVC HOLDINGS PLC	8,805	8.516	74,983.380	
	NMC HEALTH PLC	975	25.090	24,462.750	

JD SPORTS FASHION PLC	6,411	7.606	48,762.060	
M&G PLC	25,964	2.360	61,275.040	
RELX PLC	20,260	18.730	379,469.800	
DIAGEO PLC	26,694	31.650	844,865.100	
RIO TINTO PLC	12,542	42.015	526,952.130	
STANDARD CHARTERED PLC	29,745	6.974	207,441.630	
TESCO PLC	109,310	2.294	250,757.140	
SMITH & NEPHEW PLC	11,297	17.310	195,551.070	
GLENCORE PLC	123,514	2.439	301,250.640	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	18.550	59,360.000	
SMITHS GROUP PLC	4,080	16.610	67,768.800	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	10,963	3.054	33,481.000	
PEARSON PLC	8,271	6.466	53,480.280	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.143	37,783.230	
NEXT PLC	1,159	67.580	78,325.220	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.742	56,171.230	
WHITBREAD PLC	1,785	46.010	82,127.850	
BUNZL PLC	3,159	21.230	67,065.570	
VODAFONE GROUP PLC	303,498	1.533	465,444.530	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,749	49.800	87,100.200	
KINGFISHER PLC	17,229	2.099	36,163.670	
WPP PLC	13,021	10.005	130,275.100	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	8.534	70,354.290	
SEVERN TRENT PLC	1,300	22.430	29,159.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	17,758	4.449	79,005.340	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,082	60.660	490,254.120	
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	10.885	53,151.450	
SCHRODERS PLC	1,227	32.990	40,478.730	
SSE PLC	12,460	13.000	161,980.000	
WEIR GROUP PLC/THE	3,942	13.955	55,010.610	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	6.668	82,469.820	
ASTRAZENECA PLC	14,404	74.580	1,074,250.320	
FERGUSON PLC	2,724	67.220	183,107.280	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.809	191,663.680	
3I GROUP PLC	13,293	10.710	142,368.030	
ASHTED GROUP PLC	5,921	23.500	139,143.500	
SAGE GROUP PLC/THE	9,725	7.538	73,307.050	
NATIONAL GRID PLC	35,713	8.897	317,738.560	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	734,913	0.611	449,399.290	

	RSA INSURANCE GROUP PLC	12,586	5.514	69,399.200	
	IMPERIAL BRANDS PLC	10,229	17.032	174,220.320	
	CENTRICA PLC	68,002	0.802	54,551.200	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,963	45.860	90,023.180	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	25,503	30.600	780,391.800	
	BHP GROUP PLC	26,142	17.100	447,028.200	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,964	25.690	127,525.160	
	HSBC HOLDINGS PLC	233,346	5.763	1,344,772.990	
	ANGLO AMERICAN PLC	10,745	20.265	217,747.420	
	MONDI PLC	5,921	16.755	99,206.350	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	39,167	1.983	77,668.160	
	CARNIVAL PLC	1,383	32.530	44,988.990	
	EASYJET PLC	1,644	13.380	21,996.720	
	COMPASS GROUP PLC	16,481	18.945	312,232.540	
	PERSIMMON PLC	2,569	25.580	65,715.020	
	BT GROUP PLC	85,624	1.915	164,021.330	
	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	25.790	66,383.460	
	BURBERRY GROUP PLC	5,136	21.040	108,061.440	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,182	50.070	109,252.740	
	INTERTEK GROUP PLC	1,592	55.160	87,814.720	
	ITV PLC	27,587	1.451	40,028.730	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,441	68.720	236,465.520	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	47,742	22.110	1,055,575.620	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	42,867	21.895	938,572.960	
	MEGGITT PLC	9,925	6.430	63,817.750	
	G4S PLC	11,320	2.091	23,670.120	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	21.400	33,598.000	
	ANTOFAGASTA PLC	3,460	8.680	30,032.800	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	33,046	3.169	104,722.770	
	EXPERIAN PLC	9,319	25.630	238,845.970	
	イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 19,935,319.180 (2,822,641,843)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	12,000	15.900	190,800.000	
	AZRIELI GROUP LTD	530	272.700	144,531.000	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	11,096	15.960	177,092.160	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	565.100	169,530.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	27.650	419,174.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,043	24.910	474,361.130	
	NICE LTD	800	520.000	416,000.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 1,991,488.290 (62,851,370)	
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	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	22,824	3.260	74,406.240	
	BHP GROUP LTD	31,805	38.230	1,215,905.150	
	SOUTH32 LTD	56,387	2.700	152,244.900	
	ALUMINA LTD	36,217	2.310	83,661.270	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	9,576	34.510	330,467.760	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,554	9.730	199,990.420	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,600	10.030	36,108.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	29,731	25.890	769,735.590	
	WESTPAC BANKING CORP	36,811	24.520	902,605.720	
	SANTOS LTD	18,270	8.150	148,900.500	
	AUSNET SERVICES	28,500	1.740	49,590.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	30,772	24.840	764,376.480	
	RIO TINTO LTD	4,169	96.900	403,976.100	
	ORIGIN ENERGY LTD	20,968	8.700	182,421.600	
	AURIZON HOLDINGS LTD	29,047	5.780	167,891.660	
	COLES GROUP LTD	16,696	16.260	271,476.960	
	OIL SEARCH LTD	15,418	7.440	114,709.920	
	SEEK LTD	2,600	23.190	60,294.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	10,173	18.700	190,235.100	
	NEWCREST MINING LTD	8,420	30.760	258,999.200	
	INCITEC PIVOT LTD	20,400	3.230	65,892.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,845	80.820	1,523,052.900	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	2,000	34.560	69,120.000	
	ORICA LTD	5,845	23.780	138,994.100	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	12.680	194,612.640	
	CIMIC GROUP LTD	1,000	33.640	33,640.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	14,056	39.760	558,866.560	
	COCA-COLA AMATIL LTD	2,600	11.380	29,588.000	

	TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	4.790	83,116.080	
	CROWN RESORTS LTD	3,000	12.910	38,730.000	
	TELSTRA CORP LTD	35,114	3.860	135,540.040	
	AMP LTD	24,935	1.955	48,747.920	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,733	28.960	194,987.680	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,129	138.050	431,958.450	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,163	33.920	209,048.960	
	CSL LTD	5,473	283.480	1,551,486.040	
	WESFARMERS LTD	15,753	42.370	667,454.610	
	COCHLEAR LTD	805	233.990	188,361.950	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,092	14.550	103,188.600	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	13.380	194,063.520	
	BORAL LTD	8,600	5.140	44,204.000	
	ASX LTD	2,260	81.710	184,664.600	
	COMPUTERSHARE LTD	2,061	17.730	36,541.530	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	7.890	213,795.330	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	30.120	157,316.760	
	CHALLENGER LTD	6,300	8.140	51,282.000	
	WORLEY LTD	7,187	15.000	107,805.000	
	AGL ENERGY LTD	8,466	20.410	172,791.060	
	BRAMBLES LTD	18,337	12.550	230,129.350	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	800	44.030	35,224.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	72.980	150,630.720	
	REA GROUP LTD	608	104.360	63,450.880	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,551	52.490	81,411.990	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 14,367,693.840 (1,066,801,267)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	33.260	76,498.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	250	1,420.010	355,002.500	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,438	13.700	33,400.600	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	2,121	87.270	185,099.670	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,200	36.500	153,300.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,700	136.970	232,849.000	
	BCE INC	900	63.940	57,546.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,200	130.670	287,474.000	

SUNCOR ENERGY INC	17,212	41.430	713,093.160	
METRO INC/CN	3,000	58.180	174,540.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,300	71.150	234,795.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	13,000	74.940	974,220.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,400	115.460	508,024.000	
TORONTO-DOMINION BANK	18,900	76.590	1,447,551.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,900	33.450	130,455.000	
ROYAL BANK OF CANADA	16,600	108.730	1,804,918.000	
TC ENERGY CORP	8,800	67.200	591,360.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	5,571	46.380	258,382.980	
BOMBARDIER INC-B	19,200	1.970	37,824.000	
BARRICK GOLD CORP	17,400	22.180	385,932.000	
CAE INC	2,300	35.690	82,087.000	
THOMSON REUTERS CORP	1,833	92.880	170,249.040	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	35.570	64,026.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	600	57.770	34,662.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,000	56.810	56,810.000	
HYDRO ONE LTD	4,800	25.020	120,096.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,489	71.600	178,212.400	
WSP GLOBAL INC	1,200	85.730	102,876.000	
PARKLAND FUEL CORP	2,800	47.220	132,216.000	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	32.940	75,762.000	
EMERA INC	2,500	54.620	136,550.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	39.060	39,060.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,900	64.420	251,238.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,900	78.920	228,868.000	
STARS GROUP INC/THE	3,500	31.830	111,405.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	7,000	18.630	130,410.000	
AIR CANADA	1,700	50.050	85,085.000	
KINROSS GOLD CORP	10,534	5.740	60,465.160	
BANK OF MONTREAL	6,600	102.220	674,652.000	
POWER CORP OF CANADA	3,100	32.240	99,944.000	
METHANEX CORP	600	49.430	29,658.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,000	445.450	445,450.000	
NUTRIEN LTD	6,027	62.700	377,892.900	
AURORA CANNABIS INC	7,000	3.320	23,240.000	
CANOPY GROWTH CORP	2,000	24.510	49,020.000	
CRONOS GROUP INC	3,400	9.030	30,702.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,200	55.790	122,738.000	

CAMECO CORP	2,800	12.100	33,880.000	
TELUS CORP	300	50.150	15,045.000	
POWER FINANCIAL CORP	2,000	32.480	64,960.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	20.800	91,520.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	400	154.760	61,904.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	11,700	37.110	434,187.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	600.010	180,003.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,100	73.180	226,858.000	
WESTON (GEORGE) LTD	901	108.040	97,344.040	
BLACKBERRY LTD	6,400	7.330	46,912.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,500	60.610	393,965.000	
ENBRIDGE INC	21,300	50.300	1,071,390.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	9,000	76.850	691,650.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	20,200	26.130	527,826.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,300	37.520	161,336.000	
ENCANA CORP	15,200	5.210	79,192.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,800	314.570	566,226.000	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	68.000	74,800.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,800	39.000	109,200.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,100	120.610	856,331.000	
CGI INC - CLASS A	2,800	110.070	308,196.000	
HUSKY ENERGY INC	3,012	9.670	29,126.040	
ONEX CORPORATION	1,600	79.100	126,560.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,800	27.450	186,660.000	
IGM FINANCIAL INC	300	38.200	11,460.000	
OPEN TEXT CORP	2,700	57.830	156,141.000	
CI FINANCIAL CORP	2,000	20.920	41,840.000	
SAPUTO INC	2,900	40.150	116,435.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	12.150	76,545.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,000	43.460	391,140.000	
FORTIS INC	4,200	52.040	218,568.000	
LUNDIN MINING CORP	6,600	7.190	47,454.000	
CENOVUS ENERGY INC	14,100	11.740	165,534.000	
DOLLARAMA INC	2,700	48.590	131,193.000	
ATCO LTD -CLASS I	800	50.390	40,312.000	
ALTAGAS LTD	4,700	19.700	92,590.000	
FIRST CAPITAL REALTY INC	2,000	21.580	43,160.000	

	KEYERA CORP	2,200	32.410	71,302.000	
	INTER PIPELINE LTD	4,800	22.000	105,600.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 20,699,984.490 (1,710,232,719)	
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	12,900	25.820	333,078.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,100	25.250	532,775.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,100	9.190	65,249.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.720	116,256.000	
	UOL GROUP LTD	16,600	7.760	128,816.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	10.340	53,768.000	
	CAPITALAND LTD	33,400	3.680	122,912.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	27,000	1.030	27,810.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	12,000	2.200	26,400.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	900	30.640	27,576.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,800	10.780	375,144.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.925	41,625.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	15.870	50,784.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	92,400	3.380	312,312.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	4.130	58,233.000	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	4,000	2.190	8,760.000	
	SATS LTD	7,700	4.980	38,346.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	16,800	8.850	148,680.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	36,900	2.350	86,715.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	4.090	64,622.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 2,619,861.000 (210,139,051)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	830	97.580	80,991.400	
	UBS GROUP AG-REG	42,577	12.120	516,033.240	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	130	620.500	80,665.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	61.820	108,432.280	

ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	7,624	308.200	2,349,716.800	
PARGESA HOLDING SA-BR	389	78.900	30,692.100	
SIKA AG-REG	1,140	174.050	198,417.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	85,300.000	85,300.000	
ABB LTD-REG	20,623	21.870	451,025.010	
SWISS RE AG	3,666	108.300	397,027.800	
NESTLE SA-REG	33,545	103.920	3,485,996.400	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	234	843.200	197,308.800	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	531	249.300	132,378.300	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,122	13.105	394,748.810	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,198	47.080	103,481.840	
SGS SA-REG	65	2,602.000	169,130.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	153	239.200	36,597.600	
VIFOR PHARMA AG	665	178.300	118,569.500	
TEMENOS AG - REG	793	151.700	120,298.100	
ALCON INC	4,249	55.210	234,587.290	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	500	280.000	140,000.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,492	392.300	585,311.600	
BALOISE HOLDING AG - REG	611	173.800	106,191.800	
CLARIANT AG-REG	1,568	20.660	32,394.880	
NOVARTIS AG-REG	23,462	92.060	2,159,911.720	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	20	2,010.000	40,200.000	
CIE FINANCIERE RICHEMONT- REG	5,428	76.160	413,396.480	
SWISSCOM AG-REG	276	517.600	142,857.600	
GEBERIT AG-REG	456	536.800	244,780.800	
GIVAUDAN-REG	89	2,939.000	261,571.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	962.000	106,782.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	563	228.300	128,532.900	
LONZA GROUP AG-REG	855	339.600	290,358.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	53.300	23,985.000	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4,770	51.560	245,941.200	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	381	495.800	188,899.800	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	495	162.600	80,487.000	
SWISS PRIME SITE-REG	946	105.600	99,897.600	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	17	7,625.000	129,625.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 14,712,521.650	

			(1,612,345,246)
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	418.000	292,600.000
ERICSSON LM-B SHS	40,381	86.300	3,484,880.300
VOLVO AB-B SHS	18,158	148.050	2,688,291.900
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	777	428.400	332,866.800
SKF AB-B SHARES	4,000	182.900	731,600.000
ELECTROLUX AB-SER B	2,600	246.100	639,860.000
SWEDISH MATCH AB	2,188	458.700	1,003,635.600
TELE2 AB-B SHS	7,026	141.300	992,773.800
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	19,697	82.120	1,617,517.640
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,526	94.000	1,553,444.000
SWEDBANK AB - A SHARES	9,075	124.700	1,131,652.500
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,039	184.840	1,670,768.760
SKANSKA AB-B SHS	3,709	211.600	784,824.400
SANDVIK AB	13,281	174.150	2,312,886.150
INVESTOR AB-B SHS	6,290	506.200	3,183,998.000
ATLAS COPCO AB-A SHS	7,668	350.900	2,690,701.200
SECURITAS AB-B SHS	2,500	158.800	397,000.000
TELIA CO AB	36,421	41.450	1,509,650.450
ALFA LAVAL AB	4,840	235.600	1,140,304.000
ATLAS COPCO AB-B SHS	3,811	309.600	1,179,885.600
ASSA ABLOY AB-B	10,882	227.400	2,474,566.800
LUNDBERGS AB-B SHS	948	379.600	359,860.800
LUNDIN PETROLEUM AB	1,900	295.200	560,880.000
ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,747	301.000	2,030,847.000
BOLIDEN AB	3,171	247.000	783,237.000
EPIROC AB-A	6,982	111.800	780,587.600
EPIROC AB-B	2,500	107.650	269,125.000
HUSQVARNA AB-B SHS	2,400	74.780	179,472.000
NORDEA BANK ABP	34,548	67.830	2,343,390.840
KINNEVIK AB - B	3,641	219.300	798,471.300
HEXAGON AB-B SHS	3,868	541.400	2,094,135.200
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	222.100	288,730.000
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 42,302,444.640 (484,786,016)

デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	21,028	381.200	8,015,873.600	
	DANSKE BANK A/S	7,236	91.560	662,528.160	
	ISS A/S	1,320	155.650	205,458.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	30	8,805.000	264,150.000	
	H LUNDBECK A/S	500	259.800	129,900.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,857	645.400	1,198,507.800	
	CARLSBERG AS-B	1,232	975.600	1,201,939.200	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,981	324.000	965,844.000	
	COLOPLAST-B	1,519	801.200	1,217,022.800	
	DSV PANALPINA A/S	2,798	738.400	2,066,043.200	
	DEMANT A/S	1,314	207.500	272,655.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	9,478.000	625,548.000	
	TRYG A/S	1,700	195.000	331,500.000	
	PANDORA A/S	750	273.000	204,750.000	
CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	515.000	649,930.000		
GENMAB A/S	733	1,580.000	1,158,140.000		
ORSTED A/S	2,276	625.000	1,422,500.000		
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 20,592,289.760 (332,977,326)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	4.710	70,650.000	
	MERCURY NZ LTD	21,705	4.800	104,184.000	
	A2 MILK CO LTD	7,000	15.520	108,640.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	4.540	76,544.400	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,100	9.030	73,143.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	14,526	5.230	75,970.980	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	9,200	22.150	203,780.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	15.100	66,726.900		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 779,639.280 (55,065,923)	
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	32.600	425,430.000		

	DNB ASA	8,545	154.800	1,322,766.000	
	ORKLA ASA	13,784	89.260	1,230,359.840	
	TELENOR ASA	8,746	168.200	1,471,077.200	
	EQUINOR ASA	11,121	169.800	1,888,345.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,756	347.500	957,710.000	
	MOWI ASA	4,677	228.600	1,069,162.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	173.450	346,900.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	237.600	403,920.000	
	AKER BP ASA	1,306	264.300	345,175.800	
	ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 9,460,846.840 (112,584,077)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	10,078	68.700	692,358.600	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	26.340	47,412.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,967	6.544	150,296.040	
	COMMERZBANK AG	9,689	5.261	50,973.820	
	VOLKSWAGEN AG	420	173.150	72,723.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	2,121	175.480	372,193.080	
	SIEMENS AG-REG	8,221	117.120	962,843.520	
	E.ON SE	27,697	9.498	263,066.100	
	UNIPER SE	1,380	29.300	40,434.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,921	73.300	214,109.300	
	GEA GROUP AG	1,300	29.170	37,921.000	
	CONTINENTAL AG	1,180	118.600	139,948.000	
	BASF SE	11,283	68.220	769,726.260	
	ALLIANZ SE-REG	4,548	217.350	988,507.800	
	THYSSENKRUPP AG	4,030	11.380	45,861.400	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,857	95.880	178,049.160	
	RWE AG	7,526	26.910	202,524.660	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	17.220	29,274.000	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	560	77.320	43,299.200	
	BRENNTAG AG	1,436	48.410	69,516.760	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	49.640	240,009.400	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	30.750	29,489.250	
	HOCHTIEF AG	166	111.500	18,509.000	
	SAP SE	10,471	123.480	1,292,959.080	

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,704	260.600	444,062.400
ZALANDO SE	2,025	39.100	79,177.500
HEIDELBERGCEMENT AG	2,128	67.100	142,788.800
KION GROUP AG	600	60.220	36,132.000
WIRECARD AG	1,367	119.800	163,766.600
COVESTRO AG	1,945	42.500	82,662.500
SARTORIUS AG-VORZUG	305	191.300	58,346.500
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,102	67.180	141,212.360
DELIVERY HERO SE	1,056	48.000	50,688.000
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	111.000	62,160.000
METRO AG	1,500	14.625	21,937.500
AROWNTOWN SA	16,064	7.882	126,616.440
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,500	44.020	66,030.000
KNORR-BREMSE AG	549	88.280	48,465.720
BEIERSDORF AG	1,275	105.850	134,958.750
FUCHS PETROLUB SE -PREF	700	39.200	27,440.000
MERCK KGAA	1,692	106.000	179,352.000
ADIDAS AG	1,980	282.750	559,845.000
PUMA SE	1,295	68.200	88,319.000
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	87.800	115,105.800
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,369	15.236	554,118.080
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,271	66.560	151,157.760
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,852	51.200	504,422.400
QIAGEN N.V.	2,521	38.860	97,966.060
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,044	19.388	252,897.070
HANNOVER RUECK SE	644	168.500	108,514.000
DEUTSCHE POST AG-REG	10,676	33.840	361,275.840
DEUTSCHE BOERSE AG	1,804	139.250	251,207.000
LANXESS AG	1,529	60.500	92,504.500
MTU AERO ENGINES AG	666	245.900	163,769.400
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,796	35.450	170,018.200
SYMRISE AG	1,436	88.040	126,425.440
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.771	17,291.040
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	900	56.000	50,400.000
VONOVIA SE	5,763	47.290	272,532.270
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,309	42.145	392,327.800

NN GROUP NV	3,100	34.840	108,004.000
ARCELORMITTAL	8,031	15.528	124,705.360
HEINEKEN NV	2,910	94.040	273,656.400
AEGON NV	14,361	4.092	58,765.210
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	13,107	23.385	306,507.190
AKZO NOBEL N.V.	2,504	86.920	217,647.680
KONINKLIJKE DSM NV	1,938	116.300	225,389.400
WOLTERS KLUWER	3,097	65.160	201,800.520
ING GROEP NV	43,286	10.444	452,078.980
KONINKLIJKE KPN NV	29,549	2.796	82,619.000
ASML HOLDING NV	4,653	247.000	1,149,291.000
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,453	15.490	53,486.970
GALAPAGOS NV	557	178.850	99,619.450
ADYEN NV	150	696.200	104,430.000
UNILEVER NV	16,682	53.800	897,491.600
PROSUS NV	5,494	61.870	339,913.780
VOPAK	630	48.390	30,485.700
RANDSTAD NV	2,020	52.860	106,777.200
HEINEKEN HOLDING NV	1,100	87.000	95,700.000
ALTICE EUROPE NV	11,295	5.402	61,015.590
JCDECAUX SA	845	26.000	21,970.000
TOTAL SA	25,519	47.640	1,215,725.160
MICHELIN (CGDE)	1,861	108.900	202,662.900
AIR LIQUIDE SA	5,210	123.050	641,090.500
KERING	824	546.700	450,480.800
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,892	87.600	516,139.200
BOUYGUES SA	1,892	37.080	70,155.360
BNP PARIBAS	12,269	50.970	625,350.930
PEUGEOT SA	6,497	21.920	142,414.240
NATIXIS	7,674	3.793	29,107.480
THALES SA	1,404	88.920	124,843.680
DANONE	6,494	74.720	485,231.680
CARREFOUR SA	8,022	14.980	120,169.560
SUEZ	2,950	13.435	39,633.250
VIVENDI	10,430	24.920	259,915.600
L'OREAL	2,741	258.700	709,096.700
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,849	36.750	214,950.750
LEGRAND SA	3,042	71.680	218,050.560

CASINO GUICHARD PERRACHON	200	39.940	7,988.000	
PERNOD RICARD SA	2,632	166.700	438,754.400	
EURAZEO SE	560	61.850	34,636.000	
SOCIETE GENERALE SA	8,065	28.560	230,336.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,988	407.300	1,217,012.400	
ACCOR SA	1,850	38.830	71,835.500	
CAPGEMINI SE	1,645	107.350	176,590.750	
VALEO SA	3,703	35.760	132,419.280	
PUBLICIS GROUPE	2,918	39.940	116,544.920	
BUREAU VERITAS SA	3,227	23.760	76,673.520	
EIFFAGE	750	99.100	74,325.000	
SODEXO SA	1,248	105.800	132,038.400	
IPSEN	276	102.500	28,290.000	
INGENICO GROUP	499	96.860	48,333.140	
AMUNDI SA	437	68.700	30,021.900	
TELEPERFORMANCE	870	215.000	187,050.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	55.100	53,832.700	
FAURECIA	560	48.140	26,958.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	131	476.600	62,434.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	399	144.100	57,495.900	
SEB SA	197	141.000	27,777.000	
ESSILORLUXOTTICA	3,111	141.000	438,651.000	
DASSAULT AVIATION SA	22	1,235.000	27,170.000	
WORLDLINE SA	1,330	58.750	78,137.500	
AXA SA	23,171	24.695	572,207.840	
EDENRED	3,007	45.050	135,465.350	
RENAULT SA	2,554	43.455	110,984.070	
HERMES INTERNATIONAL	341	680.000	231,880.000	
STMICROELECTRONICS NV	7,498	22.300	167,205.400	
REMY COINTREAU	253	116.900	29,575.700	
ATOS SE	946	77.080	72,917.680	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,515	143.000	216,645.000	
WENDEL	201	122.300	24,582.300	
ORANGE	25,792	15.000	386,880.000	
ALSTOM	2,961	39.580	117,196.380	
CNP ASSURANCES	1,349	17.920	24,174.080	
SANOFI	12,077	84.510	1,020,627.270	
VINCI SA	5,531	98.980	547,458.380	

AIRBUS SE	6,345	133.400	846,423.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,351	23.240	170,837.240	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	12.415	181,370.730	
BIOMERIEUX	457	82.050	37,496.850	
ENGIE	21,099	14.360	302,981.640	
EDF	6,760	9.324	63,030.240	
SES	4,402	12.045	53,022.090	
SAFRAN SA	3,587	148.450	532,490.150	
ILIAD SA	219	115.550	25,305.450	
ARKEMA	838	94.060	78,822.280	
ADP	350	177.500	62,125.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,400	14.890	20,846.000	
SCOR SE	3,289	38.990	128,238.110	
GETLINK SE	3,940	15.310	60,321.400	
BOLLORE	7,300	3.880	28,324.000	
UCB SA	1,921	73.560	141,308.760	
KBC GROUP NV	3,011	66.140	199,147.540	
COLRUYT SA	350	47.000	16,450.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,539	92.100	141,741.900	
SOLVAY SA	873	104.000	90,792.000	
UMICORE	1,600	38.980	62,368.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,347	71.870	599,898.890	
AGEAS	1,654	54.480	90,109.920	
PROXIMUS	2,269	27.380	62,125.220	
TELENET GROUP HOLDING NV	462	40.960	18,923.520	
PRYSMIAN SPA	4,145	20.690	85,760.050	
ASSICURAZIONI GENERALI	11,733	18.530	217,412.490	
MEDIOBANCA SPA	9,971	10.150	101,205.650	
TENARIS SA	4,700	9.652	45,364.400	
UNICREDIT SPA	29,471	12.562	370,214.700	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.568	61,651.400	
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.559	27,044.970	
INTESA SANPAOLO	135,457	2.300	311,618.820	
ATLANTIA SPA	6,027	20.120	121,263.240	
POSTE ITALIANE SPA	7,727	10.590	81,828.930	
MONCLER SPA	1,522	39.770	60,529.940	
RECORDATI SPA	692	38.070	26,344.440	
ENI SPA	28,621	13.714	392,508.390	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	4,483	8.285	37,141.650	

PIRELLI & C SPA	5,651	5.150	29,102.650	
LEONARDO SPA	6,676	10.615	70,865.740	
ENEL SPA	88,957	6.856	609,889.190	
SNAM SPA	24,300	4.512	109,641.600	
TERNA SPA	19,900	5.830	116,017.000	
EXOR NV	1,088	69.440	75,550.720	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	9.728	113,730.040	
FINECOBANK SPA	5,972	11.260	67,244.720	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	10,787	13.420	144,761.540	
FERRARI NV	1,478	153.400	226,725.200	
TELEFONICA SA	54,259	6.952	377,208.560	
ENDESA SA	2,150	24.680	53,062.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	71,185	4.781	340,371.070	
IBERDROLA SA	68,524	8.928	611,782.270	
BANCO DE SABADELL SA	49,634	1.007	49,981.430	
BANKINTER SA	6,700	6.348	42,531.600	
REPSOL SA	17,685	14.290	252,718.650	
GRIFOLS SA	3,004	31.010	93,154.040	
BANCO SANTANDER SA	177,593	3.537	628,146.440	
AMADEUS IT GROUP SA	5,048	72.300	364,970.400	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,978	23.600	93,880.800	
MAPFRE SA	8,005	2.559	20,484.790	
CAIXABANK SA	46,859	2.679	125,535.260	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,583	35.330	126,587.390	
AENA SME SA	866	166.700	144,362.200	
CELLNEX TELECOM SA	2,096	39.000	81,744.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,754	28.260	332,168.040	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	1,793	14.485	25,971.600	
ENAGAS SA	3,675	22.610	83,091.750	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,056	17.750	71,994.000	
FERROVIAL SA	6,055	26.950	163,182.250	
BANKIA SA	15,905	1.758	27,968.940	
UPM-KYMMENE OYJ	6,525	30.320	197,838.000	
NOKIA OYJ	65,261	3.211	209,585.700	
WARTSILA OYJ ABP	4,116	9.136	37,603.770	

	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,853	12.200	108,006.600	
	METSO OYJ	1,108	34.800	38,558.400	
	ELISA OYJ	1,300	48.510	63,063.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	4,934	36.700	181,077.800	
	FORTUM OYJ	4,400	21.390	94,116.000	
	KONE OYJ-B	3,860	56.820	219,325.200	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	1,770	24.560	43,471.200	
	NESTE OYJ	4,849	30.680	148,767.320	
	ORION OYJ-CLASS B	1,763	39.500	69,638.500	
	VERBUND AG	1,216	47.180	57,370.880	
	OMV AG	1,209	51.740	62,553.660	
	ERSTE GROUP BANK AG	2,750	32.500	89,375.000	
	VOESTALPINE AG	1,800	24.050	43,290.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	21.310	23,441.000	
	ANDRITZ AG	550	35.400	19,470.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,995	32.200	64,239.000	
	AIB GROUP PLC	9,000	2.970	26,730.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,234	4.560	46,667.040	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,600	48.920	78,272.000	
	JERONIMO MARTINS	2,900	14.495	42,035.500	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	27,576	3.670	101,203.920	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,183	14.775	106,128.820	
	KERRY GROUP PLC-A	1,712	116.400	199,276.800	
	CRH PLC	8,012	34.730	278,256.760	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	889	104.000	92,456.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 46,028,010.450 (5,562,945,343)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,500	54.450	1,279,575.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	22,000	51.200	1,126,400.000	
	MTR CORP	16,500	43.900	724,350.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	113.900	2,164,100.000	
	SINO LAND CO	34,000	11.740	399,160.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,552	71.100	2,030,047.200	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8,000	70.450	563,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	19,000	80.700	1,533,300.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	37.650	774,272.250	
HONG KONG & CHINA GAS	118,035	14.920	1,761,082.200	
HANG SENG BANK LTD	9,000	159.600	1,436,400.000	
WHEELOCK & CO LTD	16,000	48.650	778,400.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	58,000	10.220	592,760.000	
WH GROUP LTD	91,500	8.040	735,660.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,900	247.200	3,436,080.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	37,000	16.040	593,480.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	2,000	102.200	204,400.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	8,000	23.150	185,200.000	
NWS HOLDINGS LTD	15,000	10.500	157,500.000	
KERRY PROPERTIES LTD	7,500	25.250	189,375.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	8,600	17.660	151,876.000	
SJM HOLDINGS LTD	10,000	7.980	79,800.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	24.350	194,800.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	30,552	52.050	1,590,231.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	53.000	291,500.000	
PCCW LTD	60,000	4.720	283,200.000	
AIA GROUP LTD	147,800	78.400	11,587,520.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14,000	43.450	608,300.000	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	12,000	30.100	361,200.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	27.900	535,680.000	
SANDS CHINA LTD	23,800	37.000	880,600.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	19,000	58.850	1,118,150.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	39,000	26.600	1,037,400.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	17.220	289,296.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 39,674,695.250 (555,842,480)	
合計			47,526,836,374 [47,526,836,374]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	アメリカ・ドル 359,994.390	

SIMON PROPERTY GROUP INC	3,433	519,103.930	
BOSTON PROPERTIES INC	1,556	215,568.240	
VORNADO REALTY TRUST	2,128	137,404.960	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,280	302,681.600	
EQUITY RESIDENTIAL	4,248	361,504.800	
EQUINIX INC	944	535,106.400	
AMERICAN TOWER CORP	4,869	1,042,112.070	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,228	108,927.720	
KIMCO REALTY CORP	3,300	71,346.000	
INVITATION HOMES INC	6,081	185,652.930	
VICI PROPERTIES INC	5,464	135,124.720	
VENTAS INC	3,702	215,863.620	
WEYERHAEUSER CO	7,435	219,406.850	
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	130,921.880	
CROWN CASTLE INTL CORP	4,614	616,707.240	
IRON MOUNTAIN INC	3,474	111,584.880	
VEREIT INC	13,632	133,048.320	
SUN COMMUNITIES INC	1,214	199,957.940	
PROLOGIS INC	7,007	641,490.850	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,200	195,024.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	131,294.350	
DUKE REALTY CORP	4,971	174,879.780	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	771	240,690.780	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	974	128,636.180	
WELLTOWER INC	4,572	386,654.040	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	224,417.920	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,058	126,813.960	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,100	149,721.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	144,456.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	145,846.560	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	86,508.480	
REALTY INCOME CORP	3,348	256,557.240	
PUBLIC STORAGE	1,750	368,690.000	
REGENCY CENTERS CORP	1,939	126,112.560	
SL GREEN REALTY CORP	650	55,464.500	
UDR INC	2,965	142,468.250	
WP CAREY INC	1,600	133,472.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	90,952.920	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,269	274,435.550	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,072	113,685.600	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4,197	87,129.720	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 10,027,420.730 (1,099,807,506)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	98,667.280	
	SEGRO PLC	13,286	118,776.840	
	BRITISH LAND CO PLC	14,580	83,922.480	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 301,366.600 (42,670,497)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	4,303	83,090.930	
	TRANSURBAN GROUP	31,468	483,033.800	
	SYDNEY AIRPORT	9,129	83,804.220	
	APA GROUP	14,243	156,673.000	
	SCENTRE GROUP	64,017	252,226.980	
	DEXUS	13,949	170,596.270	
	GPT GROUP	30,647	188,479.050	
	MIRVAC GROUP	61,117	205,964.290	
	STOCKLAND	18,729	94,581.450	
	GOODMAN GROUP	20,198	299,334.360	
	VICINITY CENTRES	50,371	134,994.280	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 2,152,778.630 (159,843,813)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,600	88,704.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,000	43,160.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	37,996.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 169,860.000 (14,033,833)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28,000	56,280.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	90,890.000	

	CAPITALAND MALL TRUST	31,500	79,380.000	
	SUNTEC REIT	26,000	47,840.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,600	88,736.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 363,126.000 (29,126,336)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	248,466.900	ユーロ
	ICADE	406	36,885.100	
	GECINA SA	578	90,630.400	
	KLEPIERRE	2,394	77,972.580	
	COVIVIO	353	35,441.200	
ユーロ 小計			ユーロ 489,396.180 (59,148,423)	
香港・ドル	LINK REIT	24,000	1,920,000.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000	398,840.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000	390,320.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 2,709,160.000 (37,955,332)	
投資証券 合計			1,442,585,740 [1,442,585,740]	
合計			1,442,585,740 [1,442,585,740]	

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 611銘柄	96.8%	3.2%	69.5%
	投資証券 42銘柄			
イギリス・ポンド	株式 93銘柄	98.5%	1.5%	5.9%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%

オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	87.0%	13.0%	2.5%
	投資証券	11銘柄			
カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.2%	0.8%	3.5%
	投資証券	3銘柄			
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	87.8%	12.2%	0.5%
	投資証券	5銘柄			
スイス・フラン	株式	39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%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式	8銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	235銘柄	98.9%	1.1%	11.5%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	34銘柄	93.6%	6.4%	1.2%
	投資証券	3銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年12月1日から2019年12月2日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	5,914,061	-
コール・ローン	11,501,474	20,237,588
親投資信託受益証券	1,624,398,082	1,830,894,299
未収入金	-	150,000
流動資産合計	1,641,813,617	1,851,281,887
資産合計	1,641,813,617	1,851,281,887
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,793,565	2,788,039
未払受託者報酬	171,575	189,845
未払委託者報酬	2,531,518	2,800,778
その他未払費用	42,986	47,956
流動負債合計	4,539,644	5,826,618
負債合計	4,539,644	5,826,618
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,417,526,848	1,462,100,428
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	219,747,125	383,354,841
（分配準備積立金）	59,598,109	196,075,466
元本等合計	1,637,273,973	1,845,455,269
純資産合計	1,637,273,973	1,845,455,269
負債純資産合計	1,641,813,617	1,851,281,887

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日		自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		21
有価証券売買等損益		21,428,024		168,546,217
<b>営業収益合計</b>		<b>21,428,026</b>		<b>168,546,238</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,864		11,859
受託者報酬		293,139		369,173
委託者報酬		4,325,105		5,446,478
その他費用		74,580		93,305
<b>営業費用合計</b>		<b>4,702,688</b>		<b>5,920,815</b>
<b>営業利益</b>		<b>16,725,338</b>		<b>162,625,423</b>
経常利益		16,725,338		162,625,423
<b>当期純利益</b>		<b>16,725,338</b>		<b>162,625,423</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		7,582,270		10,659,263
期首剰余金又は期首欠損金( )		111,793,232		219,747,125
剰余金増加額又は欠損金減少額		136,731,615		78,690,190
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		136,731,615		78,690,190
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,920,790		67,048,634
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,920,790		67,048,634
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>219,747,125</b>		<b>383,354,841</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	803,832,811円	1,417,526,848円
期中追加設定元本額	874,852,673円	481,206,327円
期中一部解約元本額	261,158,636円	436,632,747円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,417,526,848口	1,462,100,428口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。	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(151,969,731円)、投資信託約款に規定される収益調整金(187,289,622円)及び分配準備積立金(44,105,735円)より分配対象額は383,365,088円(1万口当たり2,622.02円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	18,604,175	160,883,353
合計	18,604,175	160,883,353

## （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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.1550円	1.2622円
（1万口当たり純資産額）	（11,550円）	（12,622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	224,901,804	355,367,340	
	外国株式インデックスマザーファンド	538,513,489	1,475,526,959	
親投資信託受益証券 合計			1,830,894,299	
合計			1,830,894,299	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	498,352,197	612,451,738

金銭信託		333,952,924	-
コール・ローン		649,460,746	6,367,531,949
株式		102,418,129,349	121,306,145,522
投資証券		2,814,132,682	3,645,255,546
派生商品評価勘定		45,643,154	373,437,617
未収入金		4,687,255	96,592,173
未収配当金		196,655,015	214,896,369
差入委託証拠金		770,259,958	1,487,858,524
流動資産合計		107,731,273,280	134,104,169,438
資産合計		107,731,273,280	134,104,169,438
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,415,029	930,366
未払金		-	76,338,905
未払解約金		33,327,900	58,281,600
その他未払費用		4,482	3,792
流動負債合計		37,747,411	135,554,663
負債合計		37,747,411	135,554,663
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,964,024,902	48,893,612,273
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		63,729,500,967	85,075,002,502
元本等合計		107,693,525,869	133,968,614,775
純資産合計		107,693,525,869	133,968,614,775
負債純資産合計		107,731,273,280	134,104,169,438

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	39,734,106,968円	43,964,024,902円
期中追加設定元本額	7,457,653,079円	10,527,862,672円
期中一部解約元本額	3,227,735,145円	5,598,275,301円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV A	507,485,808円	466,203,951円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	14,096,372円	12,135,579円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	197,649,153円	136,414,008円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	25,055,668円	19,175,184円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	627,330,937円	467,869,193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)	812,920円	8,549,100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)	550,738,616円	538,132,530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)	1,489,095,675円	1,863,069,978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)	529,688,114円	538,513,489円

D - I ' s 外国株式インデックス	5,542,491円	2,768,783円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	197,868円	2,115,496円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	723,449,418円	1,146,595,215円
i F r e e 8資産バランス	557,965,043円	816,785,041円
i F r e e 年金バランス	8,203,476円	26,201,082円
DCダイワ外国株式インデックス	27,624,252,366円	29,501,748,908円
ダイワ・ライフ・バランス30	569,101,264円	576,429,097円
ダイワ・ライフ・バランス50	839,595,806円	874,085,645円
ダイワ・ライフ・バランス70	676,868,528円	675,316,597円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,489,592,147円	1,500,453,033円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	4,144,667円	3,017,912円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	13,247,986円	14,368,992円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,228,403円	5,760,550円
ダイワつみたてインデックス外国株式	4,608,188円	136,727,006円
ダイワつみたてインデックスバランス30	- 円	88,638円
ダイワつみたてインデックスバランス50	- 円	86,527円
ダイワつみたてインデックスバランス70	- 円	530,015円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	76,173円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	156,042円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	1,204,032円	- 円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	2,140,945円	- 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	237,257,604円	184,271,979円
ダイワ世界バランスファンド60VA	353,114,328円	323,611,524円

ダイワ・バランスファンド35 VA	3,137,819,193円	2,650,169,104円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	153,703,054円	127,631,309円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	631,981,535円	677,239,222円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	88,367,711円	111,772,535円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	453,744円	2,632,754,719円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,746,321,380円	2,712,848,524円
ダイワライフスタイル25	19,463,084円	18,663,687円
ダイワライフスタイル50	70,173,613円	67,445,810円
ダイワライフスタイル75	58,841,550円	54,062,311円
計	43,964,024,902円	48,893,612,273円
2. 期末日における受益権の総数	43,964,024,902口	48,893,612,273口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用してあります。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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	54,564,220	14,202,028,663
投資証券	24,568,003	442,369,912
合計	29,996,217	14,644,398,575

(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（2017年12月1日から2018年11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在			2019年12月2日 現在		
	契約額等		時価	契約額等		時価
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	うち 1年超	(円)

市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,386,774,786	-	2,428,842,371	42,067,585	8,546,091,477	-	8,919,524,138	373,432,661
合計	2,386,774,786	-	2,428,842,371	42,067,585	8,546,091,477	-	8,919,524,138	373,432,661

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

- 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
- 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種 類	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	941,976,460	-	941,137,000	839,460	6,314,295,910	-	6,313,370,500	925,410
アメリカ・ドル	941,976,460	-	941,137,000	839,460	4,843,983,500	-	4,843,319,000	664,500
イギリス・ポ ンド	-	-	-	-	240,357,900	-	240,312,000	45,900
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	96,328,960	-	96,317,000	11,960
カナダ・ドル	-	-	-	-	226,600,550	-	226,572,500	28,050
スイス・フラン	-	-	-	-	230,248,200	-	230,202,000	46,200
ユーロ	-	-	-	-	676,776,800	-	676,648,000	128,800

合計	941,976,460	-	941,137,000	839,460	6,314,295,910	-	6,313,370,500	925,410
----	-------------	---	-------------	---------	---------------	---	---------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	2.4496円	2.7400円
(1万口当たり純資産額)	(24,496円)	(27,400円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	3,300	123.710	408,243.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,850	227.220	647,577.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,550	107.030	594,016.500	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,100	72.760	298,316.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	151.120	241,792.000	

SYNCHRONY FINANCIAL	18,500	37.410	692,085.000	
ABBOTT LABORATORIES	49,916	85.450	4,265,322.200	
ARCONIC INC	11,133	30.960	344,677.680	
VERISK ANALYTICS INC	4,350	147.480	641,538.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	9,800	62.750	614,950.000	
AMPHENOL CORP-CL A	8,550	104.000	889,200.000	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	17,362	138.150	2,398,560.300	
QORVO INC	3,400	104.210	354,314.000	
AFLAC INC	21,600	54.840	1,184,544.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	3,650	118.440	432,306.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	4,200	69.810	293,202.000	
ADOBE INC	13,750	309.530	4,256,037.500	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	46.210	298,054.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	3,100	225.690	699,639.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	11,300	16.500	186,450.000	
GARMIN LTD	3,900	97.690	380,991.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	6,130	236.330	1,448,702.900	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,550	178.550	3,669,202.500	
WR BERKLEY CORP	4,175	68.000	283,900.000	
AUTOZONE INC	730	1,177.920	859,881.600	
DOLLAR TREE INC	6,971	91.460	637,567.660	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	31,400	10.420	327,188.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,200	87.390	279,648.000	
CELANESE CORP	3,500	125.570	439,495.000	
DR HORTON INC	10,116	55.350	559,920.600	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	30.880	75,656.000	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	56.540	395,780.000	
AUTODESK INC	6,100	180.900	1,103,490.000	
MOODY'S CORP	4,800	226.670	1,088,016.000	
DEVON ENERGY CORP	11,650	21.890	255,018.500	
ALBEMARLE CORP	3,150	65.380	205,947.000	
ATMOS ENERGY CORP	3,350	106.960	358,316.000	
ALLIANT ENERGY CORP	6,700	53.000	355,100.000	
CITIGROUP INC	65,373	75.120	4,910,819.760	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	12,250	170.780	2,092,055.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	14,250	91.350	1,301,737.500	

ALLEGHANY CORP	410	780.040	319,816.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	294.300	323,730.000	
HESS CORP	7,800	62.090	484,302.000	
DAVITA INC	3,500	71.770	251,195.000	
DANAHER CORP	18,200	145.980	2,656,836.000	
FORTIVE CORP	8,700	72.170	627,879.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	16,250	94.170	1,530,262.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	18.890	92,561.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	5,628	17.300	97,364.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,800	42.930	678,294.000	
BUNGE LTD	4,000	53.380	213,520.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,825	92.710	910,875.750	
APPLE INC	129,800	267.250	34,689,050.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	9,400	84.870	797,778.000	
BOEING CO/THE	14,990	366.180	5,489,038.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,465	107.050	477,978.250	
BECTON DICKINSON AND CO	7,649	258.500	1,977,266.500	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	21.280	142,576.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	90.840	349,734.000	
CDK GLOBAL INC	3,600	53.550	192,780.000	
NISOURCE INC	11,050	26.450	292,272.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	76.850	295,872.500	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	24,321	48.970	1,190,999.370	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	116,904	60.240	7,042,296.960	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	36,350	220.300	8,007,905.000	
ANSYS INC	2,450	254.690	623,990.500	
BB&T CORP	21,550	54.720	1,179,216.000	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	19,000	54.220	1,030,180.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	66,850	56.940	3,806,439.000	
JPMORGAN CHASE & CO	91,070	131.760	11,999,383.200	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,950	123.560	858,742.000	
LKQ CORP	9,400	35.280	331,632.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,350	188.330	254,245.500	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	9,062	67.820	614,584.840	
CADENCE DESIGN SYS INC	8,300	70.250	583,075.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	163.870	624,344.700	
DOLLAR GENERAL CORP	7,500	157.360	1,180,200.000	

SERVICENOW INC	5,160	283.040	1,460,486.400	
CATERPILLAR INC	16,200	144.730	2,344,626.000	
BROWN & BROWN INC	7,000	37.740	264,180.000	
AQUA AMERICA INC	6,300	44.270	278,901.000	
CMS ENERGY CORP	8,200	61.300	502,660.000	
MOSAIC CO/THE	10,950	19.050	208,597.500	
DELTA AIR LINES INC	4,750	57.310	272,222.500	
CORNING INC	23,200	29.040	673,728.000	
CISCO SYSTEMS INC	121,050	45.310	5,484,775.500	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	63.960	236,652.000	
MORGAN STANLEY	35,650	49.480	1,763,962.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,550	134.750	208,862.500	
MSCI INC	2,450	259.190	635,015.500	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	255.850	255,850.000	
MIDDLEBY CORP	1,600	115.760	185,216.000	
COTY INC-CL A	8,439	11.540	97,386.060	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,500	60.050	390,325.000	
BROADCOM INC	11,122	316.210	3,516,887.620	
ACUITY BRANDS INC	1,150	130.780	150,397.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,330	117.140	390,076.200	
ARAMARK	7,050	43.640	307,662.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	28.470	172,243.500	
DTE ENERGY COMPANY	5,250	124.940	655,935.000	
CENTENE CORP	12,150	60.470	734,710.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,200	118.900	380,480.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13,050	38.460	501,903.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,350	93.270	498,994.500	
GARTNER INC	2,720	160.460	436,451.200	
SPLUNK INC	4,500	149.220	671,490.000	
DOMINION ENERGY INC	22,641	83.110	1,881,693.510	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,700	59.820	699,894.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	48.400	200,860.000	
DEERE & CO	8,750	168.050	1,470,437.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	8,184	181.100	1,482,122.400	
VMWARE INC-CLASS A	2,500	155.620	389,050.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	225.000	427,500.000	
NASDAQ INC	3,450	104.800	361,560.000	
VAIL RESORTS INC	1,120	242.670	271,790.400	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	45.820	187,862.000	

TARGA RESOURCES CORP	6,550	36.530	239,271.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	165.460	297,828.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,180	109.710	239,167.800	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	68.680	72,114.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	9,200	86.890	799,388.000	
COGNEX CORP	5,050	50.180	253,409.000	
TELEFLEX INC	1,330	353.340	469,942.200	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,600	115.620	300,612.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,200	147.030	323,466.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	650	369.380	240,097.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,520	322.070	489,546.400	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,800	149.180	566,884.000	
IDEX CORP	2,250	162.740	366,165.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	23,050	67.820	1,563,251.000	
ROLLINS INC	4,325	35.850	155,051.250	
AMETEK INC	6,525	99.010	646,040.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,350	70.240	516,264.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	36.990	135,013.500	
HEICO CORP	1,200	129.890	155,868.000	
XPO LOGISTICS INC	2,550	82.690	210,859.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,150	259.650	298,597.500	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	7,500	92.540	694,050.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,100	290.170	319,187.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,400	299.810	3,717,644.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,400	121.830	292,392.000	
GRUBHUB INC	2,600	43.120	112,112.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,650	211.850	349,552.500	
RPM INTERNATIONAL INC	3,800	73.730	280,174.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	690	813.920	561,604.800	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	6,950	20.900	145,255.000	
UGI CORP	5,200	43.550	226,460.000	
CUMMINS INC	4,350	182.860	795,441.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	21,550	54.830	1,181,586.500	
SABRE CORP	7,650	22.430	171,589.500	

CDW CORP/DE	4,350	135.050	587,467.500	
SIGNATURE BANK	1,500	123.360	185,040.000	
COSTAR GROUP INC	990	612.860	606,731.400	
SVB FINANCIAL GROUP	1,490	231.730	345,277.700	
AMERCO	220	362.220	79,688.400	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,850	191.590	354,441.500	
MERCADOLIBRE INC	1,270	580.580	737,336.600	
HANESBRANDS INC	11,000	15.070	165,770.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,300	151.940	349,462.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8,166	105.000	857,430.000	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	142.090	144,931.800	
DEXCOM INC	2,700	227.310	613,737.000	
COPART INC	5,850	89.000	520,650.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,650	77.340	359,631.000	
SEATTLE GENETICS INC	3,250	120.350	391,137.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,270	277.340	629,561.800	
TRANSDIGM GROUP INC	1,330	567.100	754,243.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,600	116.610	303,186.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	19.550	193,545.000	
KINDER MORGAN INC	57,581	19.610	1,129,163.410	
HCA HEALTHCARE INC	7,900	138.660	1,095,414.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,150	403.820	464,393.000	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	15.940	192,077.000	
T-MOBILE US INC	10,000	78.550	785,500.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	39.150	135,067.500	
COCA-COLA CO/THE	114,150	53.400	6,095,610.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7,100	50.460	358,266.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	74.760	362,586.000	
EATON VANCE CORP	3,050	47.170	143,868.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	27.490	237,788.500	
CSX CORP	22,150	71.540	1,584,611.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,680	172.290	461,737.200	
EXPEDIA GROUP INC	4,075	101.660	414,264.500	
AUTOLIV INC	2,400	81.720	196,128.000	
AMAZON.COM INC	11,770	1,800.800	21,195,416.000	
FLOWSERVE CORP	3,550	48.700	172,885.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,000	244.940	1,469,640.000	

EXXON MOBIL CORP	119,655	68.130	8,152,095.150	
FLIR SYSTEMS INC	3,750	53.560	200,850.000	
AES CORP	20,100	18.910	380,091.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,240	271.260	336,362.400	
EOG RESOURCES INC	16,400	70.900	1,162,760.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	4,850	87.120	422,532.000	
ABIOMED INC	1,290	196.180	253,072.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,650	87.910	408,781.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	9,240	80.770	746,314.800	
FORD MOTOR CO	110,923	9.060	1,004,962.380	
DISCOVERY INC - A	4,690	32.940	154,488.600	
EXACT SCIENCES CORP	3,700	81.010	299,737.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.550	110,201.850	
DISCOVERY INC-C	10,089	30.520	307,916.280	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	61.810	247,240.000	
FORTINET INC	4,150	105.110	436,206.500	
MARKEL CORP	410	1,135.550	465,575.500	
NEXTERA ENERGY INC	13,550	233.820	3,168,261.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	43,408	11.380	493,983.040	
INSULET CORP	1,750	185.700	324,975.000	
US BANCORP	42,800	60.030	2,569,284.000	
UNITED RENTALS INC	2,300	153.050	352,015.000	
F5 NETWORKS INC	1,750	145.710	254,992.500	
FASTENAL CO	16,300	35.520	578,976.000	
FISERV INC	16,163	116.240	1,878,787.120	
GENERAL ELECTRIC CO	246,850	11.270	2,781,999.500	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	53.640	327,204.000	
GENERAL MOTORS CO	36,100	36.000	1,299,600.000	
TRIPADVISOR INC	3,300	28.400	93,720.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,900	181.740	1,254,006.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,290	221.350	2,056,341.500	
ALPHABET INC-CL A	8,400	1,304.090	10,954,356.000	
ALPHABET INC-CL C	8,747	1,304.960	11,414,485.120	
OWENS CORNING	3,150	67.060	211,239.000	
GENERAL MILLS INC	16,850	53.320	898,442.000	
FIRSTENERGY CORP	15,268	47.690	728,130.920	
GENUINE PARTS CO	4,300	104.370	448,791.000	
IHS MARKIT LTD	10,634	72.650	772,560.100	

FIFTH THIRD BANCORP	20,700	30.190	624,933.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	6,410	201.090	1,288,986.900	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	28.740	86,220.000	
HALLIBURTON CO	24,800	20.990	520,552.000	
HOME DEPOT INC	31,000	220.510	6,835,810.000	
ASSURANT INC	1,750	132.870	232,522.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,900	14.890	445,211.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	251.670	299,487.300	
HERSHEY CO/THE	4,350	148.160	644,496.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	36.380	161,891.000	
HUMANA INC	3,830	341.230	1,306,910.900	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8,150	115.580	941,977.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,100	172.470	362,187.000	
HENRY SCHEIN INC	4,500	68.900	310,050.000	
HP INC	42,600	20.080	855,408.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	15.830	623,702.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	48.510	232,848.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	51.550	242,285.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	6,000	45.090	270,540.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	48.700	121,750.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,900	41.970	499,443.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	19,853	30.500	605,516.500	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	25,000	134.450	3,361,250.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	46.340	495,838.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	63.260	253,040.000	
ZOETIS INC	13,550	120.520	1,633,046.000	
INGERSOLL-RAND PLC	6,979	131.110	915,016.690	
CHENIERE ENERGY INC	6,550	60.540	396,537.000	
ALLEGION PLC	2,650	120.030	318,079.500	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	52.320	183,120.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	11,773	21.500	253,119.500	
WASTE CONNECTIONS INC	7,557	90.550	684,286.350	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	25.060	241,829.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,200	112.490	247,478.000	

JM SMUCKER CO/THE	3,420	105.090	359,407.800	
JOHNSON & JOHNSON	74,800	137.490	10,284,252.000	
ABBVIE INC	41,779	87.730	3,665,271.670	
HOLOGIC INC	7,550	51.320	387,466.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,950	136.340	1,356,583.000	
KROGER CO	22,950	27.340	627,453.000	
KLA CORP	4,650	163.860	761,949.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	7,170	391.030	2,803,685.100	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,560	306.920	785,715.200	
LOWE'S COS INC	22,450	117.310	2,633,609.500	
ELI LILLY & CO	24,605	117.350	2,887,396.750	
LAM RESEARCH CORP	4,230	266.830	1,128,690.900	
JONES LANG LASALLE INC	1,450	166.330	241,178.500	
LOEWS CORP	7,900	50.900	402,110.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	59.050	342,430.950	
MCDONALD'S CORP	21,600	194.480	4,200,768.000	
3M CO	16,250	169.770	2,758,762.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	67,650	201.640	13,640,946.000	
MANPOWERGROUP INC	1,780	92.640	164,899.200	
S&P GLOBAL INC	6,980	264.650	1,847,257.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,840	268.400	493,856.000	
CONCHO RESOURCES INC	5,800	72.560	420,848.000	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	6,600	34.240	225,984.000	
PHILLIPS 66	12,850	114.720	1,474,152.000	
TECHNIPFMC PLC	12,100	18.840	227,964.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,450	31.950	461,677.500	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	37.330	290,726.040	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,350	169.250	566,987.500	
MYLAN NV	14,850	18.780	278,883.000	
METLIFE INC	23,500	49.910	1,172,885.000	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,100	26.370	477,297.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,510	195.130	294,646.300	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	45.020	216,096.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,778	167.300	799,359.400	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	640	719.410	460,422.400	
BAKER HUGHES CO	14,473	22.420	324,484.660	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,380	195.840	661,939.200	

MERCK & CO. INC.	72,721	87.180	6,339,816.780	
DUPONT DE NEMOURS INC	21,168	64.810	1,371,898.080	
MASCO CORP	8,600	46.550	400,330.000	
M & T BANK CORP	3,569	164.740	587,957.060	
MARSH & MCLENNAN COS	14,450	108.070	1,561,611.500	
BLACK KNIGHT INC	4,400	63.010	277,244.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,300	100.440	231,012.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	7,872	140.360	1,104,913.920	
WORKDAY INC-CLASS A	4,800	179.120	859,776.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,850	84.920	157,102.000	
SQUARE INC - A	10,100	69.120	698,112.000	
TRANSUNION	5,500	86.310	474,705.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	26.530	266,626.500	
CAPRI HOLDINGS LTD	4,450	37.140	165,273.000	
BEIGENE LTD-ADR	1,050	203.290	213,454.500	
NETAPP INC	7,450	60.590	451,395.500	
NIKE INC -CL B	35,550	93.490	3,323,569.500	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,500	193.500	1,451,250.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,800	94.540	642,872.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,750	89.820	336,825.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	31.840	364,568.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,450	351.770	1,565,376.500	
APTIV PLC	7,200	93.880	675,936.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	23,161	38.400	889,382.400	
MCKESSON CORP	5,550	144.640	802,752.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,100	56.670	459,027.000	
XYLEM INC	5,150	77.510	399,176.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	44,050	82.930	3,653,066.500	
NUCOR CORP	8,700	56.360	490,332.000	
WESTERN UNION CO	12,946	26.880	347,988.480	
GODADDY INC - CLASS A	5,300	66.380	351,814.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	19.220	236,252.240	
EVERGY INC	6,850	63.270	433,399.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	25,724	38.570	992,174.680	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	169.300	118,510.000	
OKTA INC	3,000	129.780	389,340.000	
LIBERTY BROADBAND-C	3,150	119.490	376,393.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	10,705	27.710	296,635.550	

LINDE PLC	15,296	206.210	3,154,188.160
WIX.COM LTD	1,450	120.890	175,290.500
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,300	24.740	205,342.000
KKR & CO INC -A	14,700	29.490	433,503.000
PAYCHEX INC	9,350	86.120	805,222.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	442.280	973,016.000
ALTRIA GROUP INC	52,850	49.700	2,626,645.000
PFIZER INC	157,113	38.520	6,051,992.760
CIGNA CORP	10,680	199.920	2,135,145.600
DELL TECHNOLOGIES -C	4,551	48.490	220,677.990
ALTICE USA INC- A	4,100	25.580	104,878.000
XCEL ENERGY INC	14,850	61.490	913,126.500
STERIS PLC	2,500	151.140	377,850.000
FOX CORP - CLASS B	4,833	34.980	169,058.340
FOX CORP - CLASS A	9,999	35.760	357,564.240
STRYKER CORP	9,500	204.860	1,946,170.000
DOW INC	21,068	53.370	1,124,399.160
PARKER HANNIFIN CORP	3,750	198.790	745,462.500
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	29.600	153,920.000
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,650	127.840	594,456.000
POLARIS INC	1,550	97.700	151,435.000
PROCTER & GAMBLE CO/THE	70,767	122.060	8,637,820.020
EXELON CORP	27,372	44.400	1,215,316.800
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,600	113.940	752,004.000
NVR INC	100	3,791.890	379,189.000
CONOCOPHILLIPS	31,900	59.940	1,912,086.000
TWILIO INC - A	3,150	103.280	325,332.000
DOCUSIGN INC	2,900	71.210	206,509.000
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	276.810	387,534.000
MATCH GROUP INC	1,800	70.480	126,864.000
PEPSICO INC	39,550	135.830	5,372,076.500
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	122.550	134,805.000
DROPBOX INC-CLASS A	5,200	18.490	96,148.000
MONGODB INC	1,250	148.700	185,875.000
SNAP INC - A	20,800	15.250	317,200.000
CORTEVA INC	21,568	26.020	561,199.360
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,800	93.620	1,104,716.000

AMCOR PLC	47,900	10.260	491,454.000	
ROKU INC	2,400	160.370	384,888.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	5,150	121.030	623,304.500	
ACCENTURE PLC-CL A	18,080	201.160	3,636,972.800	
PENTAIR PLC	4,705	44.350	208,666.750	
QUALCOMM INC	34,350	83.550	2,869,942.500	
INVESCO LTD	10,950	17.560	192,282.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	157.080	322,014.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	8,350	55.100	460,085.000	
PINTEREST INC- CLASS A	4,500	19.480	87,660.000	
RAYTHEON COMPANY	7,920	217.420	1,721,966.400	
DISH NETWORK CORP-RTS	349	0.680	237.320	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,200	369.000	811,800.000	
REPUBLIC SERVICES INC	6,750	88.650	598,387.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,230	1,904.030	2,341,956.900	
ROSS STORES INC	10,700	116.150	1,242,805.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	111.900	296,535.000	
RESMED INC	4,150	149.600	620,840.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	106.550	404,890.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	58.200	194,970.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	107.340	155,643.000	
PERKINELMER INC	3,100	92.900	287,990.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	30,235	16.640	503,110.400	
CHEVRON CORP	53,818	117.130	6,303,702.340	
EDISON INTERNATIONAL	10,300	69.100	711,730.000	
TESLA INC	3,770	329.940	1,243,873.800	
NORTONLIFELOCK INC	18,450	24.900	459,405.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,422	157.740	697,526.280	
SYNOPSYS INC	4,350	141.040	613,524.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,415	470.010	2,075,094.150	
CBRE GROUP INC - A	9,150	57.020	521,733.000	
TWITTER INC	21,150	30.910	653,746.500	
SOUTHERN CO/THE	29,350	61.990	1,819,406.500	
SYSCO CORP	13,700	80.550	1,103,535.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,303	136.720	998,466.160	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,950	64.530	254,893.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	33.730	209,126.000	
SCHLUMBERGER LTD	39,202	36.200	1,419,112.400	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	51.490	236,854.000	
AT&T INC	206,591	37.380	7,722,371.580	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	57.640	233,442.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,300	21.470	264,081.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,330	583.130	1,358,692.900	
SEMPRA ENERGY	7,900	147.270	1,163,433.000	
TIFFANY & CO	3,250	133.800	434,850.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,100	59.680	423,728.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	26,500	120.210	3,185,565.000	
SALESFORCE.COM INC	23,421	162.890	3,815,046.690	
WESTROCK CO	7,130	40.330	287,552.900	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	22,984	42.830	984,404.720	
TERADYNE INC	5,000	62.590	312,950.000	
UNION PACIFIC CORP	19,950	175.990	3,511,000.500	
MARATHON OIL CORP	24,800	11.650	288,920.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	19,388	60.640	1,175,688.320	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	23,137	148.340	3,432,142.580	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,700	119.730	2,358,681.000	
UNUM GROUP	5,900	30.740	181,366.000	
SPRINT CORP	23,165	5.920	137,136.800	
IQVIA HOLDINGS INC	4,894	145.980	714,426.120	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	58.280	253,518.000	
AMEREN CORPORATION	7,200	74.330	535,176.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,776	279.870	7,493,799.120	
VERISIGN INC	3,000	190.740	572,220.000	
VALERO ENERGY CORP	11,742	95.490	1,121,243.580	
ULTA BEAUTY INC	1,610	233.860	376,514.600	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,188	47.630	389,994.440	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	139.490	348,725.000	
ANTHEM INC	7,280	288.660	2,101,444.800	
WALT DISNEY CO/THE	50,912	151.580	7,717,240.960	
WELLS FARGO & CO	120,922	54.460	6,585,412.120	
WASTE MANAGEMENT INC	11,950	112.910	1,349,274.500	
WILLIAMS COS INC	34,700	22.720	788,384.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,450	94.440	325,818.000	
WHIRLPOOL CORP	1,900	143.100	271,890.000	
WALMART INC	40,500	119.090	4,823,145.000	

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	86.990	252,271.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,800	145.280	842,624.000	
WYNN RESORTS LTD	2,900	120.850	350,465.000	
XEROX HOLDINGS CORP	5,911	38.930	230,115.230	
WABTEC CORP	5,411	78.570	425,142.270	
TJX COMPANIES INC	34,250	61.130	2,093,702.500	
WATERS CORP	2,050	222.070	455,243.500	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,800	92.800	167,040.000	
ALLERGAN PLC	9,157	184.940	1,693,495.580	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,650	250.940	414,051.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	22,000	59.600	1,311,200.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,723	196.440	731,346.120	
WESTERN DIGITAL CORP	8,400	50.330	422,772.000	
WEC ENERGY GROUP INC	9,080	88.650	804,942.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,600	59.310	865,926.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	48,950	184.510	9,031,764.500	
PPL CORP	21,100	34.030	718,033.000	
PULTEGROUP INC	7,500	39.650	297,375.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,750	128.840	869,670.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,000	107.240	643,440.000	
NVIDIA CORP	16,300	216.740	3,532,862.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,350	222.700	523,345.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,743	153.210	1,952,355.030	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	39.820	211,046.000	
TYSON FOODS INC-CL A	8,300	89.890	746,087.000	
NETFLIX INC	12,320	314.660	3,876,611.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	11,300	313.950	3,547,635.000	
NRG ENERGY INC	7,950	39.730	315,853.500	
GLOBE LIFE INC	2,925	102.760	300,573.000	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,850	109.900	533,015.000	
TEXTRON INC	6,850	46.240	316,744.000	
NEWS CORP - CLASS A	11,737	12.880	151,172.560	
OGE ENERGY CORP	5,950	42.060	250,257.000	

OMNICOM GROUP	6,400	79.480	508,672.000	
ORACLE CORP	67,683	56.140	3,799,723.620	
MASTERCARD INC - A	25,500	292.230	7,451,865.000	
ONEOK INC	11,900	71.050	845,495.000	
CENTURYLINK INC	29,452	14.490	426,759.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,020	360.370	1,088,317.400	
YUM! BRANDS INC	8,950	100.670	900,996.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,050	121.350	370,117.500	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	106.910	142,190.300	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,650	50.480	285,212.000	
NOBLE ENERGY INC	14,550	20.760	302,058.000	
BANK OF AMERICA CORP	255,401	33.320	8,509,961.320	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,050	341.990	359,089.500	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,250	80.710	423,727.500	
NORDSTROM INC	3,000	38.170	114,510.000	
AMERICAN EXPRESS CO	20,000	120.120	2,402,400.000	
ANALOG DEVICES INC	10,649	112.950	1,202,804.550	
ADVANCED MICRO DEVICES	29,100	39.150	1,139,265.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	8,300	51.830	430,189.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	24,522	52.660	1,291,328.520	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,150	98.300	506,245.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,950	120.020	594,099.000	
AVERY DENNISON CORP	2,500	130.370	325,925.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16,500	64.110	1,057,815.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,400	73.860	1,285,164.000	
AON PLC	6,970	203.610	1,419,161.700	
AMGEN INC	17,300	234.720	4,060,656.000	
TAPESTRY INC	8,350	26.890	224,531.500	
EATON CORP PLC	12,136	92.500	1,122,580.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,680	186.060	870,760.800	
APPLIED MATERIALS INC	27,200	57.900	1,574,880.000	
CME GROUP INC	10,100	202.730	2,047,573.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	22.550	263,699.700	
ECOLAB INC	7,550	186.670	1,409,358.500	
EQUIFAX INC	3,350	139.640	467,794.000	
GAP INC/THE	5,950	16.610	98,829.500	
GILEAD SCIENCES INC	35,950	67.240	2,417,278.000	

HORMEL FOODS CORP	8,350	44.530	371,825.500	
STATE STREET CORP	10,943	75.100	821,819.300	
SUNTRUST BANKS INC	12,948	70.840	917,236.320	
SCHWAB (CHARLES) CORP	34,000	49.500	1,683,000.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,600	81.970	1,114,792.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	46.570	225,864.500	
CROWN HOLDINGS INC	3,850	75.900	292,215.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,000	55.030	495,270.000	
FEDEX CORP	6,900	160.050	1,104,345.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	13,504	100.010	1,350,535.040	
FMC CORP	3,950	97.960	386,942.000	
FLEX LTD	14,750	11.870	175,082.500	
CERNER CORP	9,350	71.590	669,366.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,024	141.230	427,079.520	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	112.810	417,397.000	
INTEL CORP	126,650	58.050	7,352,032.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	11,500	22.400	257,600.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	10,350	61.860	640,251.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	9,450	174.330	1,647,418.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	6.980	321,778.000	
ILLUMINA INC	4,040	320.760	1,295,870.400	
SEALED AIR CORP	4,400	37.730	166,012.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,210	592.900	1,903,209.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	117.880	406,686.000	
SNAP-ON INC	1,550	160.460	248,713.000	
CARMAX INC	4,950	97.260	481,437.000	
COMERICA INC	4,500	70.410	316,845.000	
INGREDION INC	1,900	83.170	158,023.000	
DUKE ENERGY CORP	20,528	88.170	1,809,953.760	
TARGET CORP	14,400	125.010	1,800,144.000	
DOVER CORP	4,250	111.480	473,790.000	
WW GRAINGER INC	1,400	316.950	443,730.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,950	92.090	363,755.500	
CINTAS CORP	2,620	257.060	673,497.200	
CONAGRA BRANDS INC	13,800	28.870	398,406.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	83.980	344,318.000	
CLOROX COMPANY	3,750	148.230	555,862.500	

ENERGY CORP	5,400	116.390	628,506.000	
MICROSOFT CORP	205,650	151.380	31,131,297.000	
INCYTE CORP	5,350	94.160	503,756.000	
CVS HEALTH CORP	36,769	75.270	2,767,602.630	
MEDTRONIC PLC	37,938	111.390	4,225,913.820	
MICRON TECHNOLOGY INC	31,200	47.510	1,482,312.000	
BLACKROCK INC	3,200	494.910	1,583,712.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	14,900	24.560	365,944.000	
HASBRO INC	3,600	101.700	366,120.000	
KELLOGG CO	7,300	65.120	475,376.000	
KEYCORP	29,900	19.390	579,761.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,000	152.420	457,260.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	40,661	52.540	2,136,328.940	
KOHL'S CORP	4,950	47.010	232,699.500	
COOPER COS INC/THE	1,400	313.090	438,326.000	
APACHE CORP	10,610	22.280	236,390.800	
CHUBB LTD	12,949	151.480	1,961,514.520	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	79.640	191,136.000	
ALLSTATE CORP	9,600	111.350	1,068,960.000	
EBAY INC	23,350	35.520	829,392.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	31,500	108.010	3,402,315.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,150	78.370	325,235.500	
XILINX INC	7,150	92.780	663,377.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	34.170	220,396.500	
ZIONS BANCORP NA	5,200	49.780	258,856.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6,100	195.470	1,192,367.000	
TRIMBLE INC	7,050	40.530	285,736.500	
LENNAR CORP-A	8,100	59.650	483,165.000	
LEAR CORP	1,800	120.310	216,558.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	44.300	310,100.000	
PROGRESSIVE CORP	16,800	73.050	1,227,240.000	
PACCAR INC	10,037	81.370	816,710.690	
PVH CORP	2,000	96.960	193,920.000	
BIOGEN INC	5,610	299.810	1,681,934.100	
IDEXX LABORATORIES INC	2,520	251.580	633,981.600	
STARBUCKS CORP	34,250	85.430	2,925,977.500	
PTC INC	3,150	76.600	241,290.000	
PERRIGO CO PLC	3,800	51.230	194,674.000	

	EVERSOURCE ENERGY	8,880	82.640	733,843.200	
	INTUIT INC	7,340	258.890	1,900,252.600	
	BORGWARNER INC	6,300	42.050	264,915.000	
	BEST BUY CO INC	6,900	80.640	556,416.000	
	BALL CORP	9,184	66.060	606,695.040	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	39,297	43.250	1,699,595.250	
	ELECTRONIC ARTS INC	8,650	101.010	873,736.500	
	VULCAN MATERIALS CO	3,650	141.870	517,825.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,250	221.750	1,607,687.500	
	VF CORP	9,500	88.540	841,130.000	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	10,071	40.380	406,666.980	
	VIACOM INC-CLASS B	10,071	24.070	242,408.970	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	139.370	239,716.400	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,600	133.730	347,698.000	
	CARNIVAL CORP	11,850	45.080	534,198.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	128,190	44.150	5,659,588.500	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,700	31.750	212,725.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,700	56.220	376,674.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	5.850	52,650.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	35,300	5.500	194,150.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 762,122,552.250 (83,589,601,531)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	TUI AG-DI	13,797	10.635	146,731.090	
	BP PLC	575,000	4.802	2,761,150.000	
	UNILEVER PLC	31,760	45.780	1,453,972.800	
	BARCLAYS PLC	496,800	1.715	852,210.720	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	52,700	7.116	375,013.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,100	1.943	109,030.350	
	PRUDENTIAL PLC	75,700	13.765	1,042,010.500	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	145,791	2.262	329,779.240	
	EVRAZ PLC	15,000	3.704	55,560.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	28.740	174,279.360	
	BAE SYSTEMS PLC	94,300	5.734	540,716.200	
	AVIVA PLC	113,866	4.038	459,790.900	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	45.580	91,160.000	

GLAXOSMITHKLINE PLC	141,000	17.540	2,473,140.000	
INFORMA PLC	36,200	7.914	286,486.800	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	10,540	11.328	119,397.120	
MELROSE INDUSTRIES PLC	145,500	2.296	334,068.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	28,300	5.620	159,046.000	
DCC PLC	2,800	66.080	185,024.000	
OCADO GROUP PLC	13,500	13.250	178,875.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	89.250	187,425.000	
HALMA PLC	11,000	21.060	231,660.000	
GVC HOLDINGS PLC	16,700	8.516	142,217.200	
NMC HEALTH PLC	2,700	25.090	67,743.000	
JD SPORTS FASHION PLC	13,000	7.606	98,878.000	
M&G PLC	75,700	2.360	178,652.000	
RELX PLC	55,546	18.730	1,040,376.580	
DIAGEO PLC	67,500	31.650	2,136,375.000	
RIO TINTO PLC	32,250	42.015	1,354,983.750	
STANDARD CHARTERED PLC	82,100	6.974	572,565.400	
TESCO PLC	281,700	2.294	646,219.800	
SMITH & NEPHEW PLC	26,450	17.310	457,849.500	
GLENCORE PLC	324,525	2.439	791,516.470	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	18.550	151,182.500	
SMITHS GROUP PLC	11,383	16.610	189,071.630	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	3.054	128,216.080	
PEARSON PLC	23,563	6.466	152,358.350	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.143	116,204.170	
NEXT PLC	4,200	67.580	283,836.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.742	162,401.000	
WHITBREAD PLC	3,861	46.010	177,644.610	
BUNZL PLC	9,605	21.230	203,914.150	
VODAFONE GROUP PLC	766,183	1.533	1,175,018.240	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	49.800	182,317.800	
KINGFISHER PLC	62,411	2.099	131,000.680	
WPP PLC	38,400	10.005	384,192.000	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20,627	8.534	176,030.810	
SEVERN TRENT PLC	7,133	22.430	159,993.190	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	4.449	240,246.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	20,300	60.660	1,231,398.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	10.885	164,907.750	

SCHRODERS PLC	3,450	32.990	113,815.500	
SSE PLC	30,000	13.000	390,000.000	
WEIR GROUP PLC/THE	7,950	13.955	110,942.250	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	31,000	6.668	206,708.000	
ASTRAZENECA PLC	37,050	74.580	2,763,189.000	
FERGUSON PLC	7,087	67.220	476,388.140	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	183,000	2.809	514,047.000	
3I GROUP PLC	29,391	10.710	314,777.610	
ASHTAD GROUP PLC	13,650	23.500	320,775.000	
SAGE GROUP PLC/THE	32,314	7.538	243,582.930	
NATIONAL GRID PLC	98,134	8.897	873,098.190	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,081,465	0.611	1,272,815.840	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	5.514	175,124.640	
IMPERIAL BRANDS PLC	28,800	17.032	490,521.600	
CENTRICA PLC	176,160	0.802	141,315.550	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,600	45.860	165,096.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	65,010	30.600	1,989,306.000	
BHP GROUP PLC	60,527	17.100	1,035,011.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	10,600	25.690	272,314.000	
HSBC HOLDINGS PLC	571,650	5.763	3,294,418.950	
ANGLO AMERICAN PLC	31,083	20.265	629,896.990	
MONDI PLC	14,250	16.755	238,758.750	
WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.983	131,472.900	
CARNIVAL PLC	4,861	32.530	158,128.330	
EASYJET PLC	4,000	13.380	53,520.000	
COMPASS GROUP PLC	46,489	18.945	880,734.100	
PERSIMMON PLC	9,300	25.580	237,894.000	
BT GROUP PLC	246,100	1.915	471,429.160	
COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	25.790	149,582.000	
BURBERRY GROUP PLC	12,189	21.040	256,456.560	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,136	50.070	257,159.520	
INTERTEK GROUP PLC	4,800	55.160	264,768.000	
ITV PLC	102,100	1.451	148,147.100	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	9,199	68.720	632,155.280	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,300	22.110	2,726,163.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	105,718	21.895	2,314,695.610	

	MEGGITT PLC	24,100	6.430	154,963.000	
	G4S PLC	43,500	2.091	90,958.500	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,550	21.400	118,770.000	
	ANTOFAGASTA PLC	11,400	8.680	98,952.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	3.169	224,561.670	
	EXPERIAN PLC	26,154	25.630	670,327.020	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 51,516,577.330 (7,294,232,184)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	15.900	548,550.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	272.700	272,700.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	15.960	280,896.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	565.100	339,060.000	
	BANK HAPOALIM BM	30,700	27.650	848,855.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	45,200	24.910	1,125,932.000	
	NICE LTD	1,850	520.000	962,000.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	91.000	373,100.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 4,751,093.000 (149,944,495)	
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	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	78,800	3.260	256,888.000	
	BHP GROUP LTD	83,650	38.230	3,197,939.500	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.700	409,320.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.310	160,083.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	26,650	34.510	919,691.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	9.730	413,525.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	10.030	133,399.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	79,450	25.890	2,056,960.500	
	WESTPAC BANKING CORP	97,348	24.520	2,386,972.960	
	SANTOS LTD	53,100	8.150	432,765.000	
	AUSNET SERVICES	50,000	1.740	87,000.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	79,850	24.840	1,983,474.000	
	RIO TINTO LTD	10,500	96.900	1,017,450.000	
ORIGIN ENERGY LTD	53,500	8.700	465,450.000		
AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	5.780	346,800.000		

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	22.320	75,888.000	
COLES GROUP LTD	34,545	16.260	561,701.700	
WISETECH GLOBAL LTD	4,500	27.280	122,760.000	
OIL SEARCH LTD	38,400	7.440	285,696.000	
SEEK LTD	9,600	23.190	222,624.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	20,500	18.700	383,350.000	
NEWCREST MINING LTD	23,400	30.760	719,784.000	
INCITEC PIVOT LTD	49,800	3.230	160,854.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	50,150	80.820	4,053,123.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	34.560	247,104.000	
ORICA LTD	11,500	23.780	273,470.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	38,450	12.680	487,546.000	
CIMIC GROUP LTD	2,800	33.640	94,192.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	36,200	39.760	1,439,312.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	11.380	155,906.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	57,700	4.790	276,383.000	
CROWN RESORTS LTD	11,600	12.910	149,756.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	24,000	7.300	175,200.000	
TELSTRA CORP LTD	120,200	3.860	463,972.000	
AMP LTD	102,000	1.955	199,410.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13,350	28.960	386,616.000	
MACQUARIE GROUP LTD	9,184	138.050	1,267,851.200	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	17,450	33.920	591,904.000	
CSL LTD	12,750	283.480	3,614,370.000	
WESFARMERS LTD	32,300	42.370	1,368,551.000	
COCHLEAR LTD	1,650	233.990	386,083.500	
BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	14.550	237,165.000	
SUNCORP GROUP LTD	38,257	13.380	511,878.660	
BORAL LTD	35,800	5.140	184,012.000	
ASX LTD	5,800	81.710	473,918.000	
COMPUTERSHARE LTD	13,900	17.730	246,447.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.300	60,200.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	7.890	559,685.040	
SONIC HEALTHCARE LTD	13,250	30.120	399,090.000	
CHALLENGER LTD	17,400	8.140	141,636.000	
WORLEY LTD	9,400	15.000	141,000.000	
AGL ENERGY LTD	19,000	20.410	387,790.000	

	BRAMBLES LTD	47,400	12.550	594,870.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	44.030	61,642.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	4,250	72.980	310,165.000	
	TPG TELECOM LTD	8,700	6.990	60,813.000	
	REA GROUP LTD	1,600	104.360	166,976.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	52.490	199,462.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 37,167,875.560 (2,759,714,760)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	33.260	276,058.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,420.010	852,006.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	13.700	82,145.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	7,187	87.270	627,209.490	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13,200	36.500	481,800.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,050	136.970	554,728.500	
	BCE INC	4,530	63.940	289,648.200	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,700	130.670	744,819.000	
	SUNCOR ENERGY INC	44,430	41.430	1,840,734.900	
	METRO INC/CN	7,700	58.180	447,986.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,500	71.150	675,925.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	34,600	74.940	2,592,924.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,550	115.460	1,449,023.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	51,600	76.590	3,952,044.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	33.450	277,635.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	40,550	108.730	4,409,001.500	
	TC ENERGY CORP	26,150	67.200	1,757,280.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	14,629	46.380	678,493.020	
	BOMBARDIER INC-B	62,800	1.970	123,716.000	
	BARRICK GOLD CORP	51,400	22.180	1,140,052.000	
	CAE INC	7,900	35.690	281,951.000	
	THOMSON REUTERS CORP	5,812	92.880	539,818.560	
	EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	35.570	188,521.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	57.770	92,432.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	56.810	264,166.500	
	HYDRO ONE LTD	9,200	25.020	230,184.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	71.600	390,936.000	

WSP GLOBAL INC	3,000	85.730	257,190.000	
PARKLAND FUEL CORP	4,400	47.220	207,768.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.940	174,582.000	
EMERA INC	7,200	54.620	393,264.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	39.060	156,240.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,600	64.420	682,852.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,200	78.920	568,224.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	31.830	200,529.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	15,000	18.630	279,450.000	
AIR CANADA	4,100	50.050	205,205.000	
KINROSS GOLD CORP	37,900	5.740	217,546.000	
BANK OF MONTREAL	18,000	102.220	1,839,960.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	32.240	303,056.000	
METHANEX CORP	1,700	49.430	84,031.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,800	445.450	1,247,260.000	
NUTRIEN LTD	16,519	62.700	1,035,741.300	
AURORA CANNABIS INC	19,800	3.320	65,736.000	
CANOPY GROWTH CORP	6,200	24.510	151,962.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	9.030	49,665.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	55.790	323,582.000	
CAMECO CORP	10,600	12.100	128,260.000	
TELUS CORP	5,400	50.150	270,810.000	
POWER FINANCIAL CORP	8,000	32.480	259,840.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	20.800	314,080.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	154.760	278,568.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	35,100	37.110	1,302,561.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	600.010	480,008.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	73.180	673,256.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,237	108.040	241,685.480	
BLACKBERRY LTD	16,000	7.330	117,280.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	17,450	60.610	1,057,644.500	
ENBRIDGE INC	57,100	50.300	2,872,130.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	23,950	76.850	1,840,557.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	56,000	26.130	1,463,280.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	9,500	37.520	356,440.000	
ENCANA CORP	36,800	5.210	191,728.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,900	314.570	1,226,823.000	

	IA FINANCIAL CORP INC	3,300	68.000	224,400.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	39.000	245,700.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	20,450	120.610	2,466,474.500	
	CGI INC - CLASS A	7,300	110.070	803,511.000	
	HUSKY ENERGY INC	9,358	9.670	90,491.860	
	ONEX CORPORATION	2,600	79.100	205,660.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	13,800	27.450	378,810.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	38.200	91,680.000	
	OPEN TEXT CORP	8,100	57.830	468,423.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	20.920	146,440.000	
	SAPUTO INC	7,100	40.150	285,065.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	12.150	234,495.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25,600	43.460	1,112,576.000	
	FORTIS INC	13,000	52.040	676,520.000	
	LUNDIN MINING CORP	19,400	7.190	139,486.000	
	CENOVUS ENERGY INC	31,400	11.740	368,636.000	
	DOLLARAMA INC	9,000	48.590	437,310.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	50.390	110,858.000	
	ALTAGAS LTD	7,900	19.700	155,630.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	21.580	103,584.000	
	KEYERA CORP	6,000	32.410	194,460.000	
	INTER PIPELINE LTD	12,800	22.000	281,600.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 55,981,843.010 (4,625,219,869)	
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	34,800	25.820	898,536.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	49,700	25.250	1,254,925.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.190	137,574.300	
	KEPPEL CORP LTD	42,900	6.720	288,288.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.760	108,640.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	13,600	10.340	140,624.000	
	CAPITALAND LTD	77,500	3.680	285,200.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	69,300	1.030	71,379.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	51,400	2.200	113,080.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	30.640	82,728.000	

	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	93,700	10.780	1,010,086.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.925	157,250.000	
	VENTURE CORP LTD	8,600	15.870	136,482.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	225,450	3.380	762,021.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	4.130	181,720.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.190	63,072.000	
	SATS LTD	19,600	4.980	97,608.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	23,300	8.850	206,205.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	64,800	2.350	152,280.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58,900	4.090	240,901.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,388,599.300 (512,429,550)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFREY AG-REG	1,250	97.580	121,975.000	
	UBS GROUP AG-REG	110,400	12.120	1,338,048.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	620.500	142,715.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,650	61.820	287,463.000	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	19,940	308.200	6,145,508.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	78.900	86,790.000	
	SIKA AG-REG	3,840	174.050	668,352.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	85,300.000	255,900.000	
	ABB LTD-REG	53,800	21.870	1,176,606.000	
	SWISS RE AG	9,000	108.300	974,700.000	
	NESTLE SA-REG	86,900	103.920	9,030,648.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	520	843.200	438,464.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	249.300	314,118.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	75,170	13.105	985,102.850	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	47.080	301,312.000	
	SGS SA-REG	160	2,602.000	416,320.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	239.200	138,736.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,300	178.300	231,790.000	
	TEMENOS AG - REG	1,970	151.700	298,849.000	
	ALCON INC	12,430	55.210	686,260.300	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	280.000	238,000.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,472	392.300	1,754,365.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	173.800	241,582.000	

	CLARIANT AG-REG	5,700	20.660	117,762.000	
	NOVARTIS AG-REG	61,050	92.060	5,620,263.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	70	2,010.000	140,700.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	15,310	76.160	1,166,009.600	
	SWISSCOM AG-REG	770	517.600	398,552.000	
	GEBERIT AG-REG	1,130	536.800	606,584.000	
	GIVAUDAN-REG	260	2,939.000	764,140.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	962.000	278,980.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,690	228.300	385,827.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,200	339.600	747,120.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	53.300	81,016.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	14,290	51.560	736,792.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	495.800	515,632.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,670	162.600	271,542.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,330	105.600	246,048.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,625.000	259,250.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 38,609,822.750 (4,231,250,475)	
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	2,700	418.000	1,128,600.000	
	ERICSSON LM-B SHS	85,630	86.300	7,389,869.000	
	VOLVO AB-B SHS	41,400	148.050	6,129,270.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	428.400	771,120.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	182.900	1,929,595.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	246.100	1,636,565.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,900	458.700	2,247,630.000	
	TELE2 AB-B SHS	15,600	141.300	2,204,280.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	48,250	82.120	3,962,290.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	46,550	94.000	4,375,700.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	26,600	124.700	3,317,020.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	184.840	4,352,982.000	
	SKANSKA AB-B SHS	10,250	211.600	2,168,900.000	
	SANDVIK AB	33,150	174.150	5,773,072.500	
	INVESTOR AB-B SHS	12,700	506.200	6,428,740.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,450	350.900	6,474,105.000	
	SECURITAS AB-B SHS	9,550	158.800	1,516,540.000	

	TELIA CO AB	83,000	41.450	3,440,350.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	235.600	2,073,280.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	11,250	309.600	3,483,000.000	
	ASSA ABLOY AB-B	29,350	227.400	6,674,190.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	379.600	835,120.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	295.200	1,549,800.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	16,850	301.000	5,071,850.000	
	BOLIDEN AB	7,800	247.000	1,926,600.000	
	EPIROC AB-A	20,650	111.800	2,308,670.000	
	EPIROC AB-B	11,600	107.650	1,248,740.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	74.780	856,231.000	
	NORDEA BANK ABP	89,700	67.830	6,084,351.000	
	KINNEVIK AB - B	7,300	219.300	1,600,890.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,200	541.400	3,898,080.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	222.100	1,021,660.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 103,879,090.500 (1,190,454,377)	
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	50,600	381.200	19,288,720.000	
	DANSKE BANK A/S	18,400	91.560	1,684,704.000	
	ISS A/S	4,400	155.650	684,860.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	8,805.000	836,475.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	259.800	441,660.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,600	645.400	3,614,240.000	
	CARLSBERG AS-B	3,000	975.600	2,926,800.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,400	324.000	2,073,600.000	
	COLOPLAST-B	3,350	801.200	2,684,020.000	
	DSV PANALPINA A/S	6,210	738.400	4,585,464.000	
	DEMANT A/S	3,425	207.500	710,687.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	200	9,478.000	1,895,600.000	
	TRYG A/S	3,300	195.000	643,500.000	
	PANDORA A/S	3,150	273.000	859,950.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,050	515.000	1,570,750.000	
	GENMAB A/S	1,950	1,580.000	3,081,000.000	
	ORSTED A/S	5,500	625.000	3,437,500.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 51,019,530.500 (824,985,808)	

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	4.710	162,495.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	4.800	110,400.000	
	A2 MILK CO LTD	21,400	15.520	332,128.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	4.540	239,208.060	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	9.030	265,482.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.230	105,123.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	18,700	22.150	414,205.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	15.100	178,180.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,807,221.060 (127,644,023)	
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	41,700	32.600	1,359,420.000	
	DNB ASA	28,100	154.800	4,349,880.000	
	ORKLA ASA	21,950	89.260	1,959,257.000	
	TELENOR ASA	20,800	168.200	3,498,560.000	
	EQUINOR ASA	27,973	169.800	4,749,815.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	347.500	1,723,600.000	
	MOWI ASA	12,850	228.600	2,937,510.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	173.450	962,647.500	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	237.600	736,560.000	
AKER BP ASA	2,900	264.300	766,470.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 23,043,719.900 (274,220,267)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	26,820	68.700	1,842,534.000	
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	26.340	139,602.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	59,350	6.544	388,386.400	
	COMMERZBANK AG	28,135	5.261	148,018.230	
	VOLKSWAGEN AG	890	173.150	154,103.500	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	5,270	175.480	924,779.600	
	SIEMENS AG-REG	21,750	117.120	2,547,360.000	
	E.ON SE	64,200	9.498	609,771.600	
UNIPER SE	5,950	29.300	174,335.000		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,850	73.300	722,005.000		

GEA GROUP AG	4,500	29.170	131,265.000	
CONTINENTAL AG	3,170	118.600	375,962.000	
BASF SE	26,170	68.220	1,785,317.400	
ALLIANZ SE-REG	12,040	217.350	2,616,894.000	
THYSSENKRUPP AG	11,450	11.380	130,301.000	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,200	95.880	498,576.000	
RWE AG	16,250	26.910	437,287.500	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	17.220	114,513.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	77.320	91,237.600	
BRENNTAG AG	4,700	48.410	227,527.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,200	49.640	605,608.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	30.750	102,090.000	
HOCHTIEF AG	710	111.500	79,165.000	
SAP SE	27,992	123.480	3,456,452.160	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,160	260.600	1,084,096.000	
ZALANDO SE	3,550	39.100	138,805.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	4,500	67.100	301,950.000	
KION GROUP AG	1,850	60.220	111,407.000	
WIRECARD AG	3,470	119.800	415,706.000	
COVESTRO AG	5,200	42.500	221,000.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,050	191.300	200,865.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,650	67.180	312,387.000	
DELIVERY HERO SE	3,200	48.000	153,600.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	111.000	138,750.000	
METRO AG	5,000	14.625	73,125.000	
AROUNDTOWN SA	27,100	7.882	213,602.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,500	44.020	198,090.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	88.280	128,006.000	
BEIERSDORF AG	3,090	105.850	327,076.500	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	39.200	76,440.000	
MERCK KGAA	3,750	106.000	397,500.000	
ADIDAS AG	5,120	282.750	1,447,680.000	
PUMA SE	2,360	68.200	160,952.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,100	87.800	272,180.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	95,950	15.236	1,461,894.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,270	66.560	417,331.200	

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	26,100	51.200	1,336,320.000	
QIAGEN N.V.	6,498	38.860	252,512.280	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	37,150	19.388	720,264.200	
HANNOVER RUECK SE	1,730	168.500	291,505.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	29,200	33.840	988,128.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,640	139.250	785,370.000	
LANXESS AG	2,500	60.500	151,250.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,530	245.900	376,227.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	10,600	35.450	375,770.000	
SYMRISE AG	3,920	88.040	345,116.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.771	72,877.300	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,550	56.000	86,800.000	
VONOVIA SE	15,300	47.290	723,537.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	26,426	42.145	1,113,723.770	
NN GROUP NV	9,050	34.840	315,302.000	
ARCELORMITTAL	20,300	15.528	315,218.400	
HEINEKEN NV	7,600	94.040	714,704.000	
AEGON NV	53,644	4.092	219,511.240	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	33,633	23.385	786,507.700	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	86.920	568,282.960	
KONINKLIJKE DSM NV	5,300	116.300	616,390.000	
WOLTERS KLUWER	8,300	65.160	540,828.000	
ING GROEP NV	111,050	10.444	1,159,806.200	
KONINKLIJKE KPN NV	100,950	2.796	282,256.200	
ASML HOLDING NV	12,060	247.000	2,978,820.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	11,700	15.490	181,233.000	
GALAPAGOS NV	1,300	178.850	232,505.000	
ADYEN NV	300	696.200	208,860.000	
UNILEVER NV	41,600	53.800	2,238,080.000	
PROSUS NV	14,500	61.870	897,115.000	
VOPAK	1,900	48.390	91,941.000	
RANDSTAD NV	3,200	52.860	169,152.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,400	87.000	295,800.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	5.402	110,741.000	
JCDECAUX SA	1,900	26.000	49,400.000	

TOTAL SA	67,950	47.640	3,237,138.000	
MICHELIN (CGDE)	5,000	108.900	544,500.000	
AIR LIQUIDE SA	13,477	123.050	1,658,344.850	
KERING	2,180	546.700	1,191,806.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,650	87.600	1,370,940.000	
BOUYGUES SA	6,700	37.080	248,436.000	
BNP PARIBAS	32,050	50.970	1,633,588.500	
PEUGEOT SA	17,550	21.920	384,696.000	
NATIXIS	29,550	3.793	112,083.150	
THALES SA	3,230	88.920	287,211.600	
DANONE	17,600	74.720	1,315,072.000	
CARREFOUR SA	17,000	14.980	254,660.000	
SUEZ	9,925	13.435	133,342.370	
VIVENDI	26,891	24.920	670,123.720	
L'OREAL	7,170	258.700	1,854,879.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	14,550	36.750	534,712.500	
LEGRAND SA	8,017	71.680	574,658.560	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	39.940	61,907.000	
PERNOD RICARD SA	6,087	166.700	1,014,702.900	
EURAZEO SE	1,254	61.850	77,559.900	
SOCIETE GENERALE SA	22,050	28.560	629,748.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,930	407.300	3,229,889.000	
ACCOR SA	5,350	38.830	207,740.500	
CAPGEMINI SE	4,770	107.350	512,059.500	
VALEO SA	7,150	35.760	255,684.000	
PUBLICIS GROUPE	6,400	39.940	255,616.000	
BUREAU VERITAS SA	8,800	23.760	209,088.000	
EIFFAGE	2,340	99.100	231,894.000	
SODEXO SA	2,700	105.800	285,660.000	
IPSEN	1,150	102.500	117,875.000	
INGENICO GROUP	1,800	96.860	174,348.000	
AMUNDI SA	1,700	68.700	116,790.000	
TELEPERFORMANCE	1,770	215.000	380,550.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,450	55.100	134,995.000	
FAURECIA	2,250	48.140	108,315.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	476.600	152,512.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	144.100	115,280.000	
SEB SA	650	141.000	91,650.000	

ESSILORLUXOTTICA	8,300	141.000	1,170,300.000	
DASSAULT AVIATION SA	80	1,235.000	98,800.000	
WORLDLINE SA	2,364	58.750	138,885.000	
AXA SA	55,350	24.695	1,366,868.250	
EDENRED	6,900	45.050	310,845.000	
RENAULT SA	5,800	43.455	252,039.000	
HERMES INTERNATIONAL	900	680.000	612,000.000	
STMICROELECTRONICS NV	19,950	22.300	444,885.000	
REMY COINTREAU	630	116.900	73,647.000	
ATOS SE	2,960	77.080	228,156.800	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,980	143.000	569,140.000	
WENDEL	780	122.300	95,394.000	
ORANGE	58,300	15.000	874,500.000	
ALSTOM	4,450	39.580	176,131.000	
CNP ASSURANCES	4,850	17.920	86,912.000	
SANOFI	31,875	84.510	2,693,756.250	
VINCI SA	14,550	98.980	1,440,159.000	
AIRBUS SE	16,550	133.400	2,207,770.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	16,450	23.240	382,298.000	
CREDIT AGRICOLE SA	34,300	12.415	425,834.500	
BIOMERIEUX	1,150	82.050	94,357.500	
ENGIE	52,123	14.360	748,486.280	
EDF	17,050	9.324	158,974.200	
SES	11,000	12.045	132,495.000	
SAFRAN SA	9,320	148.450	1,383,554.000	
ILIAD SA	740	115.550	85,507.000	
ARKEMA	1,920	94.060	180,595.200	
ADP	910	177.500	161,525.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	14.890	69,983.000	
SCOR SE	4,950	38.990	193,000.500	
GETLINK SE	12,400	15.310	189,844.000	
BOLLORE	24,100	3.880	93,508.000	
UCB SA	3,550	73.560	261,138.000	
KBC GROUP NV	7,450	66.140	492,743.000	
COLRUYT SA	1,600	47.000	75,200.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	92.100	202,620.000	
SOLVAY SA	2,200	104.000	228,800.000	
UMICORE	5,800	38.980	226,084.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	21,600	71.870	1,552,392.000	

AGEAS	5,240	54.480	285,475.200	
PROXIMUS	4,100	27.380	112,258.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	40.960	59,392.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	20.690	141,726.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,543	18.530	584,491.790	
MEDIOBANCA SPA	17,065	10.150	173,209.750	
TENARIS SA	13,300	9.652	128,371.600	
UNICREDIT SPA	57,656	12.562	724,274.670	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.568	149,426.370	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.559	96,120.050	
INTESA SANPAOLO	426,237	2.300	980,558.210	
ATLANTIA SPA	14,657	20.120	294,898.840	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	10.590	169,440.000	
MONCLER SPA	5,150	39.770	204,815.500	
RECORDATI SPA	3,050	38.070	116,113.500	
ENI SPA	72,500	13.714	994,265.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.285	134,217.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.150	56,650.000	
LEONARDO SPA	10,975	10.615	116,499.620	
ENEL SPA	230,734	6.856	1,581,912.300	
SNAM SPA	61,600	4.512	277,939.200	
TERNA SPA	42,800	5.830	249,524.000	
EXOR NV	3,230	69.440	224,291.200	
CNH INDUSTRIAL NV	29,800	9.728	289,894.400	
FINECOBANK SPA	18,000	11.260	202,680.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	32,350	13.420	434,137.000	
FERRARI NV	3,495	153.400	536,133.000	
TELEFONICA SA	132,027	6.952	917,851.700	
ENDESA SA	9,250	24.680	228,290.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	191,012	4.781	913,323.870	
IBERDROLA SA	170,334	8.928	1,520,741.950	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	1.007	161,229.760	
BANKINTER SA	18,300	6.348	116,168.400	
REPSOL SA	41,800	14.290	597,322.000	
GRIFOLS SA	8,500	31.010	263,585.000	
BANCO SANTANDER SA	477,250	3.537	1,688,033.250	
AMADEUS IT GROUP SA	12,350	72.300	892,905.000	

NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	23.600	221,840.000	
MAPFRE SA	30,650	2.559	78,433.350	
CAIXABANK SA	109,300	2.679	292,814.700	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	35.330	278,259.080	
AENA SME SA	2,000	166.700	333,400.000	
CELLNEX TELECOM SA	5,800	39.000	226,200.000	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	32,300	28.260	912,798.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	14.485	96,325.250	
ENAGAS SA	6,900	22.610	156,009.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	12,550	17.750	222,762.500	
FERROVIAL SA	14,200	26.950	382,690.000	
BANKIA SA	30,105	1.758	52,939.640	
UPM-KYMMENE OYJ	15,600	30.320	472,992.000	
NOKIA OYJ	158,500	3.211	509,022.750	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	9.136	109,632.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	17,050	12.200	208,010.000	
METSO OYJ	2,800	34.800	97,440.000	
ELISA OYJ	4,150	48.510	201,316.500	
SAMPO OYJ-A SHS	12,500	36.700	458,750.000	
FORTUM OYJ	13,850	21.390	296,251.500	
KONE OYJ-B	9,900	56.820	562,518.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	3,650	24.560	89,644.000	
NESTE OYJ	12,050	30.680	369,694.000	
ORION OYJ-CLASS B	2,750	39.500	108,625.000	
VERBUND AG	2,000	47.180	94,360.000	
OMV AG	4,450	51.740	230,243.000	
ERSTE GROUP BANK AG	8,700	32.500	282,750.000	
VOESTALPINE AG	2,850	24.050	68,542.500	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	21.310	72,454.000	
ANDRITZ AG	2,100	35.400	74,340.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,800	32.200	218,960.000	
AIB GROUP PLC	23,000	2.970	68,310.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.560	125,217.600	
KINGSPAN GROUP PLC	4,400	48.920	215,248.000	
JERONIMO MARTINS	6,000	14.495	86,970.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	74,700	3.670	274,149.000	

	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	14.775	206,111.250	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	116.400	531,948.000	
	CRH PLC	23,100	34.730	802,263.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	104.000	228,800.000	
ユーロ 小計				ユーロ 118,633,771.920 (14,338,077,674)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	40,500	54.450	2,205,225.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	51.200	3,328,000.000	
	MTR CORP	45,500	43.900	1,997,450.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	45,500	113.900	5,182,450.000	
	SINO LAND CO	90,000	11.740	1,056,600.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	77,169	71.100	5,486,715.900	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	70.450	1,091,975.000	
	CLP HOLDINGS LTD	47,000	80.700	3,792,900.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	43,507	37.650	1,638,038.550	
	HONG KONG & CHINA GAS	290,199	14.920	4,329,769.080	
	HANG SENG BANK LTD	22,500	159.600	3,591,000.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	24,000	48.650	1,167,600.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	183,000	10.220	1,870,260.000	
	WH GROUP LTD	295,000	8.040	2,371,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	33,700	247.200	8,330,640.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	16.040	914,280.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	9,300	102.200	950,460.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	23.150	439,850.000	
	NWS HOLDINGS LTD	42,500	10.500	446,250.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	17,500	25.250	441,875.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	36,640	17.660	647,062.400	
	SJM HOLDINGS LTD	58,000	7.980	462,840.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	24.350	793,810.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	74,169	52.050	3,860,496.450	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	53.000	1,060,000.000	
	PCCW LTD	117,000	4.720	552,240.000	
	AIA GROUP LTD	373,000	78.400	29,243,200.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	43.450	1,564,200.000	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	30.100	662,200.000	

BUDWEISER BREWING CO APAC LT	34,400	27.900	959,760.000	
SANDS CHINA LTD	72,000	37.000	2,664,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	41,000	58.850	2,412,850.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	107,500	26.600	2,859,500.000	
WYNN MACAU LTD	42,000	17.220	723,240.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 99,098,537.380 (1,388,370,509)	
合計			121,306,145,522 [121,306,145,522]	

## (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	3,867	829,123.470	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,887	1,343,803.270	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,250	588,795.000	
		VORNADO REALTY TRUST	5,097	329,113.290	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,150	744,880.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	10,700	910,570.000	
		EQUINIX INC	2,288	1,296,952.800	
		AMERICAN TOWER CORP	12,450	2,664,673.500	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	21,943	383,783.070	
		KIMCO REALTY CORP	12,600	272,412.000	
		INVITATION HOMES INC	12,700	387,731.000	
		VICI PROPERTIES INC	13,500	333,855.000	
		VENTAS INC	10,500	612,255.000	
		WEYERHAEUSER CO	21,164	624,549.640	
		AGNC INVESTMENT CORP	15,300	264,996.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	11,750	1,570,505.000	
		IRON MOUNTAIN INC	8,210	263,705.200	
		VEREIT INC	29,300	285,968.000	
		SUN COMMUNITIES INC	2,750	452,952.500	
		PROLOGIS INC	17,812	1,630,688.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,070	498,936.400	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	2,900	323,495.000	
		DUKE REALTY CORP	10,200	358,836.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,950	608,751.000	

	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,200	290,554.000	
	WELLTOWER INC	11,450	968,326.500	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14,350	500,528.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,400	271,128.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,250	442,357.500	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,800	355,584.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43,700	407,721.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,550	253,617.000	
	REALTY INCOME CORP	8,900	682,007.000	
	PUBLIC STORAGE	4,370	920,671.600	
	REGENCY CENTERS CORP	4,950	321,948.000	
	SL GREEN REALTY CORP	2,400	204,792.000	
	UDR INC	8,100	389,205.000	
	WP CAREY INC	5,100	425,442.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,400	268,992.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,050	731,747.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,750	397,687.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13,000	269,880.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 25,683,519.840 (2,816,968,456)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	207,608.600	
	SEGRO PLC	33,150	296,361.000	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	147,065.800	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 651,035.400 (92,180,102)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	17,000	328,270.000	
	TRANSURBAN GROUP	76,500	1,174,275.000	
	SYDNEY AIRPORT	33,300	305,694.000	
	APA GROUP	35,800	393,800.000	
	SCENTRE GROUP	153,922	606,452.680	
	DEXUS	33,150	405,424.500	
	GPT GROUP	56,160	345,384.000	
	MIRVAC GROUP	111,600	376,092.000	
	STOCKLAND	72,000	363,600.000	

	GOODMAN GROUP	50,100	742,482.000	
	VICINITY CENTRES	99,273	266,051.640	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,307,525.820 (394,083,792)	
カナダ・ドル	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	67,263.000	カナダ・ドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	133,056.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	79,846.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	127,558.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 407,723.000 (33,686,074)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79,600	159,996.000	シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76,000	226,480.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	77,200	194,544.000	
	SUNTEC REIT	63,000	115,920.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	154,580.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 851,520.000 (68,300,419)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,950	560,505.000	ユーロ
	ICADE	950	86,307.500	
	GECINA SA	1,400	219,520.000	
	KLEPIERRE	6,250	203,562.500	
	COVIVIO	1,270	127,508.000	
ユーロ 小計			ユーロ 1,197,403.000 (144,718,127)	
香港・ドル	LINK REIT	62,500	5,000,000.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	575,250.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107,000	1,228,360.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 6,803,610.000 (95,318,576)	
投資証券 合計			3,645,255,546 [3,645,255,546]	

合計		3,645,255,546	[3,645,255,546]
----	--	---------------	-----------------

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 612銘柄 投資証券 42銘柄	96.7%	3.3%	69.1%
イギリス・ポンド	株式 93銘柄 投資証券 3銘柄	98.8%	1.2%	5.9%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄 投資証券 11銘柄	87.5%	12.5%	2.5%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 4銘柄	99.3%	0.7%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資証券 5銘柄	88.2%	11.8%	0.5%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100%	-%	3.4%
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%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 235銘柄 投資証券 5銘柄	99.0%	1.0%	11.6%
香港・ドル	株式 34銘柄 投資証券 3銘柄	93.6%	6.4%	1.2%

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	71,246,230	46,071,542
金銭信託	25,403,519	-
コール・ローン	49,403,934	35,988,024
株式	5,197,515,682	7,638,071,305
投資証券	924,423,814	516,963,253
派生商品評価勘定	185,864	1,395,130
未収配当金	4,372,749	5,282,299
差入委託証拠金	25,163,666	24,985,862
流動資産合計	6,297,715,458	8,268,757,415
資産合計	6,297,715,458	8,268,757,415
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,297,173	410,784
未払金	79,310,744	-
未払解約金	3,000,000	4,530,000
その他未払費用	349	22
流動負債合計	83,608,266	4,940,806
負債合計	83,608,266	4,940,806
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,983,740,010	5,229,878,945
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,230,367,182	3,033,937,664
元本等合計	6,214,107,192	8,263,816,609
純資産合計	6,214,107,192	8,263,816,609
負債純資産合計	6,297,715,458	8,268,757,415

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>2017年12月1日</p> <p>2,723,283,667円</p> <p>1,553,881,551円</p> <p>293,425,208円</p>	<p>2018年12月1日</p> <p>3,983,740,010円</p> <p>1,604,258,721円</p> <p>358,119,786円</p>
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）	6,993,217円	12,116,644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）	217,532,771円	224,767,012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）	209,548,098円	224,901,804円
D - I ' s 新興国株式インデッ クス	86,296,597円	105,608,121円
i F r e e 新興国株式イン デックス	1,278,144,286円	1,877,009,457円
i F r e e 8資産バランス	874,470,592円	1,391,517,281円
D Cダイワ新興国株式ファンダ メンタル・インデックスファン ド	891,898,319円	950,189,602円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	356,982,553円	375,541,562円

	ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	61,873,577円	68,227,462円
計		3,983,740,010円	5,229,878,945円
2.	期末日における受益権の総数	3,983,740,010口	5,229,878,945口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	14,126,307	43,383,764
投資証券	948,947	12,369,553
合計	15,075,254	31,014,211

（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（2018年7月6日から2018年11月30日まで、及び2019年7月6日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買 建	58,153,375	-	56,859,817	1,293,558	95,786,286	-	96,770,664	984,378
合計	58,153,375	-	56,859,817	1,293,558	95,786,286	-	96,770,664	984,378

（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	2018年11月30日 現在				2019年12月2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	26,085	-	26,085	0	7,923	-	7,923	0
インドネシ ア・ルピア	26,085	-	26,085	0	-	-	-	-
チリ・ペソ	-	-	-	-	7,923	-	7,923	0
買 建	39,520,195	-	39,702,444	182,249	7,923	-	7,891	32
アメリカ・ドル	34,997,370	-	35,165,444	168,074	7,923	-	7,891	32
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	39,546,280	-	39,728,529	182,249	15,846	-	15,814	32

### (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.5599円	1.5801円
(1万口当たり純資産額)	(15,599円)	(15,801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	16,400	5.632	92,364.800	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	4,100	200.000	820,000.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,400	118.530	284,472.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	12,000	12.780	153,360.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	26,450	9.440	249,688.000	
	JD.COM INC-ADR	9,700	32.650	316,705.000	
	NETEASE INC-ADR	600	315.320	189,192.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	4,500	33.240	149,580.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	89,306	1.380	123,242.280	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	3,090	20.140	62,232.600	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,820	68.960	332,387.200	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	29,600	6.775	200,540.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	12,970	26.250	340,462.500	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	18,700	11.415	213,460.500	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	98,245	0.788	77,417.060	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	79,960	14.630	1,169,814.800		

	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,100	198.000	217,800.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	18,690	95.360	1,782,278.400	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	58,280	6.780	395,138.400	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	226,870	7.944	1,802,255.280	
	SEVERSTAL - GDR REG S	8,600	14.050	120,830.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	4,540	10.756	48,832.680	
	ALROSA PJSC	79,160	1.214	96,141.710	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	66,009	1.647	108,779.390	
	AEROFLOT PJSC	58,060	1.603	93,090.960	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 9,440,065.560 (1,035,386,391)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	12,150	427.500	5,194,125.000	
	AXIS BANK LTD	22,180	739.050	16,392,129.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,180	7,245.850	8,550,103.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,490	2,035.300	5,067,897.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	55,190	282.600	15,596,694.000	
	STATE BANK OF INDIA	63,460	341.850	21,693,801.000	
	NTPC LTD	81,800	116.350	9,517,430.000	
	POWER FINANCE CORPORATION	30,580	114.500	3,501,410.000	
	JSW STEEL LTD	30,560	261.550	7,992,968.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	130,490	131.400	17,146,386.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	53,235	511.550	27,232,364.250	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	23,790	26.400	628,056.000	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,050	1,127.200	3,437,960.000	
	TECH MAHINDRA LTD	4,220	761.450	3,213,319.000	
	YES BANK LTD	23,520	68.300	1,606,416.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	31,820	71.350	2,270,357.000	
	REC LTD	45,870	137.900	6,325,473.000	
	COAL INDIA LTD	47,000	205.250	9,646,750.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	11,440	276.300	3,160,872.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	7,900	290.500	2,294,950.000	
	GAIL INDIA LTD	20,906	126.050	2,635,201.300	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	47,810	200.150	9,569,171.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	10,680	787.050	8,405,694.000	

	WIPRO LTD	13,653	237.700	3,245,318.100	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	7,286	2,053.250	14,959,979.500	
	INFOSYS LTD	43,360	696.350	30,193,736.000	
	LARSEN & TOUBRO LTD	5,572	1,330.550	7,413,824.600	
	TATA MOTORS LTD	106,680	161.500	17,228,820.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	15,170	2,297.250	34,849,282.500	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	38,570	1,551.150	59,827,855.500	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	89,035	131.750	11,730,361.250	
	ITC LTD	31,100	246.400	7,663,040.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	13,490	530.550	7,157,119.500	
	HERO MOTOCORP LTD	2,240	2,433.550	5,451,152.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	38,622	442.450	17,088,303.900	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,240	449.850	6,855,714.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	7,570	1,127.650	8,536,310.500	
	VEDANTA LTD	103,570	144.600	14,976,222.000	
インド・ルピー 小計				インド・ルピー 438,256,566.400 (674,915,112)	
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	28,400	20,925.000	594,270,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	389,100	6,500.000	2,529,150,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	47,000	11,450.000	538,150,000.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	77,000	7,950.000	612,150,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	972,700	3,930.000	3,822,711,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	172,700	7,500.000	1,295,250,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	66,100	31,400.000	2,075,540,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	365,300	6,975.000	2,547,967,500.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	301,500	1,920.000	578,880,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	807,600	4,090.000	3,303,084,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	472,900	1,230.000	581,667,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 18,478,819,500.000 (144,134,792)	

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	47,700	1.030	49,131.000	
シンガポール・ドル	小計			シンガポール・ドル 49,131.000 (3,940,797)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	10,200	177.500	1,810,500.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	20,200	381.000	7,696,200.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	16,000	155.000	2,480,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	7,800	155.000	1,209,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	68,800	121.000	8,324,800.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	30,200	55.750	1,683,650.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	24,800	212.000	5,257,600.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	224,800	16.400	3,686,720.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	123,300	11.600	1,430,280.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	38,400	120.000	4,608,000.000	
	IRPC PCL - NVDR	284,300	3.500	995,050.000	
	PTT PCL-NVDR	465,100	43.250	20,115,575.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	47,100	69.000	3,249,900.000	
	CP ALL PCL-NVDR	52,700	76.000	4,005,200.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	131,600	27.500	3,619,000.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	76,800	53.750	4,128,000.000	
タイ・パーツ	小計			タイ・パーツ 74,299,475.000 (269,707,094)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	ENEL CHILE SA	487,797	60.390	29,458,060.830	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	9,970	8,449.000	84,236,530.000	
	CENCOSUD SA	57,850	1,025.000	59,296,250.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	983,090	42.970	42,243,377.300	
	ENEL AMERICAS SA	700,793	154.440	108,230,470.920	
	EMPRESAS CMPC SA	16,880	1,745.000	29,455,600.000	
	S.A.C.I. FALABELLA	13,150	3,229.900	42,473,185.000	
	EMPRESAS COPEC SA	4,630	6,400.000	29,632,000.000	
	BANCO DE CHILE	396,692	81.700	32,409,736.400	
チリ・ペソ	小計			チリ・ペソ 457,435,210.450	

				(61,982,471)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	114,760	10.100	1,159,076.000	
	AKBANK T.A.S.	149,272	7.770	1,159,843.440	
	TURKIYE IS BANKASI-C	127,100	6.150	781,665.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	55,810	13.560	756,783.600	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	5,580	123.900	691,362.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	50,791	8.020	407,343.820	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	80,390	9.100	731,549.000	
	TURKIYE HALK BANKASI	100,250	5.770	578,442.500	
	YAPI VE KREDI BANKASI	107,560	2.400	258,144.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	79,510	5.130	407,886.300	
	KOC HOLDING AS	44,675	20.020	894,393.500	
	TURK HAVA YOLLARI AO	48,920	13.660	668,247.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	6,880	46.000	316,480.000	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 8,811,216.360 (168,206,120)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	1,200	66.980	80,376.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,100	37.130	189,363.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	6,300	70.250	442,575.000	
	CIA DE SANEAMENTO DO PA- UNIT	1,600	91.800	146,880.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	17,700	28.440	503,388.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	102,400	29.150	2,984,960.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	94,360	33.370	3,148,793.200	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	128,636	34.800	4,476,532.800	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,400	12.560	381,824.000	
	VALE SA	96,890	49.980	4,842,562.200	
	GERDAU SA-PREF	41,800	17.000	710,600.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	78,100	31.200	2,436,720.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER- PRF	47,897	13.050	625,055.850	

ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	46,141	13.270	612,291.070	
BRASKEM SA-PREF A	5,000	27.990	139,950.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	35.930	172,464.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	45,300	47.810	2,165,793.000	
COSAN SA	4,000	62.100	248,400.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	9,400	34.830	327,402.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	7,800	63.250	493,350.000	
EMBRAER SA	28,200	18.000	507,600.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	85,500	7.800	666,900.000	
CCR SA	31,100	17.190	534,609.000	
BRF SA	29,400	36.600	1,076,040.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,600	57.400	551,040.000	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	7,700	30.040	231,308.000	
TIM PARTICIPACOES SA	28,826	13.540	390,304.040	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	14,100	56.250	793,125.000	
LOJAS RENNEN S.A.	5,005	51.800	259,259.000	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,500	22.280	189,380.000	
JBS SA	59,600	28.480	1,697,408.000	
SUZANO SA	4,245	38.560	163,687.200	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	7,000	20.130	140,910.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,900	19.890	157,131.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	18,900	47.720	901,908.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	14,108	15.570	219,661.560	
CIELO SA	49,328	7.800	384,758.400	
HYPERA SA	5,300	33.300	176,490.000	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	5,700	80.160	456,912.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	9,000	20.640	185,760.000	
SUL AMERICA SA - UNITS	4,500	53.190	239,355.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	3,200	14.640	46,848.000	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	10,700	44.100	471,870.000	
KLABIN SA - UNIT	9,800	17.720	173,656.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	36,300	21.810	791,703.000	
LOJAS AMERICANAS SA	9,600	16.470	158,112.000	
COGNA EDUCACAO	41,500	10.250	425,375.000	

	BANCO BRADESCO S.A.	24,465	31.250	764,531.250	
	AMBEV SA	78,600	18.050	1,418,730.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 39,303,651.570 (1,017,178,503)	
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	77,600	8.530	661,928.000	
	GENTING BHD	63,300	5.830	369,039.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	41,500	19.620	814,230.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	54,200	7.060	382,652.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	67,500	3.140	211,950.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	95,500	5.180	494,690.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	54,200	13.160	713,272.000	
	PETRONAS GAS BHD	10,300	15.500	159,650.000	
	SAPURA ENERGY BHD	692,800	0.275	190,520.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 3,997,931.000 (104,905,709)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	10,800	112.150	1,211,220.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	923,000	15.000	13,845,000.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	71,900	42.550	3,059,345.000	
	CEMEX SAB-CPO	879,319	7.150	6,287,130.850	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	37,100	177.480	6,584,508.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	29,623	42.680	1,264,309.640	
	ALFA S.A.B. -A	106,700	15.360	1,638,912.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	86,300	51.080	4,408,204.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	95,600	54.480	5,208,288.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	57,300	102.940	5,898,462.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 49,405,379.490 (277,164,178)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	

CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	119,000	8.080	961,520.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	206,000	4.580	943,480.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	12.180	292,320.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	16,000	21.550	344,800.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	64,000	14.640	936,960.000	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	5.920	242,720.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	20,000	41.000	820,000.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	60,000	9.030	541,800.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,557,800	4.390	6,838,742.000	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15,500	34.600	536,300.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	106,000	7.520	797,120.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICE-H	56,000	5.270	295,120.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	13,500	30.450	411,075.000	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	82,500	10.540	869,550.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	15,200	331.800	5,043,360.000	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	558,000	2.960	1,651,680.000	
AIR CHINA LTD-H	42,000	7.120	299,040.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	260,000	6.700	1,742,000.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	50,500	28.350	1,431,675.000	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	192,000	5.200	998,400.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	80,000	10.180	814,400.000	
PETROCHINA CO LTD-H	828,000	3.610	2,989,080.000	
CNOOC LTD	480,000	11.360	5,452,800.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	64,000	5.700	364,800.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	236,000	3.880	915,680.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	21,500	50.050	1,076,075.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	84,000	4.240	356,160.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,719,000	6.230	23,169,370.000	
CHINA MOBILE LTD	157,500	59.000	9,292,500.000	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	43,600	18.100	789,160.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	408,000	4.280	1,746,240.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	8.380	256,428.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	457,000	1.140	520,980.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	14,000	51.700	723,800.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	202,000	5.080	1,026,160.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	134,500	15.160	2,039,020.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	22,000	17.820	392,040.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	35,200	25.850	909,920.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	64,000	33.850	2,166,400.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	19,000	21.750	413,250.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	58,000	6.920	401,360.000	
BYD CO LTD-H	8,000	37.150	297,200.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,199,000	3.170	3,800,830.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	21,000	30.150	633,150.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP-H	249,000	3.140	781,860.000	
CITIC LTD	157,000	9.800	1,538,600.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	215,000	1.630	350,450.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,000,000	5.580	16,740,000.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	496,000	1.600	793,600.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	74,000	3.230	239,020.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	42,000	16.180	679,560.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,000	26.250	2,467,500.000	
CRRC CORP LTD - H	64,000	5.150	329,600.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION-H	210,000	6.090	1,278,900.000	
CGN POWER CO LTD-H	185,000	1.960	362,600.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	77,000	88.700	6,829,900.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	27,000	38.150	1,030,050.000	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	68,000	4.390	298,520.000	

CHINA MINSHENG BANKING COR-H	312,080	5.450	1,700,836.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	149,000	10.900	1,624,100.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	8,000	73.600	588,800.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	32,700	29.300	958,110.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	92,000	2.170	199,640.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	38,000	8.360	317,680.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,000	103.200	412,800.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	248,000	9.060	2,246,880.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	142,000	6.050	859,100.000	
WEICHAH POWER CO LTD-H	59,000	13.380	789,420.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	188,000	2.400	451,200.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	58,400	27.700	1,617,680.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,400	14.040	342,576.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	152,000	19.780	3,006,560.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,000	85.000	850,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	38,000	7.970	302,860.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	98,000	6.630	649,740.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	66,400	13.160	873,824.000	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	10.540	463,760.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	114,000	2.930	334,020.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	46,000	6.170	283,820.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	238,000	7.560	1,799,280.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	344,100	5.140	1,768,674.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	49,000	18.680	915,320.000	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	72,000	10.960	789,120.000	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	465,000	0.229	106,485.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	91,500	37.000	3,385,500.000	
BANK OF CHINA LTD-H	3,621,000	3.140	11,369,940.000	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	30,500	14.540	443,470.000	

	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	114,000	3.380	385,320.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	96,800	7.820	756,976.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	67,000	3.980	266,660.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	36,500	32.050	1,169,825.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 162,294,601.000 (2,273,747,361)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	16,000	83.900	1,342,400.000	
	TAIWAN CEMENT	126,232	41.400	5,226,004.800	
	ASIA CEMENT CORP	74,000	45.450	3,363,300.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	80,112	72.500	5,808,120.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	67,600	97.200	6,570,720.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	60,140	71.500	4,300,010.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	60,390	87.300	5,272,047.000	
	WALSIN LIHWA CORP	93,000	14.200	1,320,600.000	
	CHINA STEEL CORP	166,686	23.400	3,900,452.400	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	82,616	48.400	3,998,614.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	41,000	140.000	5,740,000.000	
	ACER INC	93,000	17.950	1,669,350.000	
	INVENTEC CORP	67,000	22.850	1,530,950.000	
	TATUNG CO LTD	55,000	22.050	1,212,750.000	
	QUANTA COMPUTER INC	74,000	60.300	4,462,200.000	
	AU OPTRONICS CORP	378,000	8.780	3,318,840.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	80,400	113.000	9,085,200.000	
	MEDIATEK INC	38,003	421.500	16,018,264.500	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	21,000	249.500	5,239,500.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	61,187	25.350	1,551,090.450	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	138,411	44.800	6,200,812.800	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	184,838	41.700	7,707,744.600	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	262,000	9.710	2,544,020.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	178,027	27.050	4,815,630.350	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	215,828	19.750	4,262,603.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	184,993	30.300	5,605,287.900	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	156,768	14.250	2,233,944.000	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	463,139	10.050	4,654,546.950	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	285,028	21.850	6,227,861.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	136,172	22.950	3,125,147.400	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	4,435.000	4,435,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	223.500	2,235,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	31,000	114.500	3,549,500.000	
WISTRON CORP	62,110	27.700	1,720,447.000	
INNOLUX CORP	336,000	7.900	2,654,400.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	23,000	73.100	1,681,300.000	
PEGATRON CORP	63,000	68.000	4,284,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	14,646	136.500	1,999,179.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	63,654	20.750	1,320,820.500	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	21,400	94.100	2,013,740.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	30,000	96.000	2,880,000.000	
POU CHEN	37,440	39.750	1,488,240.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	312,000	305.000	95,160,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	262,902	88.500	23,266,827.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	11,000	305.500	3,360,500.000	
ASUSTEK COMPUTER INC	14,760	230.500	3,402,180.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	104,000	29.750	3,094,000.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	531,000	14.950	7,938,450.000	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 304,791,595.850 (1,094,201,829)	
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	30,460	76.950	2,343,897.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	4,900	124.020	607,698.000	
OLD MUTUAL LTD	91,530	18.540	1,696,966.200	
VODACOM GROUP LTD	19,770	121.120	2,394,542.400	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,990	128.160	1,664,798.400	
NEDBANK GROUP LTD	11,900	219.000	2,606,100.000	
BIDVEST GROUP LTD	7,760	202.970	1,575,047.200	
BID CORP LTD	6,450	322.630	2,080,963.500	
NETCARE LTD	32,930	20.000	658,600.000	

STANDARD BANK GROUP LTD	36,420	165.740	6,036,250.800	
SASOL LTD	18,530	264.000	4,891,920.000	
REMGRO LTD	9,930	192.200	1,908,546.000	
EXXARO RESOURCES LTD	4,600	133.330	613,318.000	
PICK N PAY STORES LTD	8,570	67.880	581,731.600	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	9,640	51.100	492,604.000	
SANLAM LTD	38,490	76.410	2,941,020.900	
TIGER BRANDS LTD	3,180	204.300	649,674.000	
FIRSTRAND LTD	66,290	62.620	4,151,079.800	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	35,310	52.180	1,842,475.800	
THE FOSCHINI GROUP LTD	4,330	155.180	671,929.400	
ABSA GROUP LTD	30,140	147.260	4,438,416.400	
NASPERS LTD-N SHS	2,369	2,094.880	4,962,770.720	
INVESTEC LTD	6,990	84.210	588,627.900	
MTN GROUP LTD	65,880	92.370	6,085,335.600	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	19,330	112.600	2,176,558.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,030	117.400	825,322.000	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,080	274.070	1,940,415.600	
BARLOWORLD LTD	6,070	113.870	691,190.900	
SAPPI LIMITED	15,710	39.850	626,043.500	
TELKOM SA SOC LTD	15,630	46.890	732,890.700	
SPAR GROUP LIMITED/THE	6,930	205.920	1,427,025.600	
MR PRICE GROUP LTD	3,190	175.000	558,250.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	27,640	24.720	683,260.800	
SIBANYE GOLD LTD	76,230	28.880	2,201,522.400	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 68,346,793.120 (512,600,948)	
合計			7,638,071,305 [7,638,071,305]	

## (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	209,000	4,355,560.000	
		アメリカ・ドル 小計		4,355,560.000	

			(477,717,820)	
トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	171,870	トルコ・リラ 250,930.200	
トルコ・リラ	小計		トルコ・リラ 250,930.200 (4,790,258)	
メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	88,400	メキシコ・ペソ 2,640,508.000	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 2,640,508.000 (14,813,250)	
南アフリカ・ランド	REDEFINE PROPERTIES LTD	105,000	南アフリカ・ランド 864,150.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76,930	1,754,773.300	
南アフリカ・ランド	小計		南アフリカ・ランド 2,618,923.300 (19,641,925)	
投資証券	合計		516,963,253 [516,963,253]	
合計			516,963,253 [516,963,253]	

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 25銘柄 投資証券 1銘柄	68.4%	31.6%	18.6%
インド・ルピー	株式 38銘柄	100%	-%	8.3%
インドネシア・ルピア	株式 11銘柄	100%	-%	1.8%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.0%
タイ・バーツ	株式 16銘柄	100%	-%	3.3%
チリ・ペソ	株式 9銘柄	100%	-%	0.8%
トルコ・リラ	株式 13銘柄 投資証券 1銘柄	97.2%	2.8%	2.1%
ブラジル・リアル	株式 49銘柄	100%	-%	12.5%

マレーシア・リングgit	株式	9銘柄	100%	-%	1.3%
メキシコ・ペソ	株式	10銘柄	94.9%	5.1%	3.6%
	投資証券	1銘柄			
香港・ドル	株式	91銘柄	100%	-%	27.8%
台湾・ドル	株式	48銘柄	100%	-%	13.4%
南アフリカ・ランド	株式	34銘柄	96.3%	3.7%	6.5%
	投資証券	2銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年12月1日から2019年12月2日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,489,774	-
コール・ローン	2,897,265	3,343,283
親投資信託受益証券	2,159,420,831	2,133,023,236
未収入金	-	1,440,677
流動資産合計	2,163,807,870	2,137,807,196
資産合計	2,163,807,870	2,137,807,196
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,030,817	1,433,319
未払受託者報酬	114,339	117,079
未払委託者報酬	1,029,386	1,054,044
その他未払費用	57,141	59,176
流動負債合計	2,231,683	2,663,618
負債合計	2,231,683	2,663,618
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,156,165,819	1 2,083,243,207
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,410,368	51,900,371
（分配準備積立金）	3,138,560	34,375,102
元本等合計	2,161,576,187	2,135,143,578
純資産合計	2,161,576,187	2,135,143,578
負債純資産合計	2,163,807,870	2,137,807,196

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日		自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		7
有価証券売買等損益		2,962,270		50,963,605
営業収益合計		2,962,271		50,963,612
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,513		3,620
受託者報酬		197,945		234,066
委託者報酬		1,782,257		2,107,318
その他費用		99,292		117,798
営業費用合計		2,083,007		2,462,802
<b>営業利益</b>		879,264		48,500,810
経常利益		879,264		48,500,810
<b>当期純利益</b>		879,264		48,500,810
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( )		353,647		16,164,749
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,366,645		5,410,368
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,867,833		18,862,014
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		18,862,014
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,057,021		4,708,072
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		4,708,072
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		5,410,368		51,900,371

## (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3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,377,639,463円	2,156,165,819円
期中追加設定元本額	1,389,815,832円	844,707,447円
期中一部解約元本額	611,289,476円	917,630,059円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,156,165,819口	2,083,243,207口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（32,337,045円）、投資信託約款に規定される収益調整金（17,528,238円）及び分配準備積立金（2,038,057円）より分配対象額は51,903,340円（1万口当たり249.15円）であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,153,173	40,934,580
合計	3,153,173	40,934,580

## （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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0025円	1.0249円
（1万口当たり純資産額）	（10,025円）	（10,249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	1,491,311,778	2,133,023,236	
親投資信託受益証券 合計			2,133,023,236	
合計			2,133,023,236	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「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

	2018年11月30日現在	2019年12月2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	150,687,784	277,498,394
国債証券	67,198,735,300	71,946,332,660

地方債証券		4,305,812,600	4,253,511,900
特殊債券		3,325,811,500	3,020,630,000
社債券		3,306,672,600	2,898,205,400
未収入金		202,835,000	1,861,375,540
未収利息		193,828,008	188,754,567
前払費用		4,802,646	12,421,243
流動資産合計		78,766,669,145	84,458,729,704
資産合計		78,766,669,145	84,458,729,704
負債の部			
流動負債			
未払金		-	1,951,218,000
未払解約金		276,774,272	19,276,281
その他未払費用		2,408	134
流動負債合計		276,776,680	1,970,494,415
負債合計		276,776,680	1,970,494,415
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,170,487,793	57,670,399,195
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,319,404,672	24,817,836,094
元本等合計		78,489,892,465	82,488,235,289
純資産合計		78,489,892,465	82,488,235,289
負債純資産合計		78,766,669,145	84,458,729,704

## 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 至 2019年12月2日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--	--

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	48,889,824,254円	56,170,487,793円
期中追加設定元本額	15,940,542,707円	19,864,910,379円
期中一部解約元本額	8,659,879,168円	18,364,998,977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)	129,097,081円	109,396,910円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	795,274,382円	596,838,676円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	105,597,525円	82,263,337円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	1,111,264,823円	882,267,553円
DCダイワ日本債券インデック ス	5,920,239,246円	7,293,354,645円
ダイワ・バランスファンド35 VA	13,051,578,465円	11,302,866,367円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	2,124,813,517円	1,855,649,526円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	293,362,664円	265,692,526円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	405,138,528円	369,416,535円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	62,288,888円	81,822,975円
ダイワファンドラップ 日本債 券インデックス	19,210,529,646円	21,258,481,478円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	2,623,576,618円	3,005,941,387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	1,545,313,319円	1,491,311,778円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,266,064,865円	1,129,962,205円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,443,095,280円	6,866,925,426円
ダイワライフスタイル25	452,397,864円	450,390,874円
ダイワライフスタイル50	492,380,016円	491,002,347円
ダイワライフスタイル75	138,475,066円	136,814,650円
計	56,170,487,793円	57,670,399,195円
2. 期末日における受益権の総数	56,170,487,793口	57,670,399,195口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

## (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	389,359,740	772,340,790
地方債証券	24,799,600	2,883,500
特殊債券	18,142,200	5,121,500
社債券	16,426,800	3,077,600
合計	448,728,340	773,180,390

(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（2017年12月1日から2018年11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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

2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.3974円	1.4303円
(1万口当たり純資産額)	(13,974円)	(14,303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	3 9 8 2年国債	250,000,000	250,822,500	
	3 9 9 2年国債	100,000,000	100,358,000	
	4 0 0 2年国債	200,000,000	200,762,000	
	4 0 2 2年国債	150,000,000	150,651,000	

405	2年国債	150,000,000	150,756,000	
406	2年国債	700,000,000	703,689,000	
127	5年国債	1,580,000,000	1,585,308,800	
128	5年国債	1,000,000,000	1,004,180,000	
129	5年国債	1,340,000,000	1,346,633,000	
130	5年国債	580,000,000	583,271,200	
131	5年国債	1,170,000,000	1,177,534,800	
132	5年国債	880,000,000	886,292,000	
133	5年国債	430,000,000	433,689,400	
134	5年国債	350,000,000	353,164,000	
135	5年国債	880,000,000	888,456,800	
136	5年国債	700,000,000	707,245,000	
137	5年国債	700,000,000	707,357,000	
138	5年国債	600,000,000	606,600,000	
139	5年国債	700,000,000	708,169,000	
140	5年国債	600,000,000	607,140,000	
141	5年国債	650,000,000	658,164,000	
1	40年国債	70,000,000	107,356,900	
2	40年国債	110,000,000	164,067,200	
3	40年国債	74,000,000	111,342,620	
4	40年国債	107,000,000	162,371,430	
5	40年国債	125,000,000	184,040,000	
6	40年国債	105,000,000	152,618,550	
7	40年国債	121,000,000	169,458,080	
8	40年国債	230,000,000	301,596,700	
9	40年国債	220,000,000	216,568,000	
10	40年国債	275,000,000	317,047,500	
11	40年国債	320,000,000	358,339,200	
12	40年国債	200,000,000	202,662,000	
313	10年国債	200,000,000	203,756,000	
314	10年国債	260,000,000	264,209,400	
315	10年国債	221,000,000	225,671,940	
316	10年国債	250,000,000	254,897,500	
317	10年国債	214,000,000	218,879,200	
318	10年国債	200,000,000	204,200,000	
319	10年国債	100,000,000	102,597,000	
320	10年国債	230,000,000	235,501,600	
321	10年国債	175,000,000	179,712,750	
322	10年国債	130,000,000	133,201,900	

3 2 3	1 0 年国債	380,000,000	390,393,000	
3 2 5	1 0 年国債	310,000,000	318,494,000	
3 2 6	1 0 年国債	30,000,000	30,808,500	
3 2 7	1 0 年国債	450,000,000	463,509,000	
3 2 8	1 0 年国債	350,000,000	359,040,500	
3 2 9	1 0 年国債	500,000,000	517,480,000	
3 3 0	1 0 年国債	612,000,000	634,809,240	
3 3 1	1 0 年国債	365,000,000	375,811,300	
3 3 2	1 0 年国債	250,000,000	257,895,000	
3 3 3	1 0 年国債	600,000,000	620,112,000	
3 3 4	1 0 年国債	900,000,000	931,527,000	
3 3 5	1 0 年国債	690,000,000	712,183,500	
3 3 6	1 0 年国債	275,000,000	284,377,500	
3 3 7	1 0 年国債	300,000,000	307,176,000	
3 3 8	1 0 年国債	580,000,000	597,492,800	
3 3 9	1 0 年国債	590,000,000	608,649,900	
3 4 0	1 0 年国債	700,000,000	723,149,000	
3 4 1	1 0 年国債	440,000,000	452,491,600	
3 4 2	1 0 年国債	1,000,000,000	1,016,850,000	
3 4 3	1 0 年国債	700,000,000	712,271,000	
3 4 4	1 0 年国債	700,000,000	712,502,000	
3 4 5	1 0 年国債	650,000,000	662,044,500	
3 4 6	1 0 年国債	700,000,000	713,426,000	
3 4 7	1 0 年国債	500,000,000	509,730,000	
3 4 8	1 0 年国債	600,000,000	611,832,000	
3 4 9	1 0 年国債	1,050,000,000	1,070,937,000	
3 5 0	1 0 年国債	270,000,000	275,319,000	
3 5 1	1 0 年国債	800,000,000	815,192,000	
3 5 2	1 0 年国債	690,000,000	702,558,000	
3 5 3	1 0 年国債	250,000,000	254,447,500	
3 5 4	1 0 年国債	600,000,000	610,110,000	
3 5 5	1 0 年国債	460,000,000	467,286,400	
3 5 6	1 0 年国債	420,000,000	426,199,200	
1	3 0 年国債	16,000,000	20,479,360	
2	3 0 年国債	24,000,000	29,961,120	
3	3 0 年国債	30,000,000	37,275,900	
4	3 0 年国債	36,000,000	47,420,640	
5	3 0 年国債	28,000,000	34,979,280	
6	3 0 年国債	24,000,000	30,762,480	

7	30年国債	55,000,000	70,324,100	
8	30年国債	27,000,000	33,024,780	
9	30年国債	43,000,000	50,393,420	
10	30年国債	45,000,000	51,037,200	
11	30年国債	40,000,000	48,650,400	
12	30年国債	60,000,000	76,383,000	
13	30年国債	75,000,000	94,738,500	
14	30年国債	82,000,000	108,499,940	
15	30年国債	100,000,000	134,119,000	
16	30年国債	250,000,000	336,507,500	
17	30年国債	130,000,000	173,678,700	
18	30年国債	80,000,000	106,031,200	
19	30年国債	57,000,000	75,731,340	
21	30年国債	60,000,000	80,150,400	
22	30年国債	170,000,000	233,166,900	
24	30年国債	92,000,000	126,902,960	
25	30年国債	150,000,000	202,593,000	
26	30年国債	180,000,000	246,808,800	
27	30年国債	150,000,000	209,469,000	
28	30年国債	170,000,000	238,790,500	
29	30年国債	200,000,000	278,700,000	
30	30年国債	220,000,000	304,125,800	
31	30年国債	300,000,000	411,516,000	
32	30年国債	285,000,000	398,221,950	
33	30年国債	311,000,000	418,179,930	
34	30年国債	180,000,000	250,707,600	
35	30年国債	195,000,000	264,718,350	
36	30年国債	350,000,000	477,319,500	
37	30年国債	300,000,000	404,580,000	
38	30年国債	190,000,000	252,874,800	
39	30年国債	192,000,000	260,417,280	
40	30年国債	200,000,000	267,228,000	
41	30年国債	170,000,000	223,629,900	
42	30年国債	176,000,000	231,792,000	
43	30年国債	200,000,000	263,710,000	
44	30年国債	230,000,000	303,616,100	
45	30年国債	200,000,000	255,018,000	
46	30年国債	140,000,000	178,655,400	
47	30年国債	210,000,000	273,474,600	

4 8	3 0 年国債	290,000,000	363,767,300	
4 9	3 0 年国債	100,000,000	125,663,000	
5 0	3 0 年国債	215,000,000	238,007,150	
5 1	3 0 年国債	240,000,000	235,368,000	
5 2	3 0 年国債	300,000,000	309,129,000	
5 3	3 0 年国債	250,000,000	263,812,500	
5 4	3 0 年国債	218,000,000	241,236,620	
5 5	3 0 年国債	200,000,000	221,220,000	
5 6	3 0 年国債	300,000,000	331,677,000	
5 7	3 0 年国債	230,000,000	254,483,500	
5 8	3 0 年国債	320,000,000	353,881,600	
5 9	3 0 年国債	200,000,000	215,924,000	
6 0	3 0 年国債	180,000,000	204,030,000	
6 1	3 0 年国債	200,000,000	215,612,000	
6 2	3 0 年国債	200,000,000	204,706,000	
6 3	3 0 年国債	230,000,000	228,790,200	
6 4	3 0 年国債	100,000,000	99,338,000	
4 9	2 0 年国債	64,000,000	65,882,240	
5 0	2 0 年国債	107,000,000	109,867,600	
5 1	2 0 年国債	82,000,000	84,754,380	
5 2	2 0 年国債	52,000,000	54,126,280	
5 3	2 0 年国債	66,000,000	69,076,260	
5 4	2 0 年国債	65,000,000	68,163,550	
5 5	2 0 年国債	140,000,000	147,018,200	
5 8	2 0 年国債	200,000,000	211,664,000	
5 9	2 0 年国債	45,000,000	47,591,550	
6 0	2 0 年国債	10,000,000	10,484,000	
6 1	2 0 年国債	100,000,000	103,909,000	
6 2	2 0 年国債	95,000,000	98,321,200	
6 3	2 0 年国債	130,000,000	139,158,500	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	97,119,900	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	189,759,500	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	199,848,100	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	59,923,600	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	132,298,800	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	120,798,700	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	92,727,600	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	138,506,250	
7 2	2 0 年国債	175,000,000	194,118,750	

7 3	2 0 年国債	120,000,000	133,220,400	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	81,413,980	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	89,651,200	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	56,608,470	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	144,989,000	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	68,030,250	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	56,042,000	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	59,701,320	
8 1	2 0 年国債	76,000,000	85,605,640	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	98,504,880	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	105,800,520	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	66,311,400	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	92,480,800	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	63,231,300	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	116,233,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	90,145,380	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	23,227,600	
9 1	2 0 年国債	60,000,000	70,094,400	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	359,674,400	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	115,853,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	151,568,300	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	59,326,000	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	64,419,300	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	47,378,400	
9 8	2 0 年国債	320,000,000	376,505,600	
9 9	2 0 年国債	100,000,000	118,181,000	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	185,198,650	
1 0 1	2 0 年国債	350,000,000	424,056,500	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	205,341,300	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	11,906,400	
1 0 5	2 0 年国債	126,000,000	150,668,280	
1 0 6	2 0 年国債	150,000,000	180,699,000	
1 0 7	2 0 年国債	90,000,000	107,976,600	
1 0 8	2 0 年国債	477,000,000	563,575,500	
1 0 9	2 0 年国債	55,000,000	65,165,100	
1 1 0	2 0 年国債	260,000,000	312,920,400	
1 1 1	2 0 年国債	200,000,000	243,392,000	
1 1 2	2 0 年国債	150,000,000	181,104,000	
1 1 3	2 0 年国債	310,000,000	375,617,700	

1 1 4	2 0 年国債	70,000,000	85,067,500	
1 1 5	2 0 年国債	180,000,000	220,559,400	
1 1 6	2 0 年国債	140,000,000	172,145,400	
1 1 7	2 0 年国債	215,000,000	262,147,350	
1 1 8	2 0 年国債	95,000,000	115,217,900	
1 1 9	2 0 年国債	93,000,000	110,827,170	
1 2 0	2 0 年国債	280,000,000	327,759,600	
1 2 1	2 0 年国債	170,000,000	204,984,300	
1 2 2	2 0 年国債	160,000,000	191,198,400	
1 2 3	2 0 年国債	200,000,000	246,258,000	
1 2 4	2 0 年国債	193,000,000	235,508,250	
1 2 5	2 0 年国債	85,000,000	105,938,050	
1 2 6	2 0 年国債	110,000,000	134,615,800	
1 2 7	2 0 年国債	165,000,000	200,064,150	
1 2 8	2 0 年国債	119,000,000	144,684,960	
1 2 9	2 0 年国債	230,000,000	276,995,900	
1 3 0	2 0 年国債	140,000,000	169,129,800	
1 3 1	2 0 年国債	150,000,000	179,446,500	
1 3 3	2 0 年国債	370,000,000	448,070,000	
1 3 4	2 0 年国債	80,000,000	97,104,800	
1 3 5	2 0 年国債	92,000,000	110,546,280	
1 3 6	2 0 年国債	200,000,000	237,874,000	
1 3 8	2 0 年国債	100,000,000	118,003,000	
1 3 9	2 0 年国債	300,000,000	357,747,000	
1 4 0	2 0 年国債	300,000,000	362,250,000	
1 4 1	2 0 年国債	200,000,000	242,146,000	
1 4 2	2 0 年国債	240,000,000	293,678,400	
1 4 3	2 0 年国債	210,000,000	251,983,200	
1 4 4	2 0 年国債	300,000,000	356,031,000	
1 4 5	2 0 年国債	380,000,000	462,178,800	
1 4 6	2 0 年国債	230,000,000	280,273,400	
1 4 7	2 0 年国債	150,000,000	181,167,000	
1 4 8	2 0 年国債	330,000,000	394,544,700	
1 4 9	2 0 年国債	272,000,000	325,660,160	
1 5 0	2 0 年国債	200,000,000	237,046,000	
1 5 1	2 0 年国債	370,000,000	428,108,500	
1 5 2	2 0 年国債	350,000,000	405,545,000	
1 5 3	2 0 年国債	400,000,000	470,232,000	
1 5 4	2 0 年国債	380,000,000	441,229,400	

155	20年国債	275,000,000	310,895,750		
156	20年国債	200,000,000	206,964,000		
157	20年国債	400,000,000	400,640,000		
158	20年国債	100,000,000	104,960,000		
159	20年国債	280,000,000	298,460,400		
160	20年国債	210,000,000	227,360,700		
161	20年国債	260,000,000	276,923,400		
162	20年国債	350,000,000	372,778,000		
163	20年国債	290,000,000	308,858,700		
164	20年国債	400,000,000	418,588,000		
165	20年国債	200,000,000	209,232,000		
166	20年国債	300,000,000	324,528,000		
167	20年国債	300,000,000	313,350,000		
168	20年国債	300,000,000	307,716,000		
169	20年国債	300,000,000	301,950,000		
170	20年国債	90,000,000	90,506,700		
27	メキシコ国債	100,000,000	99,011,500		
11	フィリピン共和国	100,000,000	103,251,600		
国債証券 合計			71,946,332,660		
地方債証券	699	東京都公債	100,000,000	101,743,700	
	713	東京都公債	100,000,000	102,016,000	
	751	東京都公債	100,000,000	101,818,500	
	16	東京都20年	100,000,000	116,982,300	
	24-1	北海道公債	100,000,000	102,243,700	
	24-6	北海道公債	100,000,000	102,160,400	
	222	神奈川県公債	100,000,000	99,812,500	
	31	神奈川県20年	100,000,000	110,833,900	
	361	大阪府公債	100,000,000	102,229,200	
	420	大阪府公債	200,000,000	200,895,200	
	24-5	京都府公債	100,000,000	102,155,800	
	26-17	兵庫県公債	100,000,000	102,101,000	
	3	兵庫県公債12年	200,000,000	205,308,600	
	19	兵庫県公債20年	100,000,000	117,730,400	
	26-10	静岡県公債	100,000,000	102,356,000	
	21-5	愛知県公債	100,000,000	120,402,400	
	24-16	愛知県公債	100,000,000	102,246,600	
	29-5	広島県公債	100,000,000	101,147,300	
	4	埼玉県30年	100,000,000	120,503,000	
	29-1	福岡県公債	100,000,000	100,721,200	

	1 6 千葉県20年	100,000,000	118,079,300	
	2 8 - 2 新潟県公債	100,000,000	100,618,700	
	1 0 8 共同発行地方	100,000,000	102,210,600	
	1 1 7 共同発行地方	100,000,000	102,049,800	
	1 2 6 共同発行地方	100,000,000	102,935,900	
	1 3 1 共同発行地方	100,000,000	102,625,200	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,847,900	
	2 3 - 2 島根県公債	100,000,000	101,940,600	
	2 5 - 6 大阪市公債	200,000,000	205,212,200	
	1 1 名古屋市20年	100,000,000	119,997,500	
	2 0 - 1 神戸市20年	100,000,000	119,074,400	
	2 4 - 1 0 神戸市公債	100,000,000	102,149,900	
	2 4 - 3 横浜市公債	100,000,000	102,080,300	
	2 4 - 5 札幌市公債	100,000,000	102,003,000	
	4 川崎市公債30年	100,000,000	135,281,100	
	2 3 - 4 福岡市20年	100,000,000	119,584,300	
	2 4 - 4 福井県公債	100,000,000	101,413,500	
	地方債証券 合計		4,253,511,900	
特殊債券	1 9 政保政策投資C	100,000,000	102,115,400	
	8 1 道路機構	100,000,000	102,012,500	
	8 6 政保道路機構	100,000,000	118,467,900	
	1 6 8 政保道路機構	100,000,000	102,194,500	
	1 7 3 政保道路機構	100,000,000	102,265,000	
	1 7 5 政保道路機構	100,000,000	102,237,500	
	1 8 6 政保道路機構	100,000,000	102,125,600	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	102,053,400	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	117,581,200	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	101,481,700	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	204,111,200	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	196,229,200	
	2 9 8 政保道路機構	100,000,000	104,530,900	
	3 公営企業15年	100,000,000	103,245,800	
	2 9 地方公共団体	100,000,000	101,878,100	
	3 3 地方公共団体	100,000,000	102,212,300	
	3 9 政保地方公共団	100,000,000	102,122,400	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	109,700,500	
	1 地方公共団15年	100,000,000	110,161,500	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	102,682,300	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	102,995,700	

	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	119,825,700	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,357,600	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	102,164,500	
	2 5 日本政策金融	100,000,000	102,315,600	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	102,556,300	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,005,700	
特殊債券 合計			3,020,630,000	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,811,500	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	102,778,000	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	102,745,300	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	100,305,500	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	102,415,100	
	5 野村不動産HD	100,000,000	103,370,500	
	2 3 森ビル	100,000,000	101,800,600	
	1 1 セブンアンドアイ	100,000,000	101,155,000	
	4 JXホールディングス	100,000,000	103,108,000	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,878,000	
	1 5 デンソー	100,000,000	100,246,400	
	7 凸版印刷	100,000,000	107,356,300	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	102,377,800	
	9 三菱UFJ信託BK劣	100,000,000	102,173,100	
	1 1 三菱UFJ信託BK	100,000,000	103,096,100	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,404,400	
	2 イオンFS	100,000,000	100,554,100	
	1 7 5 オリックス	100,000,000	103,655,300	
	4 4 野村ホールディング	100,000,000	100,715,400	
	1 8 エヌティティ都市開	100,000,000	106,548,100	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	121,036,600	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	117,722,700	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	100,636,000	
	3 7 2 中国電力	100,000,000	103,118,000	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	104,473,200	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	100,337,900	
	3 0 大阪瓦斯	100,000,000	102,151,300	
4 ファーストリテイリング	100,000,000	103,235,200		
社債券 合計			2,898,205,400	
合計			82,118,679,960	

## 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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,423,469	-
コール・ローン	6,657,851	10,077,643
親投資信託受益証券	3,594,657,006	3,535,778,990
未収入金	-	154,141
流動資産合計	3,604,738,326	3,546,010,774
資産合計	3,604,738,326	3,546,010,774
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,928,754	2,047,651
未払受託者報酬	374,934	388,512
未払委託者報酬	4,124,775	4,274,084
その他未払費用	140,639	147,388
流動負債合計	6,569,102	6,857,635
負債合計	6,569,102	6,857,635
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,649,169,243	1 3,349,305,616
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 51,000,019	2 189,847,523
（分配準備積立金）	5,571,385	166,517,050
元本等合計	3,598,169,224	3,539,153,139
純資産合計	3,598,169,224	3,539,153,139
負債純資産合計	3,604,738,326	3,546,010,774

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	11
有価証券売買等損益	52,412,750	257,734,758
<b>営業収益合計</b>	<b>52,412,749</b>	<b>257,734,769</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	6,009	6,975
受託者報酬	646,323	777,062
委託者報酬	7,110,618	8,548,636
その他費用	243,074	293,299
<b>営業費用合計</b>	<b>8,006,024</b>	<b>9,625,972</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>60,418,773</b>	<b>248,108,797</b>
経常利益又は経常損失（ ）	60,418,773	248,108,797
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>60,418,773</b>	<b>248,108,797</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	7,767,985	50,322,335
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>16,744,983</b>	<b>51,000,019</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	43,061,080
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	15,020,048
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	28,041,032
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>15,094,214</b>	<b>-</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	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	-
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>51,000,019</b>	<b>189,847,523</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	2,149,445,185円	3,649,169,243円
期中追加設定元本額	2,190,846,317円	1,134,630,067円
期中一部解約元本額	691,122,259円	1,434,493,694円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,649,169,243口	3,349,305,616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2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(162,816,007円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,336,298円)及び分配準備積立金(3,701,043円)より分配対象額は189,853,348円(1万口当たり566.84円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	50,558,145	227,225,519
合計	50,558,145	227,225,519

## （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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	0.9860円	1.0567円
（1万口当たり純資産額）	（9,860円）	（10,567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	3,463,394,055	3,535,778,990	
親投資信託受益証券 合計			3,535,778,990	
合計			3,535,778,990	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	525,511,903	762,734,708
金銭信託	674,261,080	-

コール・ローン		1,311,280,938	2,753,096,044
国債証券		79,129,977,347	90,390,273,186
派生商品評価勘定		12,141,994	6,002,225
未収入金		-	2,841,787,582
未収利息		483,359,897	541,213,301
前払費用		49,374,496	33,522,385
差入委託証拠金		108,353,810	163,821,655
流動資産合計		82,294,261,465	97,492,451,086
資産合計		82,294,261,465	97,492,451,086
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		748,935,590	110,854,741
未払金		1,141,091	5,511,761,821
未払解約金		45,595,786	154,141
その他未払費用		16,916	921
流動負債合計		795,689,383	5,622,771,624
負債合計		795,689,383	5,622,771,624
純資産の部			
元本等			
元本	1	85,791,284,610	89,984,609,700
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	4,292,712,528	1,885,069,762
元本等合計		81,498,572,082	91,869,679,462
純資産合計		81,498,572,082	91,869,679,462
負債純資産合計		82,294,261,465	97,492,451,086

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	48,910,853,447円	85,791,284,610円
期中追加設定元本額	39,808,647,859円	38,604,112,946円
期中一部解約元本額	2,928,216,696円	34,410,787,856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）	71,469,694,700円	80,746,616,292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）	3,783,849,481円	3,463,394,055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）	10,537,740,429円	5,774,599,353円
計	85,791,284,610円	89,984,609,700円
2. 期末日における受益権の総数	85,791,284,610口	89,984,609,700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4,292,712,528円であります。	

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。 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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	742,384,479	1,099,359,108
合計	742,384,479	1,099,359,108

(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（2018年6月16日から2018年11月30日まで、及び2019年6月18日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
	うち 1年超				うち 1年超			

市場取引								
債券先物取引								
買 建	596,979,388	-	599,006,581	2,027,193	-	-	-	-
合計	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	2018年11月30日 現在				2019年12月2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	79,259,778,351	-	79,998,599,140	738,820,789	91,199,675,614	-	91,305,800,610	106,124,996
アメリカ・ドル	36,767,830,278	-	37,037,347,200	269,516,922	44,292,767,362	-	44,361,862,160	69,094,798
イギリス・ ポンド	5,294,824,620	-	5,328,082,410	33,257,790	5,853,453,015	-	5,850,183,600	3,269,415
オーストラリ ア・ドル	1,668,408,091	-	1,735,702,080	67,293,989	1,797,008,342	-	1,801,201,990	4,193,648
カナダ・ドル	1,656,659,483	-	1,648,943,940	7,715,543	1,676,430,474	-	1,679,849,710	3,419,236
シンガポー ル・ドル	307,020,183	-	312,638,160	5,617,977	445,530,013	-	446,152,630	622,617
スウェーデ ン・クローナ	263,086,950	-	266,463,000	3,376,050	382,371,395	-	382,956,700	585,305
デンマーク・ クローネ	477,522,105	-	482,100,810	4,578,705	463,853,022	-	464,111,340	258,318

ナルウェー・ クローネ	191,485,415	-	189,442,520	2,042,895	177,085,967	-	177,105,380	19,413
ポーランド・ ズロチ	498,256,355	-	510,323,160	12,066,805	502,320,600	-	502,560,000	239,400
マレーシア・ リングgit	275,906,593	-	276,010,980	104,387	295,468,320	-	295,084,800	383,520
メキシコ・ペ ソ	544,056,183	-	549,899,480	5,843,297	770,369,730	-	769,387,240	982,490
ユーロ	30,922,775,074	-	31,234,173,840	311,398,766	34,057,305,298	-	34,088,197,110	30,891,812
南アフリカ・ ランド	391,947,021	-	427,471,560	35,524,539	485,712,076	-	487,147,950	1,435,874
買 建	-	-	-	-	1,375,991,520	-	1,377,264,000	1,272,480
アメリカ・ドル	-	-	-	-	602,274,200	-	603,130,000	855,800
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	169,978,320	-	169,884,000	94,320
ユーロ	-	-	-	-	603,739,000	-	604,250,000	511,000
合計	79,259,778,351	-	79,998,599,140	738,820,789	92,575,667,134	-	92,683,064,610	104,852,516

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （1口当たり情報）

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	0.9500円	1.0209円
（1万口当たり純資産額）	（9,500円）	（10,209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	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	30,040,000.000	30,735,726.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	13,946,000.000	14,046,690.120	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	15,000,000.000	15,006,300.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,000,000.000	2,024,680.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	11,020,000.000	11,066,394.200	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	11,310,000.000	11,666,038.800	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	12,905,000.000	13,453,462.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	2,500,000.000	2,611,900.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	12,580,000.000	13,047,724.400	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	22,990,000.000	23,155,068.200	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,800,000.000	3,262,980.000	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	4,750,000.000	6,299,687.500	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,800,000.000	4,943,230.000			

5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,700,000.000	3,477,708.000	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	4,900,000.000	6,983,235.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,539,489.400	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	200,000.000	271,202.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	2,630,000.000	3,234,058.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	2,410,000.000	3,312,424.500	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	490,000.000	695,452.100	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,770,000.000	2,565,933.600	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,970,000.000	3,472,108.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	7,500,000.000	8,442,150.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,392,787.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,270,229.920	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,268,900.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	3,913,728.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	5,040,000.000	5,932,584.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	7,810,000.000	8,032,663.100	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	15,450,000.000	15,488,625.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	8,300,000.000	8,493,224.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,570,000.000	1,816,034.700	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	9,020,000.000	9,178,481.400	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	16,720,000.000	16,787,883.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,700,000.000	8,971,179.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,300,000.000	2,665,838.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	2,000,000.000	1,990,140.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,165,000.000	5,139,536.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,070,000.000	2,191,281.300	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,667,775.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	5,000,000.000	4,955,850.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	15,000,000.000	14,858,100.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,850,000.000	5,957,347.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,480,000.000	2,819,834.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,370,000.000	3,489,769.800	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	5,000,000.000	5,025,350.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,500,000.000	4,075,855.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	3,350,000.000	3,502,056.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,620,012.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	7,200,000.000	7,354,656.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,310,000.000	3,679,760.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	7,076,510.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,800,000.000	1,874,664.000	

	2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	4,000,000.000	4,193,720.000	
	3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	5,369,040.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	7,900,000.000	8,596,148.000	
	2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	5,500,000.000	5,574,085.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,751,715.000	
	3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	5,000,000.000	5,561,700.000	
	3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	950,000.000	1,187,794.500	
	3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	3,742,496.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	2,287,500.000	
	1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,038,400.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	2,117,871.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	700,000.000	698,411.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,500,000.000	1,555,185.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 401,478,364.790 (44,034,147,050)	
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	815,122.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	960,000.000	1,444,704.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,025,000.000	1,092,199.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	249,990.000	

1.5% United Kingdom Gilt 20470722	600,000.000	642,780.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	720,000.000	796,320.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000	1,316,370.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	684,632.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	870,592.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	400,000.000	488,480.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	500,000.000	508,565.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,000,000.000	1,111,940.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	863,000.000	1,272,346.790	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	700,000.000	983,990.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	175,000.000	215,850.250	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,565,000.000	2,324,025.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	200,000.000	326,800.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	450,000.000	866,385.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	620,000.000	1,057,534.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	600,000.000	775,272.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	411,000.000	687,068.700	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,294,458.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,378,855.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,759,523.000	

	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,040,000.000	1,121,640.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	447,330.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	787,000.000	1,527,488.300	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	700,000.000	1,105,440.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	742,000.000	783,737.500	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	1,193,640.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	1,380,000.000	1,426,878.600	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,175,000.000	1,680,015.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,790,000.000	1,906,564.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	748,900.000	1,425,905.600	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,900,000.000	2,100,127.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,540,000.000	2,309,692.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 40,992,261.940 (5,804,094,368)	
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	1,898,785.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,080,000.000	1,222,840.800	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,383,000.000	1,607,032.170	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,089,000.000	1,386,961.290	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	656,000.000	714,167.520	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	920,000.000	1,102,472.800	

	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,200,000.000	1,356,924.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	859,000.000	1,215,751.290	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,598,000.000	1,936,312.580	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	994,866.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	200,000.000	241,566.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	896,081.040	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,478,386.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,158,000.000	2,377,813.880	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	575,000.000	750,357.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	500,000.000	574,110.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,200,000.000	1,256,508.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,200,000.000	2,556,840.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	500,000.000	571,920.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 24,139,697.070 (1,792,372,508)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	610,000.000	848,461.200	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,247,043.370	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	450,000.000	680,602.500	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	648,000.000	988,303.680	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	770,000.000	1,108,646.000	

	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	400,000.000	411,512.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	740,000.000	1,043,392.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,238,000.000	1,236,700.100	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	230,000.000	240,057.900	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	300,000.000	383,130.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	592,000.000	616,023.360	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	820,000.000	821,115.200	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,959,000.000	1,930,731.630	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	898,528.800	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,240,000.000	1,210,649.200	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	625,008.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	300,000.000	301,914.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,031,180.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	3,000,000.000	3,019,740.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,400,840.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 20,043,579.540 (1,656,000,541)	
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 BOND 20270301	203,000.000	228,273.500	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT BOND 20220901	1,000,000.000	1,043,000.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT BOND 20240901	150,000.000	159,490.500	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	300,000.000	332,610.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	390,000.000	394,208.100	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	89,000.000	100,659.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	208,280.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	120,000.000	142,362.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	415,600.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	375,081.300	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	205,760.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	272,870.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	857,600.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	321,426.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 5,057,220.400 (405,639,648)	
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	2,927,812.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	1,920,000.000	3,041,356.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	12,950,000.000	14,192,941.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,446,932.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,324,414.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	2,280,000.000	2,464,064.400	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,730,871.500	

スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 32,128,392.800 (368,191,382)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 5,740,000.000	デンマーク・クローネ 11,111,147.600	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,310,000.000	2,479,299.900	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,899,753.500	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,330,000.000	2,654,545.700	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,609,032.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	2,200,000.000	2,386,868.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 27,140,646.700 (438,864,258)	
ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	ノルウェー・クローネ 2,620,000.000	ノルウェー・クローネ 2,715,892.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,610,000.000	1,650,684.700	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,394,861.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	153,945.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,451,407.100	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,092,700.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,207,520.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 14,667,009.800 (174,537,416)	
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	1,337,196.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	640,000.000	664,160.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,000,000.000	2,019,740.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	1,520,000.000	1,529,393.600	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,885,621.650	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	800,000.000	814,232.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,083,250.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	1,400,000.000	1,446,158.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	801,690.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	772,217.300	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,500,000.000	1,587,375.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,430,000.000	1,539,194.800	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 17,480,228.350 (489,795,998)	
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	1,901,873.600	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,289,712.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	600,000.000	608,724.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,189,192.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,120,482.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	600,000.000	613,506.000	

	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,584,677.400	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	400,000.000	404,512.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,071,560.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,129,560.000	
マレーシア・リングgit 小計			マレーシア・リングgit 11,913,799.500 (312,618,099)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	9,200,000.000	8,621,136.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	12,335,314.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	5,900,000.000	6,151,340.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,997,468.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	7,154,182.800	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	11,800,000.000	12,113,762.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,484,690.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	7,136,415.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,611,350.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,700,000.000	13,646,159.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	23,763,722.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	8,900,000.000	8,836,988.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	4,750,000.000	4,958,335.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	10,800,580.000	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 131,611,441.800 (738,340,189)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	206,469.200	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	858,800.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	189,675.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	120,000.000	151,370.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	211,576.000	

1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	171,561.000	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,815.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	140,000.000	153,116.600	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	525,872.900	
1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	152,222.400	
1.5% Austria Government Bond 20861102	180,000.000	243,819.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	400,000.000	422,596.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	647,028.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	740,719.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	670,000.000	713,402.600	
1% Belgium Government Bond 20310622	622,000.000	688,529.120	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	610,000.000	770,759.400	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	645,622.600	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	414,000.000	512,362.260	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	270,000.000	393,012.000	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	410,908.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	785,545.700	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	522,335.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	448,300.300	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	700,000.000	825,349.000	

0.8% Belgium Government Bond 20280622	580,000.000	626,626.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	571,915.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	700,000.000	764,582.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	100,000.000	126,050.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	855,000.000	1,317,726.000	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,202,600.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	896,000.000	1,506,874.880	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,756,031.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	970,000.000	1,685,016.100	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	690,000.000	1,183,122.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	720,000.000	1,335,405.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	610,000.000	1,218,517.700	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	606,000.000	1,052,100.840	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,638,791.340	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,648,000.000	2,635,794.720	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,230,316.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,604,627.600	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	500,000.000	550,425.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	725,000.000	1,186,571.250	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,084,287.600	

1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,152,600.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,257,996.600	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,100,000.000	1,199,792.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	941,383.960	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,050,000.000	1,087,695.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	700,000.000	738,997.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,185,503.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,260,000.000	1,661,007.600	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	450,000.000	486,256.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,014,133.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,700,000.000	1,714,569.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,800,000.000	1,821,474.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,500,000.000	1,523,370.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	1,800,000.000	1,833,912.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	150,000.000	153,327.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,025,030.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	513,335.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,415,000.000	3,331,685.700	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,000,000.000	1,532,670.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,700,000.000	2,940,864.000	

4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,310,000.000	2,209,000.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	2,457,815.360	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	650,000.000	689,812.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,772,415.600	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,427,172.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,043,000.000	1,904,486.710	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	500,000.000	1,044,975.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	1,040,000.000	1,298,845.600	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,314,000.000	3,559,236.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	1,900,000.000	2,065,889.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,910,000.000	2,366,528.200	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,195,000.000	2,378,128.850	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,090,000.000	1,774,116.700	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,730,000.000	2,953,150.200	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,200,000.000	2,473,878.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,686,000.000	3,400,476.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,360,000.000	1,510,225.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,100,000.000	2,205,630.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	500,000.000	583,990.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	1,800,000.000	1,896,444.000	

1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,000,000.000	1,150,190.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	600,000.000	795,936.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	1,000,000.000	1,009,140.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,970,000.000	3,081,672.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,600,000.000	1,999,616.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,531,824.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,300,000.000	1,746,797.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,200,000.000	1,223,220.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	500,000.000	539,575.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,300,000.000	1,494,077.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,250,000.000	2,429,100.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,200,000.000	1,226,136.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	3,000,000.000	3,039,480.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	500,000.000	605,475.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,000,000.000	2,112,260.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	1,000,000.000	1,004,600.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	857,396.600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,200,000.000	2,016,276.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,332,045.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	630,000.000	1,134,957.600	

3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,100,000.000	1,169,608.000	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	500,000.000	538,295.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	290,000.000	388,542.000	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	814,815.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	740,000.000	1,247,166.400	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	480,000.000	536,889.600	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	718,186.500	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	670,000.000	711,231.800	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	470,000.000	509,517.600	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	409,288.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	654,504.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	600,000.000	627,186.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	150,000.000	161,143.500	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,600,000.000	2,276,640.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,602,903.750	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,600,000.000	1,745,776.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	705,000.000	849,102.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	957,940.800	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	500,000.000	535,065.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	800,000.000	828,656.000	

2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,400,000.000	1,539,272.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,200,000.000	1,226,340.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	750,000.000	795,315.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,400,000.000	1,416,702.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	3,000,000.000	3,019,260.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	600,000.000	641,100.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,427,413.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	500,000.000	543,420.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,500,000.000	1,539,060.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	350,000.000	435,176.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,666,715.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	714,042.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	500,000.000	537,055.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,000,000.000	2,281,160.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	2,500,000.000	2,743,650.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	800,000.000	965,056.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	200,000.000	264,170.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,161,000.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	200,000.000	215,198.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,040,000.000	2,792,290.800	

6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,288,000.000	1,908,262.160	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,487,050.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	950,000.000	1,348,601.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,652,828.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,420,230.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,170,000.000	2,515,919.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	1,700,000.000	2,078,182.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,114,000.000	1,645,623.080	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	1,050,000.000	1,284,853.500	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	3,250,000.000	3,408,730.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	1,320,000.000	1,429,520.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	780,000.000	866,580.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	500,000.000	573,350.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,770,000.000	3,195,749.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	80,000.000	104,204.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	725,000.000	1,069,824.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	830,000.000	969,365.300	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,421,119.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,655,234.000	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	700,000.000	730,030.000	

5.5% Belgium Government Bond 20280328	500,000.000	738,685.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	450,000.000	769,864.500	
4% Belgium Government Bond 20220328	550,000.000	609,317.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	665,000.000	1,166,144.000	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	300,000.000	391,980.000	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	830,813.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	444,111.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,100,660.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	340,000.000	593,429.200	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	911,984.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	419,937.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	894,124.800	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	480,631.200	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	600,000.000	697,596.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	841,595.200	
2% IRISH TREASURY 20450218	310,000.000	403,709.900	
1% IRISH TREASURY 20260515	320,000.000	344,089.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	682,518.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	539,775.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	169,120.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	600,000.000	677,730.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	570,376.200	
3.5% Austria Government Bond 20210915	660,000.000	708,536.400	
4.15% Austria Government Bond 20370315	510,000.000	850,700.400	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	931,504.000	

3.65% Austria Government Bond 20220420	400,000.000	440,732.000	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	962,443.200	
3.8% Austria Government Bond 20620126	620,000.000	1,358,810.600	
3.15% Austria Government Bond 20440620	380,000.000	628,991.200	
1.75% Austria Government Bond 20231020	680,000.000	740,785.200	
2.4% Austria Government Bond 20340523	230,000.000	304,809.800	
1.65% Austria Government Bond 20241021	280,000.000	308,912.800	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	250,354.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	150,603.600	
1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,041,259.800	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	319,200.000	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	388,675.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,920,000.000	2,898,144.000	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,400,000.000	1,522,598.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	610,000.000	703,342.200	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,365,000.000	1,533,768.600	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,000,000.000	1,118,460.000	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	2,000,000.000	2,039,700.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	389,000.000	536,800.550	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	680,000.000	1,090,862.800	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,249,000.000	1,348,008.230	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,250,000.000	1,272,900.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	600,000.000	656,934.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,607,562.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,279,582.200	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	950,000.000	1,036,649.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	350,000.000	469,479.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,500,000.000	1,512,630.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	878,560.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	300,000.000	345,675.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,200,000.000	1,221,480.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	980,000.000	1,601,114.200	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	800,000.000	1,230,832.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	1,383,000.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	943,000.000	1,609,767.010	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	724,000.000	784,830.480	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,382,210.000	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	600,000.000	681,408.000	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,310,000.000	2,724,991.500	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,588,000.000	1,872,918.960	

	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,100,000.000	1,563,628.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	890,000.000	1,659,707.600	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	700,000.000	820,841.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,374,113.640	
	ユーロ 小計		ユーロ 279,013,855.950 (33,721,614,630)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	8,010,000.000	8,870,274.000	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	1,200,000.000	1,201,080.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	2,610,000.000	1,788,111.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,900,000.000	2,929,000.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	15,900,000.000	13,756,680.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	5,250,000.000	4,605,562.500	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	2,850,000.000	2,625,933.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,300,000.000	1,993,272.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	9,700,000.000	8,774,135.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,000,000.000	9,227,800.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,300,000.000	4,769,099.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 60,540,946.500 (454,057,099)	
国債証券 合計			90,390,273,186 [90,390,273,186]	
合計			90,390,273,186	

- (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 66銘柄	100%	48.9%
イギリス・ポンド	国債証券 36銘柄	100%	6.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券 20銘柄	100%	1.8%
シンガポール・ドル	国債証券 14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 6銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 10銘柄	100%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 234銘柄	100%	37.3%
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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	2,350,704	-
コール・ローン	4,571,573	8,239,771
親投資信託受益証券	2,439,965,325	2,831,073,078
流動資産合計	2,446,887,602	2,839,312,849
<b>資産合計</b>		
2,446,887,602		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,343,977	1,663,649
未払受託者報酬	249,069	303,031
未払委託者報酬	2,864,799	3,485,171
その他未払費用	93,385	114,932
流動負債合計	4,551,230	5,566,783
<b>負債合計</b>		
4,551,230		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,389,228,743	1 2,655,013,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	53,107,629	178,732,914
(分配準備積立金)	30,492,601	108,793,480
元本等合計	2,442,336,372	2,833,746,066
<b>純資産合計</b>		
2,442,336,372		
<b>負債純資産合計</b>		
2,446,887,602		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	8
有価証券売買等損益	30,300,121	124,191,521
<b>営業収益合計</b>	<b>30,300,121</b>	<b>124,191,529</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,861	5,004
受託者報酬	428,247	576,760
委託者報酬	4,925,834	6,633,576
その他費用	160,981	217,700
<b>営業費用合計</b>	<b>5,518,923</b>	<b>7,433,040</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>35,819,044</b>	<b>116,758,489</b>
経常利益又は経常損失（ ）	35,819,044	116,758,489
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>	<b>35,819,044</b>	<b>116,758,489</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	6,941,906	9,172,604
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>64,004,351</b>	<b>53,107,629</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,337,355	35,450,978
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>34,337,355</b>	<b>35,450,978</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,356,939	17,411,578
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>16,356,939</b>	<b>17,411,578</b>
分配金	1 -	1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>53,107,629</b>	<b>178,732,914</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	1,342,783,335円	2,389,228,743円
期中追加設定元本額	1,446,419,314円	1,008,953,213円
期中一部解約元本額	399,973,906円	743,168,804円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,389,228,743口	2,655,013,152口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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。	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(86,074,253円)、投資信託約款に規定される収益調整金(69,943,825円)及び分配準備積立金(22,719,227円)より分配対象額は178,737,305円(1万口当たり673.21円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 2019年12月2日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	28,477,146	119,014,646
合計	28,477,146	119,014,646

## （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2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。	

## （1口当たり情報）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0222円 (10,222円)	1.0673円 (10,673円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ新興国債券インデックス・マザー ファンド	399,927,854	563,138,411	
	外国債券インデックスマザーファンド	787,285,961	2,267,934,667	
親投資信託受益証券 合計			2,831,073,078	
合計			2,831,073,078	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金 額（円）	金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	535,407,915	1,082,925,447

金銭信託	434,501,630	-
コール・ローン	845,004,586	1,729,159,455
国債証券	166,684,616,502	187,330,033,946
派生商品評価勘定	4,699,833	4,341,690
未収入金	61,730,533	2,827,376,943
未収利息	1,269,292,926	1,281,708,922
前払費用	31,365,717	46,960,770
流動資産合計	169,866,619,642	194,302,507,173
資産合計	169,866,619,642	194,302,507,173
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	805,659	1,600,751
未払金	170,363,464	3,832,899,493
未払解約金	115,688,147	3,405,669
その他未払費用	8,906	987
流動負債合計	286,866,176	3,837,906,900
負債合計	286,866,176	3,837,906,900
純資産の部		
元本等		
元本	1	61,445,933,589
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		108,133,819,877
元本等合計		169,579,753,466
純資産合計		169,579,753,466
負債純資産合計		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 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	59,383,778,765円	61,445,933,589円
期中追加設定元本額	6,447,535,619円	8,771,520,025円
期中一部解約元本額	4,385,380,795円	4,099,345,902円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV	694,267,908円	653,486,435円
A		
ダイワ国内重視バランスファン	26,063,629円	22,093,366円
ド30VA(一般投資家私募)		

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	173,213,023円	128,330,909円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	53,368,772円	41,751,987円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	565,112,790円	442,528,295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)	2,177,730円	31,239,348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)	365,893,917円	413,208,724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)	1,077,780,230円	1,427,469,459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)	706,169,298円	787,285,961円
D-I's 外国債券インデック ス	731,384円	2,452,065円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	27,109円	314,458円
iFree 外国債券インデッ クス	496,757,292円	600,033,543円
iFree 8資産バランス	484,130,513円	772,093,354円
iFree 年金バランス	4,278,927円	14,937,740円
DCダイワ外国債券インデック ス	42,443,714,064円	45,506,848,020円
ダイワ・ライフ・バランス30	739,083,378円	786,129,849円
ダイワ・ライフ・バランス50	367,446,516円	407,847,078円
ダイワ・ライフ・バランス70	237,136,801円	255,622,913円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	329,247,490円	420,775,557円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	263,447,011円	323,134,588円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	82,424,940円	107,264,235円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	10,493,771円	9,559,864円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	18,731,042円	21,464,206円

DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,851,074円	3,128,858円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	1,192,484円	59,508,551円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	- 円	125,482円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	- 円	40,800円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	- 円	199,958円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	249,101,467円	198,065,881円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	154,628,203円	149,085,433円
ダイワ・バランスファンド35 VA	5,694,073,062円	4,935,026,873円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド50VA	17,320,918円	- 円
ダイワ・ワールド・バランス ファンド75VA	8,186,659円	- 円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	328,670,549円	282,957,531円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,930,521円	144,999,465円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	28,480,694円	32,445,382円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	27,731,702円	1,312,096,170円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,534,667,082円	5,710,869,559円
ダイワライフスタイル25	35,273,760円	34,837,008円
ダイワライフスタイル50	62,560,835円	61,720,946円
ダイワライフスタイル75	17,567,044円	17,127,861円
計	61,445,933,589円	66,118,107,712円
2. 期末日における受益権の総数	61,445,933,589口	66,118,107,712口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
----	------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。 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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2018年11月30日現在	2019年12月2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)
国債証券	4,928,875,517	11,319,542,417
合計	4,928,875,517	11,319,542,417

(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(2017年12月1日から2018年11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	69,008,100	-	69,079,500	71,400	792,943,342	-	794,138,360	1,195,018
アメリカ・ドル	-	-	-	-	692,834,338	-	693,818,820	984,482
オーストラリ ア・ドル	-	-	-	-	88,958,190	-	89,162,240	204,050
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	11,150,814	-	11,157,300	6,486
マレーシア・ リングgit	69,008,100	-	69,079,500	71,400	-	-	-	-
買 建	1,116,303,096	-	1,120,268,670	3,965,574	2,973,436,433	-	2,977,372,390	3,935,957
アメリカ・ドル	420,678,874	-	421,248,390	569,516	823,263,537	-	824,358,700	1,095,163
イギリス・ボン ド	54,194,703	-	54,223,290	28,587	252,244,214	-	252,213,690	30,524
オーストラリ ア・ドル	24,749,923	-	25,413,300	663,377	6,661,404	-	6,668,100	6,696
カナダ・ドル	65,526,746	-	65,238,610	288,136	71,898,106	-	72,050,790	152,684

シンガポ ル・ドル	12,449,089	-	12,677,580	228,491	54,130,613	-	54,182,700	52,087
スウェー デン・クロー ナ	-	-	-	-	25,859,325	-	25,859,330	5
デンマー ク・クロー ネ	28,512,966	-	28,786,530	273,564	-	-	-	-
ノルウェ ー・クロー ネ	-	-	-	-	42,874,854	-	42,731,410	143,444
ポーランド ・ズロチ	10,559,159	-	10,816,670	257,511	45,895,875	-	46,015,630	119,755
マレーシア ・リンギット	-	-	-	-	15,757,800	-	15,738,000	19,800
メキシコ・ ペソ	-	-	-	-	72,071,067	-	71,975,920	95,147
ユーロ	499,631,636	-	501,864,300	2,232,664	1,501,277,606	-	1,503,729,120	2,451,514
南アフリカ ・ランド	-	-	-	-	61,502,032	-	61,849,000	346,968
合計	1,185,311,196	-	1,189,348,170	3,894,174	3,766,379,775	-	3,771,510,750	2,740,939

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	2.7598円	2.8807円
(1万口当たり純資産額)	(27,598円)	(28,807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	3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	アメリカ・ドル 4,076,000.000	アメリカ・ドル 4,170,400.160	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,605,106.710	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,553,486.460	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,168,544.660	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,249,308.400	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,467,729.450	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,544,881.820	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	8,168,000.000	8,171,430.560	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,403,679.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,704,723.850	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,711,800.640	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,234,392.500	
		2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,509,303.320	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,020,804.280	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,463,050.040			

2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,655,745.570	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,740,363.780	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,841,593.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,094,628.160	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,967,804.830	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,745,332.160	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,510,022.300	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,360,931.300	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	762,138.900	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,071,084.150	
6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	827,662.500	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	940,311.250	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	910,595.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	950,573.520	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	1,001,576.100	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,373,844.600	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,091,000.000	1,486,356.580	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,798,069.260	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,082,447.820	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	746,091.040	

4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	718,446.510	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,535,870.320	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,513,787.190	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,477,205.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,663,084.500	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,010,000.000	2,852,772.900	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	2,037,895.960	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	2,061,204.140	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,998,750.780	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,542,738.720	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,891,152.900	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,745,905.060	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,693,440.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,897,384.380	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,550,970.960	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,457,758.840	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,899,154.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,826,000.000	3,309,952.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,898,000.000	4,387,666.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,879,544.880	

3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,625,076.360	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,117,000.000	5,224,061.300	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,472,657.280	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,859,902.760	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,367,071.360	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,929,000.000	4,624,825.900	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,308,571.820	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,654,725.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,177,686.770	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,089,807.710	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	4,435,784.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,899,073.580	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,200,690.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,420,544.180	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,841,664.740	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,978,469.380	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,813,522.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,900,684.850	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,922,744.640	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,435,982.850	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,620,567.360	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,844,312.480	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,858,462.880	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,201,465.490	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,843,904.510	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	4,073,000.000	4,610,758.190	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,462,359.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,482,036.320	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,022,032.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,298,953.540	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,577,364.060	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,093,554.160	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,357,225.790	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,044,521.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,068,826.880	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,114,746.400	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,339,545.620	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,571,781.810	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,627,783.840	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,285,704.640	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,247,338.720	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,983,927.960	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,115,866.720	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,994,347.030	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,440,224.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,070,807.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,623,553.570	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,687,742.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,500,575.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,478,500.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,975,610.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,322,780.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,507,457.200	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,665,294.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,666,441.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,744,138.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,379,000.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,482,880.850	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,013,222.680	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	6,500,000.000	6,619,275.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,976,540.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,500,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,809,050.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,538,231.300	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,405,232.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,014,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,561,500.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,529,783.600	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,025,260.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,541,603.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,128,258.850	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,025,260.700	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,346,000.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	7,550,000.000	7,704,473.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,917,197.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,958,723.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,075,575.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,018,030.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,046,620.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,010,530.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,800,000.000	5,891,930.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,011,940.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,437,872.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,119,362.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,920,155.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,064,440.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	4,224,498.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,201,984.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,021,860.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,519,125.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	1,500,000.000	1,533,045.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,528,125.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,707,955.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	3,893,470.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,600,870.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	2,003,660.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,272,224.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,881,368.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,307,705.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,581,480.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,782,328.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,516,500.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,403,884.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,707,848.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,848,284.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	4,197,348.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,228,352.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,982,679.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,040,447.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,523,325.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,011,104.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,072,780.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,040,410.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,593,350.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,018,750.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,774,076.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,595,500.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,071,650.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,587,100.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,171,780.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,350,127.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	4,550,000.000	4,730,908.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,302,464.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,904,802.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,545,400.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,661,125.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,746,808.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,807,540.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,567,095.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,680,075.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,138,270.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,066,660.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,683,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,187,800.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,093,560.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	8,120,082.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,800,000.000	6,001,488.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,526,050.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,200,130.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	5,000,000.000	5,240,200.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,855,216.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	4,000,000.000	4,035,280.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,685,640.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,597,850.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,054,000.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,077,444.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,055,410.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,027,750.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,138,120.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,633,775.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	5,379,838.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,029,640.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,616,775.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,399,759.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,559,745.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,580,850.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,753,909.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,440,494.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,850,000.000	5,547,187.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	6,900,000.000	7,256,316.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,591,595.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,912,000.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,000,000.000	2,013,980.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,513,510.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,074,520.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,516,940.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	4,700,000.000	4,697,603.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,038,400.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,014,200.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,706,016.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,518,305.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,000,000.000	2,018,900.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	6,799,191.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,489,745.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,850,000.000	4,891,273.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,090,917.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,738,288.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,930,000.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	2,992,140.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,087,046.000	

	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,483,200.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,981,010.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,880,628.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,000,000.000	2,980,290.000	
	1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,543,523.000	
	1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	4,500,000.000	4,468,680.000	
	1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	3,000,000.000	2,993,190.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,000,000.000	2,073,580.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 827,399,572.600 (90,749,185,123)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,979,117.430	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,500,184.720	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,531,241.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,561,045.400	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,319,907.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,390,000.000	1,489,107.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,650,000.000	1,824,900.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,711,281.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,590,452.800	
	0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,017,220.000	

1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,300,000.000	2,502,952.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,135,716.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,900,000.000	1,940,318.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	370,000.000	419,802.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	962,140.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,300,000.000	1,322,269.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	100,000.000	100,508.000	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,225,357.880	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,399,139.170	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,883,638.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,815,608.960	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	3,017,520.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,380,738.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,288,412.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,558,090.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,591,891.840	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,946,000.000	3,253,128.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,897,112.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,697,689.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,251,566.600	

	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,490,487.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,510,000.000	2,251,561.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,666,796.600	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,490,398.400	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	848,168.750	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,646,470.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,318,160.740	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,066,000.000	2,953,966.800	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,068,463.040	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,641,000.000	3,124,464.000	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,538,619.360	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,185,575.200	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 85,751,187.290 (12,141,510,608)	
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	2,596,079.200	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,447,946.120	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,402,995.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,297,376.290	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,692,280.910	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,760,975.360	

	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,050,817.460	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,780,459.980	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,148,000.000	3,814,463.080	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,527,291.990	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	807,000.000	974,718.810	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	842,000.000	1,103,070.520	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,038,651.840	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,289,665.080	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,633,822.440	
	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,848,456.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,215,016.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,622,989.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,400,000.000	2,789,280.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,770,000.000	3,168,436.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	390,000.000	478,015.200	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,140,000.000	1,192,360.200	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 49,725,168.100 (3,692,093,731)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	カナダ・ドル 425,000.000	カナダ・ドル 591,141.000	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	853,971.940	

5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,351,536.530	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,704,531.150	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,695,977.920	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,962,447.400	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	978,829.280	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,801,393.780	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,200,994.390	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,251,684.350	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,466,440.650	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,297,000.000	1,656,398.700	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,202,910.480	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,369,000.000	1,370,861.840	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,816,297.010	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,444,213.600	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,198,038.400	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,405,915.200	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,723,750.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,250,016.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,610,208.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,017,550.000	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	890,000.000	991,566.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,305,217.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,237,416.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	301,974.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,051,669.500	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,400,840.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	399,304.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	550,000.000	537,713.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	795,040.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	600,000.000	592,974.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	2,200,000.000	2,196,172.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 43,364,993.920 (3,582,815,798)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	868,114.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	456,834.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	662,417.210	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	398,023.300	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	500,341.050	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	452,400.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	698,779.400	

	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	618,000.000	733,164.300	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	325,000.000	357,646.250	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	544,436.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	781,987.680	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	257,200.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	457,824.200	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	502,750.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	314,850.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	452,925.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	589,600.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	190,000.000	193,174.900	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	160,713.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 9,383,180.290 (752,624,891)	
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	9,578,581.150	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,581,686.200	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,277,470.700	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,527,638.750	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,438,166.500	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,138,546.400	

	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,872,731.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,900,000.000	4,186,962.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 54,601,783.200 (625,736,435)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,162,000.000	デンマーク・クローネ 23,542,469.880	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,103,339.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,262,998.300	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,513,000.000	7,420,195.770	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,521,414.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	4,437,404.600	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	800,000.000	822,272.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 58,110,094.050 (939,640,221)	
ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	6,998,000.000	ノルウェー・クローネ 7,254,126.800	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,335,505.080	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,393,812.150	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,484,288.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,389,999.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,556,605.000	

	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,681,580.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,357,152.500	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 34,453,069.830 (409,991,531)	
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	2,572,987.970	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,504,481.750	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,147,993.490	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,069,855.180	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,981,671.700	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,361,272.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,929,087.500	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,570,000.000	2,654,732.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,040,000.000	2,177,190.000	
	Poland Government Bond 20210525	800,000.000	784,856.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	1,900,000.000	1,944,042.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,104,996.050	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,172,411.040	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,855,028.750	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,910,187.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,788,848.760	

ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 37,959,643.390 (1,063,629,208)	
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	576,753.150	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	836,390.160	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,272,958.580	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,948,169.640	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,604,597.760	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,374,100.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	882,691.250	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	754,223.870	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	646,477.440	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,012,301.290	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,447,748.580	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,209,862.320	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	682,086.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,099,565.390	
	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	871,363.320	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	762,116.960	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,182,617.820		
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	869,913.400		

3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,331,308.020	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,037,852.100	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	670,468.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	355,970.560	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	900,000.000	916,578.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	776,835.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	919,610.300	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,186,038.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,234,404.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	815,720.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	768,845.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	685,752.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	671,671.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	910,000.000	943,124.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,100,000.000	1,268,520.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	404,736.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 33,021,369.410 (866,480,733)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	15,290,000.000	14,327,953.200	
8% Mexican Bonos 20471107	13,300,000.000	14,328,356.000	
7.25% Mexican Bonos 20211209	13,000,000.000	13,088,010.000	
8% Mexican Bonos 20240905	13,300,000.000	13,866,580.000	
6.75% Mexican Bonos 20230309	5,000,000.000	4,977,600.000	

	8% Mexican Bonos 20231207	20,633,000.000	21,421,180.600	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	26,990,677.980	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	26,468,000.000	27,171,784.120	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,244,777.840	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	19,544,000.000	21,457,553.040	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	13,684,960.380	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	26,326,000.000	26,222,538.820	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,624,882.900	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	24,424,839.080	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	19,472,164.440	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	9,944,000.000	10,427,278.400	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 276,731,136.800 (1,552,461,677)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	449,885.520	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	299,506.500	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	433,091.250	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,154.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	400,000.000	504,568.000	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	781,080.300	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	317,364.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	423,183.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	529,815.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	530,045.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,358.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	954,791.370	

0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,208,434.460	
1.5% Austria Government Bond 20470220	534,000.000	677,389.680	
1.5% Austria Government Bond 20861102	200,000.000	270,910.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,604.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	612,764.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	940,674.600	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	406,468.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,078,380.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,200,000.000	1,269,804.000	
Austria Government Bond 20240715	300,000.000	306,579.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,489,627.220	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,274,000.000	1,410,267.040	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	957,763.320	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,392,157.640	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,168,284.960	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	640,464.000	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	503,362.300	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,506,526.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,096,903.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	665,219.800	

1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	353,721.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,640,000.000	1,771,839.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	629,106.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	800,000.000	873,808.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	756,300.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,251,726.360	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,106,820.400	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,047,426.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,818,475.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,599,372.780	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,404,056.480	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,083,405.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,551,081.570	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,272,044.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,599,000.000	3,194,114.430	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,385,456.360	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,415,798.170	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,778,055.840	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,487,320.650	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	2,965,848.130	

1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,361,474.940	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,438,000.000	3,899,312.820	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,743,018.120	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,508,474.400	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,953,184.150	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,757,396.940	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,718,426.850	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,609,000.000	4,270,019.850	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,745,812.560	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,659,654.600	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,319,365.160	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,327,596.480	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,311,348.160	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,952,315.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,689,136.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,478,779.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,306,955.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,620,855.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,014,133.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,400,000.000	2,544,504.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,966,500.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	382,128.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	704,599.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	403,276.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,971.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	505,625.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	200,000.000	202,596.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,591,523.460	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,416,702.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,178,072.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,139,564.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	746,191.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,947,557.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	2,250,000.000	2,310,007.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,200,000.000	1,234,536.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,605,272.800	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,173,229.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,633,261.410	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,855,885.440	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,483,765.340	

4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,664,000.000	3,319,646.720	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,427,837.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,366,965.760	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,872,603.070	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,631,291.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,438,971.650	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,929,007.940	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,457,100.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,946,935.300	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,583,134.980	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,918,760.420	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	3,968,161.940	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,620,583.780	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,470,176.140	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,174,142.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,774,453.540	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,457,587.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,814,125.940	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,162,471.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,937,228.460	

1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,414,914.110	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,037,000.000	1,375,642.720	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,795,317.800	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,300,000.000	3,424,080.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,060,680.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,870,000.000	2,337,051.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,735,400.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	3,023,302.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,446,440.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,424,515.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,417,784.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,150,000.000	2,470,973.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,950,000.000	3,184,820.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,452,272.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,418,424.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	3,027,375.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,500,000.000	2,640,325.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	2,200,000.000	2,246,508.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	1,800,000.000	1,808,280.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	688,923.680	

5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,831,576.530	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,612,757.650	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	900,553.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,790,554.480	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,555,578.640	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,548,136.420	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,564,886.400	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,504,691.700	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,549,000.000	2,610,622.640	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,693,439.280	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,343,737.350	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,420,340.520	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,215,888.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,300,896.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,432,508.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,254,466.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,100,000.000	1,149,841.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	429,716.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,475,569.900	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,579,419.000	

6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,378,102.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,979,273.540	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,629,000.000	1,961,967.600	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,676,745.990	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,756,571.880	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,797,829.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,023,615.830	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,557,873.280	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,583,251.200	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,410,780.050	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,870,281.340	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,686,973.500	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	979,828.080	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	2,068,000.000	2,115,977.600	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,568,491.500	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,366,718.360	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,034,308.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,866,617.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,641,128.400	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,376,622.000	

1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,282,550.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,802,872.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,828,010.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,734,102.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,900,000.000	1,978,584.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,492,062.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,000,000.000	2,148,220.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	919,467.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,350,063.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,503,375.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,767,899.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,508,556.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,500,000.000	1,646,190.000	
2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,251,048.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,206,320.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,651,062.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,073,772.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,205,900.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	1,200,000.000	1,264,308.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,075,990.000	

3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	700,000.000	813,617.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,400,000.000	1,402,842.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	735,523.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	700,000.000	688,093.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	300,000.000	297,567.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,769,592.580	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,220,992.930	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	2,055,000.000	3,055,887.750	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,546,110.840	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,631,017.600	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,905,831.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	3,001,675.500	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,609,831.910	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,589,170.280	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	3,017,960.460	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,532,996.900	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,248,712.960	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,470,254.570	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,235,332.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,900,081.900	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,710,000.000	3,126,527.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,139,145.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,162,341.920	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,613,000.000	2,380,175.060	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,562,394.540	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,823,351.530	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,525,537.450	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,341,491.600	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,661,339.700	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,520,393.220	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,915,220.240	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	971,584.450	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,935,526.400	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,575,431.460	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,307,906.600	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,497,739.600	
4% Belgium Government Bond 20320328	980,000.000	1,450,762.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,472,683.080	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	953,000.000	1,663,347.140	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,715,669.900	

3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,045,643.130	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,469,847.600	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	576,757.440	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	705,734.620	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	941,844.040	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	531,278.760	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	1,017,088.490	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,153,775.440	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	658,570.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,711.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	539,775.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	789,229.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	225,910.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	700,000.000	769,454.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	469,696.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,238,316.750	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,435,322.980	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,123,414.920	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,164,380.000	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	878,158.510	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	975,872.640	
3.8% Austria Government Bond 20620126	388,000.000	850,352.440	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,031,214.520	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,044,725.010	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,021,775.460	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,028,238.320	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	834,930.590	

3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	485,080.380	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	488,206.670	
1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	331,503.120	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	477,563.420	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	618,640.000	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	587,454.500	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,550,226.400	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,445,000.000	2,659,108.650	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,365,997.040	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,013,562.880	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,938,291.180	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,781,677.950	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,552,000.000	2,141,682.400	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,150,000.000	1,844,841.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,190,918.100	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,118,105.600	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,500,000.000	2,737,225.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,850,000.000	2,253,022.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,242,003.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,307,553.000	

0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,022,240.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,600,000.000	1,745,936.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,743,781.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,428,294.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,074,002.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,210,104.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,086,580.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,100,000.000	1,267,475.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	900,000.000	914,535.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,200,000.000	2,239,380.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,233,270.410	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,544,745.160	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,708,000.000	2,952,705.000	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,028,828.400	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,197,342.110	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,761,138.930	
5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,726,310.300	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,716,042.650	
5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,246,375.040	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,076,527.200	

	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,242,077.420	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,516,019.600	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,422,427.160	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,310,081.100	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,388,923.370	
ユーロ 小計			ユーロ 578,388,411.770 (69,904,023,447)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	21,934,000.000	24,289,711.600	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,234,185.320	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,626,159.800	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,100,130.400	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,330,666.850	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,439,000.000	8,523,390.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	21,552,000.000	18,646,790.400	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,668,172.250	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	14,862,000.000	13,693,549.560	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	12,644,000.000	10,957,796.160	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,717,580.650	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,166,000.000	9,380,981.480	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	8,679,000.000	7,809,624.570	

	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 139,978,739.040 (1,049,840,543)
国債証券	合計		187,330,033,946 [187,330,033,946]
合計			187,330,033,946 [187,330,033,946]

- (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 243銘柄	100%	48.4%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100%	2.0%
カナダ・ドル	国債証券 33銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 19銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 34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 304銘柄	100%	37.3%
南アフリカ・ランド	国債証券 13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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
--	---------------	--------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	74,737,500	115,243,680
金銭信託	78,032,547	-
コール・ローン	151,755,151	301,630,437
国債証券	10,060,492,591	14,286,895,440
派生商品評価勘定	4,216,740	1,960
未収入金	146,142,201	38,007,169
未収利息	181,535,563	250,564,347
前払費用	18,186,368	13,301,008
流動資産合計	10,715,098,661	15,005,644,041
資産合計	10,715,098,661	15,005,644,041
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	68,331	405,301
未払金	27,400,077	230,016,759
未払解約金	1,299,646	188,144
その他未払費用	1,088	79
流動負債合計	28,769,142	230,610,283
負債合計	28,769,142	230,610,283
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,027,339,497
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,658,990,022
元本等合計		10,686,329,519
純資産合計	10,686,329,519	14,775,033,758
負債純資産合計	10,715,098,661	15,005,644,041

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	5,227,992,401円	8,027,339,497円
期中追加設定元本額	3,153,540,693円	3,046,531,608円
期中一部解約元本額	354,193,597円	580,957,645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）	1,275,649円	24,087,952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)	190,979,446円	210,581,869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)	368,899,713円	399,927,854円
D-I's 新興国債券インデックス	50,491,474円	56,386,451円
iFree 新興国債券インデックス	1,662,774,236円	2,414,507,089円
iFree 8資産バランス	1,010,520,671円	1,569,459,867円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	4,525,482,673円	5,613,762,483円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	186,442,653円	170,695,726円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	30,472,982円	33,504,169円
計	8,027,339,497円	10,492,913,460円
2. 期末日における受益権の総数	8,027,339,497口	10,492,913,460口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	19,307,971	159,731,019
合計	19,307,971	159,731,019

(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(2018年7月6日から2018年11月30日まで、及び2019年7月6日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	5,053,160	-	5,051,200	1,960
ハンガリー・ フォロント	-	-	-	-	5,053,160	-	5,051,200	1,960
買 建	180,283,137	-	184,431,546	4,148,409	335,714,491	-	335,309,190	405,301
タイ・パーツ	-	-	-	-	36,445,267	-	36,398,010	47,257
チェコ・コル ナ	13,884,990	-	13,968,900	83,910	-	-	-	-
トルコ・リラ	17,473,405	-	18,703,600	1,230,195	34,097,701	-	34,063,470	34,231
ハンガリー・ フォロント	10,781,457	-	10,819,916	38,459	-	-	-	-
ブラジル・ レアル	-	-	-	-	54,406,800	-	54,348,000	58,800
ポーランド・ ズロチ	40,549,425	-	40,936,080	386,655	63,354,377	-	63,299,960	54,417
メキシコ・ペ ソ	34,002,659	-	34,361,730	359,071	76,500,109	-	76,328,000	172,109
ルーマニア・レ イ	33,721,442	-	33,846,120	124,678	5,037,000	-	5,032,000	5,000
南アフリカ・ ランド	29,869,759	-	31,795,200	1,925,441	65,873,237	-	65,839,750	33,487
合計	180,283,137	-	184,431,546	4,148,409	340,767,651	-	340,360,390	403,341

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.3312円	1.4081円
(1万口当たり純資産額)	(13,312円)	(14,081円)

附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	8,727,592,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	6,651,540,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,496,535,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,244,447,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,628,000,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	5,000,000,000.000	5,350,150,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	9,000,000,000.000	9,713,430,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	4,000,000,000.000	3,960,840,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	4,000,000,000.000	4,007,040,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	2,200,000,000.000	2,210,626,000.000			

12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615	1,600,000,000.000	1,762,720,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	4,700,000,000.000	5,663,171,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	4,180,000,000.000	5,152,686,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20210715	9,210,000,000.000	9,534,560,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,445,645,500.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	10,224,000,000.000	11,046,009,600.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,033,337,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	10,344,358,700.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20220515	8,660,000,000.000	8,836,923,800.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	10,699,327,900.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	8,700,000,000.000	8,141,286,000.000	
6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	6,975,000,000.000	6,452,712,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,020,000,000.000	12,912,124,400.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	14,055,640,500.000	
9% Indonesia Treasury Bond 20290315	7,820,000,000.000	8,759,885,800.000	
インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 185,830,589,600.000 (1,449,478,599)	
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	5,196,650.000	
8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,406,096.000	
ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 7,602,746.000	

			(22,047,964)	
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	112,516,200.000	
	7.75% Colombia Government International Bond 20210414	95,000,000.000	98,417,150.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	44,066,250.000	
	7% Colombian TES 20220504	4,335,000,000.000	4,515,119,250.000	
	10% Colombian TES 20240724	4,550,000,000.000	5,369,000,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	4,090,000,000.000	4,023,292,100.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	3,810,000,000.000	4,132,059,300.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	2,944,647,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	3,000,000,000.000	3,100,920,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,300,000,000.000	2,347,012,000.000	
7.25% Colombian TES 20341018	1,700,000,000.000	1,789,454,000.000		
コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ 28,476,503,250.000 (888,466,901)		
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	26,050,000.000	33,565,164.500	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	19,300,000.000	20,821,612.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	20,610,000.000	23,453,973.900	
	3.65% Thailand Government Bond 20211217	30,600,000.000	32,055,336.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	22,700,000.000	27,276,547.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	21,200,000.000	21,505,280.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	25,100,000.000	30,537,162.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	23,400,000.000	24,388,884.000	
2% Thailand Government Bond 20221217	26,000,000.000	26,531,700.000		

	3.775% Thailand Government Bond 20320625	29,000,000.000	35,533,410.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	21,000,000.000	25,041,870.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	22,000,000.000	22,901,560.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	26,000,000.000	28,780,440.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	16,000,000.000	19,480,480.000	
	1.45% Thailand Government Bond 20241217	10,000,000.000	10,027,400.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 381,900,819.400 (1,386,299,974)	
チェコ・コルナ	3.85% Czech Republic Government Bond 20210929	チェコ・コルナ 8,200,000.000	チェコ・コルナ 8,541,776.000	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	12,600,000.000	13,732,110.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,300,220.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,157,270.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	17,046,680.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	10,900,000.000	10,644,940.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	12,000,000.000	11,406,000.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,572,112.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	13,000,000.000	12,004,720.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	12,000,000.000	13,456,080.000	
	チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 117,861,908.000 (557,486,825)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	

	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301	425,000,000.000	439,819,750.000	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	550,000,000.000	599,560,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	664,494,600.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	548,834,200.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	320,000,000.000	364,473,600.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	263,022,500.000	
	チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 2,880,205,150.000 (390,267,797)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	9.5% Turkey Government Bond 20220112	1,660,000.000	1,590,678.400	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	730,805.300	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,422,686.600	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	642,810.800	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,461,669.900	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,286,257.900	
	10.7% Turkey Government Bond 20210217	1,610,000.000	1,596,637.000	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,402,795.800	
	9.2% Turkey Government Bond 20210922	2,010,000.000	1,928,936.700	
	11% Turkey Government Bond 20220302	2,400,000.000	2,364,672.000	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,804,778.900	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,851,949.000	

	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,562,470.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,408,330.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	2,028,000.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	1,400,000.000	1,567,860.000	
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 28,651,338.300 (546,954,049)	
ドミニカ・ペソ	9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 11,273,570.000	
ドミニカ・ペソ 小計			ドミニカ・ペソ 11,273,570.000 (23,336,290)	
ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	108,698,690.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	188,861,500.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20211027	89,000,000.000	93,223,050.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	145,927,600.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	141,983,400.000	
	0.5% Hungary Government Bond 20210421	60,000,000.000	60,401,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	125,118,400.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	120,000,000.000	131,829,600.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	160,000,000.000	171,752,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	160,611,480.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	147,106,250.000	

	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	176,272,500.000	
ハンガリー・フォリント 小計			ハンガリー・フォリント 1,651,785,870.000 (596,129,520)	
フィリピン・ペソ	4.95% Philippine Government International Bond 20210115	フィリピン・ペソ 15,000,000.000	フィリピン・ペソ 15,183,000.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 15,183,000.000 (32,795,280)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20210101	ブラジル・リアル 5,030,000.000	ブラジル・リアル 5,299,658.300	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	8,210,000.000	9,129,437.900	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	6,390,000.000	7,331,758.200	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	7,250,000.000	8,519,765.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	2,400,000.000	2,878,680.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701	6,030,000.000	5,582,935.800	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	7,200,000.000	6,460,920.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	4,200,000.000	3,647,994.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	7,600,000.000	6,147,488.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 54,998,637.200 (1,423,364,729)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 813,928.100	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,281,043.300	

	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	2,080,473.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	2,139,001.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	1,000,000.000	1,037,420.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,965,000.000	2,470,791.000	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,463,627.600	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,298,297.600	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 15,584,581.600 (501,979,373)	
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	2,462,669.300	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	6,240,000.000	6,475,560.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,260,000.000	2,282,306.200	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	4,230,000.000	4,256,141.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,640,000.000	3,781,632.400	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,256,928.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,083,250.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	3,500,000.000	3,615,395.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	1,700,000.000	1,814,325.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,820,000.000	1,968,439.200	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,751,703.900	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	5,700,000.000	6,032,025.000	

	3.25% Poland Government Bond 20250725	3,550,000.000	3,821,078.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 45,601,453.400 (1,277,752,724)	
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	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	2,000,000.000	2,039,100.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,897,956.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,066,220.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,700,000.000	1,813,254.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,500,000.000	1,577,700.000	
	3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	1,700,000.000	1,730,702.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	1,400,000.000	1,427,328.000	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,350,000.000	1,372,666.500	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,500,000.000	2,550,300.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,810,069.800	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,850,000.000	1,913,048.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,431,514.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,300,000.000	1,340,937.000	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,213,536.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,420,000.000	1,470,807.600	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,120,000.000	2,190,532.400		
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,700,000.000	1,920,252.000		

	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,427,510.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,066,680.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,400,000.000	1,450,960.000	
マレーシア・リングット 小計			マレーシア・リングット 34,711,073.300 (910,818,563)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	13,900,000.000	13,025,412.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	9,500,000.000	10,234,540.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	10,067,700.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	10,000,000.000	10,426,000.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	22,750,000.000	23,619,050.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	20,350,000.000	22,963,347.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	23,230,000.000	23,847,685.700	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	9,364,312.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	11,230,000.000	12,329,529.300	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	14,100,000.000	15,824,007.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	21,950,000.000	21,863,736.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,950,000.000	24,025,437.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	19,450,000.000	19,312,294.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	17,820,000.000	18,601,585.200	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,130,000.000	7,476,518.000	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 242,981,154.100 (1,363,124,274)	
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	1,517,673.300	
	5.95% Romania Government Bond 20210611	940,000.000	973,887.000	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,184,891.000	
	3.25% Romania Government Bond 20210322	1,130,000.000	1,127,468.800	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	1,200,000.000	1,304,736.000	

	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,080,735.000	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,552,784.000	
	3.4% Romania Government Bond 20220308	1,700,000.000	1,692,537.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,517,865.000	
	4% Romania Government Bond 20211027	1,000,000.000	1,008,790.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	1,200,000.000	1,240,224.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,000,000.000	1,029,350.000	
	ルーマニア・レイ 小計		ルーマニア・レイ 15,230,941.100 (385,038,191)	
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	15,253,488.000	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	41,760,000.000	46,351,929.600	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	34,474,870.500	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	14,847,984.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	48,500,312.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	25,124,256.000	
	7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818	29,300,000.000	30,108,680.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	36,332,310.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	56,100,000.000	60,891,501.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	39,000,000.000	40,688,700.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	47,000,000.000	51,805,750.000	

	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	35,600,000.000	37,033,256.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	49,000,000.000	50,139,740.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	38,000,000.000	38,594,700.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	45,000,000.000	47,839,500.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	39,000,000.000	40,667,640.000	
	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	36,000,000.000	39,455,640.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	38,000,000.000	39,926,600.000	
	7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	22,000,000.000	23,038,400.000	
	7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	18,000,000.000	19,773,000.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 740,848,257.100 (1,266,850,520)	
南アフリカ・ランド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	30,050,000.000	33,277,370.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	10,220,000.000	7,247,104.200	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,880,000.000	6,768,788.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	11,440,000.000	9,531,236.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	13,880,000.000	14,018,800.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	23,520,000.000	20,349,504.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	14,500,000.000	12,720,125.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	15,100,000.000	13,912,838.000	

	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	13,100,000.000	11,352,984.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	15,300,000.000	13,839,615.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	14,100,000.000	13,011,198.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	14,000,000.000	12,597,620.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 168,627,182.200 (1,264,703,867)	
国債証券 合計			14,286,895,440 [14,286,895,440]	
合計			14,286,895,440 [14,286,895,440]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 25銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.2%
コロンビア・ペソ	国債証券 11銘柄	100%	6.2%
タイ・バーツ	国債証券 15銘柄	100%	9.7%
チェコ・コルナ	国債証券 10銘柄	100%	3.9%
チリ・ペソ	国債証券 6銘柄	100%	2.7%
トルコ・リラ	国債証券 16銘柄	100%	3.8%
ドミニカ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
ハンガリー・フォリント	国債証券 12銘柄	100%	4.2%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
ブラジル・レアル	国債証券 9銘柄	100%	10.0%
ペルー・ソル	国債証券 8銘柄	100%	3.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	8.9%
マレーシア・リングgit	国債証券 20銘柄	100%	6.4%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	9.5%
ルーマニア・レイ	国債証券 12銘柄	100%	2.7%
ロシア・ルーブル	国債証券 20銘柄	100%	8.9%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	100%	8.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン 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3期計算期間（2018年12月1日から2019年12月2日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,459,042	-
コール・ローン	2,837,498	2,438,639
親投資信託受益証券	1,025,366,135	1,183,301,020
未収入金	-	1,250,000
流動資産合計	1,029,662,675	1,186,989,659
資産合計	1,029,662,675	1,186,989,659
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,166,092	1,727,469
未払受託者報酬	101,674	126,614
未払委託者報酬	966,233	1,203,228
その他未払費用	25,371	31,967
流動負債合計	2,259,370	3,089,278
負債合計	2,259,370	3,089,278
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,970,641,025	1,887,949,644
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	56,762,280	295,950,737
（分配準備積立金）	89,774,534	282,743,991
元本等合計	1,027,403,305	1,183,900,381
純資産合計	1,027,403,305	1,183,900,381
負債純資産合計	1,029,662,675	1,186,989,659

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日		自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		4
有価証券売買等損益		103,220,323		256,614,885
<b>営業収益合計</b>		<b>103,220,324</b>		<b>256,614,889</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,419		2,294
受託者報酬		177,238		237,680
委託者報酬		1,684,440		2,258,740
その他費用		44,495		59,771
<b>営業費用合計</b>		<b>1,908,592</b>		<b>2,558,485</b>
<b>営業利益</b>		<b>101,311,732</b>		<b>254,056,404</b>
経常利益		101,311,732		254,056,404
<b>当期純利益</b>		<b>101,311,732</b>		<b>254,056,404</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		8,771,068		32,039,454
期首剰余金又は期首欠損金( )		37,812,253		56,762,280
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,136,017		40,997,488
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,136,017		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		40,997,488
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,102,148		23,825,981
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		23,825,981
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,102,148		-
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>56,762,280</b>		<b>295,950,737</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	602,124,068円	970,641,025円
期中追加設定元本額	587,481,644円	281,360,657円
期中一部解約元本額	218,964,687円	364,052,038円
2. 計算期間末日における受益権の総数	970,641,025口	887,949,644口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(222,017,335円)、投資信託約款に規定される収益調整金(21,398,266円)及び分配準備積立金(60,726,656円)より分配対象額は304,142,257円(1万口当たり3,425.22円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	100,652,357	236,058,629
合計	100,652,357	236,058,629

## （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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0585円	1.3333円
（1万口当たり純資産額）	（10,585円）	（13,333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	349,695,910	1,183,301,020	
親投資信託受益証券 合計			1,183,301,020	
合計			1,183,301,020	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2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	1,810,524,878	6,707,010,907
投資証券	221,256,748,710	371,984,252,300

派生商品評価勘定	153,885,600	245,738,352
未収配当金	1,524,687,143	2,107,027,911
流動資産合計	225,676,818,806	381,044,029,470
資産合計	225,676,818,806	381,044,029,470
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	9,567,580
前受金	129,780,000	267,609,560
未払金	502,899,564	1,849,124,532
未払解約金	211,997,000	41,938,000
その他未払費用	20,427	2,847
流動負債合計	844,696,991	2,168,242,519
負債合計	844,696,991	2,168,242,519
純資産の部		
元本等		
元本	1	83,907,324,720
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	140,924,797,095	266,908,398,973
元本等合計	224,832,121,815	378,875,786,951
純資産合計	224,832,121,815	378,875,786,951
負債純資産合計	225,676,818,806	381,044,029,470

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	94,976,472,865円	83,907,324,720円
期中追加設定元本額	7,744,165,481円	34,399,601,474円
期中一部解約元本額	18,813,313,626円	6,339,538,216円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	7,602,467,792円	6,057,835,517円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	68,239,398,796円	95,733,686,971円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	370,958,894円	313,885,834円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	28,858円	317,672円
iFree J-REITイン デックス	124,544,351円	127,364,041円
iFree 8資産バランス	500,694,886円	668,611,052円
DC・ダイワJ-REITオー プン	3,857,471,973円	5,212,558,406円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,735,943円	2,011,107円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	5,374,188円	4,918,860円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,385,927円	1,754,845円
ダイワ・ノーロード J-RE ITファンド	49,054,528円	83,956,499円
ダイワファンドラップ J-R EITインデックス	1,004,070,064円	1,211,883,231円

	ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	382,997,468円	1,043,820,781円
	ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス	382,670,698円	349,695,910円
	ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	1,383,470,354円	1,155,087,252円
計		83,907,324,720円	111,967,387,978円
2.	期末日における受益権の総数	83,907,324,720口	111,967,387,978口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 424,200,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,149,400,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	7,188,688,571	15,102,448,797
合計	7,188,688,571	15,102,448,797

（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（2018年9月19日から2018年11月30日まで、及び2019年9月18日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								

買建	3,116,520,000	-	3,270,600,000	154,080,000	6,635,035,440	-	6,871,545,000	236,509,560
合計	3,116,520,000	-	3,270,600,000	154,080,000	6,635,035,440	-	6,871,545,000	236,509,560

## (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)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	2.6795円	3.3838円
(1万口当たり純資産額)	(26,795円)	(33,838円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	3,396	430,612,800	
	サンケイリアルエステート	4,795	596,018,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	10,994	7,497,908,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	42,447	4,991,767,200	
	森ヒルズリート	38,066	6,722,455,600	
	産業ファンド	40,708	6,773,811,200	
	アドバンス・レジデンス	31,381	11,061,802,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト 投資法人	20,591	4,392,060,300	
	A P I 投資法人	16,579	9,433,451,000	
	G L P 投資法人	82,406	11,981,832,400	
	コンフォリア・レジデンシャル	13,776	4,759,608,000	

日本プロロジスリート	47,537	13,866,542,900	
星野リゾート・リート	5,034	2,884,482,000	
ONEリート投資法人	5,157	1,789,479,000	
イオンリート投資	35,706	5,380,894,200	
ヒューリックリート投資法	28,138	5,683,876,000	
日本リート投資法人	10,747	5,163,933,500	
インベスコ・オフィス・Jリート	212,562	4,495,686,300	
日本ヘルスケア投資法	1,604	349,511,600	
積水ハウス・リート投資	96,741	9,345,180,600	
トーセイ・リート投資法人	7,202	960,746,800	
ケネディクス商業リート	12,779	3,590,899,000	
ヘルスケア&メディカル投資	7,057	939,286,700	
サムティ・レジデンシャル	6,623	772,904,100	
野村不動産マスターF	103,183	20,574,690,200	
いちごホテルリート投資	5,481	741,031,200	
ラサールロジポート投資	30,762	5,118,796,800	
スターアジア不動産投	10,980	1,267,092,000	
マリモ地方創生リート	2,845	380,661,000	
三井不動産パーク	8,147	3,951,295,000	
大江戸温泉リート	5,621	533,432,900	
さくら総合リート	7,158	682,157,400	
投資法人みらい	35,889	2,178,462,300	
森トラスト・ホテルリート投	7,763	1,147,371,400	
三菱地所物流REIT	6,513	2,286,063,000	
CREロジスティクスファンド	4,644	646,444,800	
ザイマックス・リート	4,802	657,393,800	
タカラレーベン不動産投	9,390	1,130,556,000	
伊藤忠アドバンスロジ	5,118	601,365,000	
日本ビルファンド	32,040	26,304,840,000	
ジャパンリアルエステイト	33,086	24,582,898,000	
日本リテールファンド	62,532	15,520,442,400	
オリックス不動産投資	65,924	15,881,091,600	
日本プライムリアルティ	20,944	10,346,336,000	
プレミア投資法人	29,884	4,853,161,600	
東急リアル・エステート	22,183	4,642,901,900	
グローバル・ワン不動産投資法人	22,975	3,331,375,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	74,289	15,816,128,100	
森トラスト総合リート	23,646	4,672,449,600	
インヴィンシブル投資法人	145,130	9,346,372,000	
フロンティア不動産投資	11,752	5,541,068,000	

平和不動産リート	20,604	2,857,774,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	21,618	6,018,451,200	
福岡リート投資法人	17,111	3,177,512,700	
ケネディクス・オフィス投資法人	10,235	8,351,760,000	
いちごオフィスリート投資法人	25,619	2,935,937,400	
大和証券オフィス投資法人	7,637	6,231,792,000	
阪急阪神リート投資法人	14,945	2,546,628,000	
スターツプロシード投資法人	5,152	1,040,188,800	
大和ハウスリート投資法人	44,606	13,221,218,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	106,585	9,528,699,000	
日本賃貸住宅投資法人	37,215	4,004,334,000	
ジャパンエクセレント投資法人	29,628	5,469,328,800	
投資証券 合計		371,984,252,300	
合計		371,984,252,300	

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

1,400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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	635,689	-
コール・ローン	1,236,266	1,912,793
親投資信託受益証券	774,541,523	851,368,742
派生商品評価勘定	47,328	23,716
未収入金	-	69,893
流動資産合計	776,460,806	853,375,144
資産合計	776,460,806	853,375,144
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,659,337	43,920
未払金	11,549	12,112,627
未払解約金	447,186	350,736
未払受託者報酬	79,356	90,018
未払委託者報酬	1,091,750	1,238,215
その他未払費用	19,764	28,645
流動負債合計	9,308,942	13,864,161
負債合計	9,308,942	13,864,161
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,743,572,984	1,715,401,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,578,880	124,109,159
（分配準備積立金）	20,053,234	103,204,083
元本等合計	767,151,864	839,510,983
純資産合計	767,151,864	839,510,983
負債純資産合計	776,460,806	853,375,144

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	36,734,656	96,907,219
為替差損益	21,878,563	9,104,674
その他収益	159	2,659
<b>営業収益合計</b>	<b>14,856,252</b>	<b>106,014,553</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,189	2,347
受託者報酬	136,198	174,346
委託者報酬	1,873,907	2,398,258
その他費用	44,783	60,506
<b>営業費用合計</b>	<b>2,056,077</b>	<b>2,635,457</b>
<b>営業利益</b>	<b>12,800,175</b>	<b>103,379,096</b>
経常利益	12,800,175	103,379,096
<b>当期純利益</b>	<b>12,800,175</b>	<b>103,379,096</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	346,512	14,675,884
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>13,194,602</b>	<b>23,578,880</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	20,541,677
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	20,541,677
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,762,409	8,714,610
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,448,573	8,714,610
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	-
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>	<b>23,578,880</b>	<b>124,109,159</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引  個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	438,056,631円	743,572,984円
期中追加設定元本額	460,818,025円	207,870,721円
期中一部解約元本額	155,301,672円	236,041,881円
2. 計算期間末日における受益権の総数	743,572,984口	715,401,824口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(345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(88,702,183円)、投資信託約款に規定される収益調整金(20,905,076円)及び分配準備積立金(14,501,555円)より分配対象額は124,109,159円(1万口当たり1,734.82円)であり、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 2019年12月2日現在	
	1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	35,423,409	89,632,068
合計	35,423,409	89,632,068

## (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2期 2018年11月30日 現在				第3期 2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	751,624,829	-	759,236,838	7,612,009	855,519,658	-	855,539,862	20,204
アメリカ・ドル	545,769,764	-	550,066,229	4,296,465	634,566,706	-	634,584,119	17,413
イギリス・ポンド	41,312,553	-	41,357,088	44,535	45,341,076	-	45,334,152	6,924
イスラエル・シェケル	447,012	-	449,673	2,661	699,176	-	719,340	20,164
オーストラリア・ドル	51,218,192	-	53,122,594	1,904,402	55,821,673	-	55,819,406	2,267
カナダ・ドル	14,072,788	-	14,045,010	27,778	16,559,757	-	16,560,390	633
シンガポール・ドル	24,958,412	-	25,415,312	456,900	31,183,654	-	31,180,303	3,351
ニュージーランド・ドル	3,175,957	-	3,354,042	178,085	3,578,827	-	3,578,352	475
ユーロ	54,043,038	-	54,643,140	600,102	50,172,975	-	50,168,616	4,359
香港・ドル	16,627,113	-	16,783,750	156,637	17,595,814	-	17,595,184	630
合計	751,624,829	-	759,236,838	7,612,009	855,519,658	-	855,539,862	20,204

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

<p>第3期</p> <p>自 2018年12月1日</p> <p>至 2019年12月2日</p>
<p>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。</p>

## （1口当たり情報）

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0317円	1.1735円
（1万口当たり純資産額）	（10,317円）	（11,735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	329,451,568	851,368,742	
親投資信託受益証券 合計			851,368,742	
合計			851,368,742	

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

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	89,993,568	68,199,620
金銭信託	38,116,856	-
コール・ローン	74,128,418	629,102,779
投資信託受益証券	156,653,278	556,331,509
投資証券	19,473,164,421	25,887,626,426
派生商品評価勘定	1,468,386	10,879,213
未収入金	85,262	12,311,686
未収配当金	35,496,598	49,262,263
差入委託証拠金	49,021,064	106,888,475
流動資産合計	19,918,127,851	27,320,601,971
資産合計	19,918,127,851	27,320,601,971
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,938,332	9,460,207
未払金	29,739,082	99,346,566
未払解約金	4,078,000	446,040
その他未払費用	1,470	365
流動負債合計	36,756,884	109,253,178
負債合計	36,756,884	109,253,178
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,618,915,071
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,262,455,896
元本等合計		19,881,370,967
純資産合計		19,881,370,967
負債純資産合計		19,918,127,851
		27,320,601,971

## 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 至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	<p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準  外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首	2017年12月1日	2018年12月1日
期首元本額	5,927,845,320円	8,618,915,071円
期中追加設定元本額	3,311,357,547円	3,230,356,134円
期中一部解約元本額	620,287,796円	1,319,232,786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R	4,302,051,362円	4,865,906,045円
E I Tインデックス（為替ヘッジあり）		
ダイワファンドラップ 外国R	603,629,393円	735,435,579円
E I Tインデックス（為替ヘッジなし）		

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	335,779,045円	329,451,568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)	243,291,029円	230,518,876円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,218,954円	1,341,811円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	33,252円	351,124円
iFree 外国REITイン デックス	76,659,750円	98,214,754円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・インデッ クスファンド(資産形成型)	582,998,251円	868,450,594円
グローバル・リート・インデッ クスファンド(毎月決算型)	- 円	386,949円
DCダイワ・グローバルREI Tインデックスファンド	- 円	386,949円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	1,729,141,932円	2,208,215,204円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	3,185,268円	2,681,724円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	6,196,103円	6,545,141円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,417,273円	2,040,991円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	263,443,683円	241,290,100円
ダイワ・ノーロード グローバ ルREITファンド	26,470,390円	34,970,209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)	222,841,400円	690,658,642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)	220,557,986円	213,192,159円
計	8,618,915,071円	10,530,038,419円
2. 期末日における受益権の総数	8,618,915,071口	10,530,038,419口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p>

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1,813,818	906,505
投資証券	97,930,653	2,470,093,181
合計	96,116,835	2,469,186,676

(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(2017年12月1日から2018年11月30日まで、及び2018年12月1日から2019年12月2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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	190,645,204	-	188,822,713	1,822,491	792,469,626	-	793,982,167	1,512,541
合計	190,645,204	-	188,822,713	1,822,491	792,469,626	-	793,982,167	1,512,541

(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	2018年11月30日 現在				2019年12月2日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	74,778,455	-	75,131,000	352,545	657,354,235	-	657,260,700	93,535
アメリカ・ドル	72,214,130	-	72,569,600	355,470	488,897,170	-	488,834,300	62,870
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	3,704,960	-	3,704,500	460
カナダ・ドル	2,564,325	-	2,561,400	2,925	4,120,010	-	4,119,500	510
ニュージ ーランド・ドル	-	-	-	-	3,522,635	-	3,522,000	635
ユーロ	-	-	-	-	157,109,460	-	157,080,400	29,060
合計	74,778,455	-	75,131,000	352,545	657,354,235	-	657,260,700	93,535

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。  
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3067円 (23,067円)	2.5842円 (25,842円)
---------------------------	----------------------	----------------------

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	54,500.000	5,072,315.000	
		アメリカ・ドル 小計		5,072,315.000 (556,331,509)	
投資信託受益証券 合計				556,331,509 [556,331,509]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,300	584,260.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	107,545.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	19,582	405,934.860	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,100	402,246.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,400	5,231,604.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	53,847	8,142,204.870	
		BOSTON PROPERTIES INC	25,200	3,491,208.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	26,067	1,401,622.590	
		VORNADO REALTY TRUST	27,464	1,773,350.480	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12,100	281,446.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,200	341,700.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,700	177,045.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,400	551,928.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	60,900	5,182,590.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,200	588,612.000	
		EPR PROPERTIES	13,600	964,512.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	42,910.000	
		CITY OFFICE REIT INC	9,300	124,899.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	15,133	308,561.870	
EQUINIX INC	14,800	8,389,380.000			

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,829	334,997.280	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	135,420.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,700	240,996.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,800	785,224.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,700	359,328.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	138,040.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	40,348.530	
HOST HOTELS & RESORTS INC	126,400	2,210,736.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44,508	1,188,808.680	
CORESITE REALTY CORP	6,400	725,696.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,400	980,920.000	
RLJ LODGING TRUST	29,371	501,950.390	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	19,343.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,900	612,161.000	
CYRUSONE INC	19,800	1,233,540.000	
KIMCO REALTY CORP	73,800	1,595,556.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,000	97,440.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	35,950	1,091,082.500	
WHITESTONE REIT	5,800	81,432.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,700	1,506,540.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	499,912.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	42,480	1,004,652.000	
COLONY CAPITAL INC	83,511	407,533.680	
INVITATION HOMES INC	93,897	2,866,675.410	
JBG SMITH PROPERTIES	20,132	802,864.160	
CLIPPER REALTY INC	1,400	12,530.000	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	31,700.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	33,900	1,275,318.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,500	227,220.000	
VICI PROPERTIES INC	79,800	1,973,454.000	
RETAIL VALUE INC	2,709	96,196.590	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	237,750.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	23,868.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,300	84,680.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,900	147,079.000	
SAFEHOLD INC	1,300	53,105.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	124,633.600	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	18,100	267,699.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,200	370,478.000	

CORECIVIC INC	21,424	324,573.600	
COREPOINT LODGING INC	6,700	67,737.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	63,036.000	
STORE CAPITAL CORP	36,400	1,481,844.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,800	215,736.000	
LIFE STORAGE INC	8,200	898,064.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,700	413,511.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,182	241,759.080	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,600	90,882.000	
PARAMOUNT GROUP INC	36,300	493,317.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,700	358,772.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,700	894,982.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,100	438,036.000	
STAG INDUSTRIAL INC	22,600	700,374.000	
VENTAS INC	65,179	3,800,587.490	
CARETRUST REIT INC	17,203	359,198.640	
GEO GROUP INC/THE	20,900	289,674.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,100	1,143,074.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,000	300,240.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,887	732,722.360	
UMH PROPERTIES INC	5,600	87,416.000	
IRON MOUNTAIN INC	50,200	1,612,424.000	
TERRENO REALTY CORP	11,400	658,008.000	
VEREIT INC	184,508	1,800,798.080	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,620	923,288.000	
SUN COMMUNITIES INC	15,900	2,618,889.000	
ACADIA REALTY TRUST	14,911	400,807.680	
ALEXANDER'S INC	400	130,544.000	
PROLOGIS INC	110,302	10,098,148.100	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,800	3,217,896.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	30,300	467,529.000	
SAUL CENTERS INC	1,700	90,338.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	33,040.800	
MACK-CALI REALTY CORP	15,600	333,684.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,800	1,874,040.000	
COUSINS PROPERTIES INC	26,006	1,052,982.940	
SITE CENTERS CORP	27,078	392,360.220	
DUKE REALTY CORP	62,600	2,202,268.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,600	898,854.000	

ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,567	3,610,986.060	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,500	958,050.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,200	1,611,254.000	
GETTY REALTY CORP	5,703	191,392.680	
WELLTOWER INC	70,800	5,987,556.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86,000	2,999,680.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,700	859,335.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,000	652,120.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,000	730,180.000	
EQUITY COMMONWEALTH	20,775	682,458.750	
KILROY REALTY CORP	16,200	1,348,488.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	27,300	1,682,226.000	
LTC PROPERTIES INC	7,200	337,032.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	42,200	467,576.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,028	2,726,011.080	
MACERICH CO/THE	19,100	514,363.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,500	2,333,520.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,400	599,326.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,000	1,672,200.000	
REALTY INCOME CORP	55,617	4,261,930.710	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,300	563,174.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	49,536.000	
PUBLIC STORAGE	26,200	5,519,816.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,400	600,406.000	
REGENCY CENTERS CORP	29,020	1,887,460.800	
RPT REALTY	13,800	203,964.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,100	229,822.000	
SL GREEN REALTY CORP	14,400	1,228,752.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	41,000	300,120.000	
TAUBMAN CENTERS INC	10,500	341,040.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	146,220.000	
UDR INC	50,700	2,436,135.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,200	262,240.000	
WP CAREY INC	29,600	2,469,232.000	
WASHINGTON REIT	13,800	428,766.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,600	655,904.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	31,075.000	
AGREE REALTY CORP	7,400	553,372.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,848	1,590,751.440	

CUBESMART	34,100	1,051,644.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,326	536,564.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	36,478	4,412,014.100	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	28,836.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	22,300	2,364,915.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	74,799.500	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	159,279.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	15,650	302,827.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,000	260,610.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	60,082.000	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24,100	1,157,764.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	107,066.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,342	374,322.600	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86,800	1,801,968.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	182,910.000	
DOUGLAS EMMETT INC	28,800	1,269,216.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,800	523,664.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	281,462	271,610.830	
ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	75,069.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 173,820,536.730 (19,064,636,469)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	413,930	313,758.940	
CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	16,714.140	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	99,570	96,582.900	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	142,710	125,156.670	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	88,110	81,501.750	
REGIONAL REIT LTD	81,310	87,814.800	
NEWRIVER REIT PLC	51,330	99,580.200	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100,490	88,833.160	
LXI REIT PLC	94,038	119,992.480	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	48,353.700	
AEW UK REIT PLC	25,610	23,817.300	
RDI REIT PLC	41,036	52,361.930	
LAND SECURITIES GROUP PLC	134,841	1,292,316.140	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	70,790	73,338.440	
SEGRO PLC	193,210	1,727,297.400	

	HAMMERSON PLC	133,920	398,010.240	
	UNITE GROUP PLC/THE	52,720	659,527.200	
	BRITISH LAND CO PLC	165,490	952,560.440	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,391	402,032.420	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	50,984.500	
	DERWENT LONDON PLC	18,690	691,156.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213,440	314,183.680	
	WORKSPACE GROUP PLC	24,160	268,417.600	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,390	275,108.400	
	SHAFTESBURY PLC	40,680	368,967.600	
	BIG YELLOW GROUP PLC	27,810	307,300.500	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	154,340	358,994.840	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	65,664.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	296,770	439,813.140	
イギリス・ボンド 小計			イギリス・ボンド 9,800,140.710 (1,387,601,923)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	イスラエル・シュケル 657,840.400	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 657,840.400 (20,761,443)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47,520	164,419.200	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	338,284	414,397.900	
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	94,612.650	
	VIVA ENERGY REIT	76,330	212,960.700	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	68,595	388,933.650	
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	64,950	205,242.000	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	170,860	464,739.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57,547	253,206.800	
	NATIONAL STORAGE REIT	135,195	260,926.350	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	86,304.000	
	GDI PROPERTY GROUP	83,310	128,713.950	
	SCENTRE GROUP	985,270	3,881,963.800	
	ARENA REIT	59,890	177,274.400	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	69,225.000	
	BWP TRUST	90,550	385,743.000	

	DEXUS	199,220	2,436,460.600	
	GPT GROUP	354,210	2,178,391.500	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	59,400	273,240.000	
	MIRVAC GROUP	728,040	2,453,494.800	
	STOCKLAND	442,420	2,234,221.000	
	ABACUS PROPERTY GROUP	64,120	248,144.400	
	GOODMAN GROUP	296,450	4,393,389.000	
	VICINITY CENTRES	584,590	1,566,701.200	
	CHARTER HALL GROUP	82,960	896,797.600	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,220	212,534.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 24,082,036.700 (1,788,091,225)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	154,711.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18,400	308,752.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	40,548.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	153,307.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	30,396.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	96,348.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,700	170,154.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10,700	137,388.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,200	30,912.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,600	315,330.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,400	131,694.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,400	171,392.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,400	376,202.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	80,010.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	181,356.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,600	403,578.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,100	781,704.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	238,753.800	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26,066	562,504.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,600	749,064.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	163,998.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	228,091.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,900	148,715.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	151,335.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	544,680.000	

カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 6,350,923.080 (524,713,265)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	220,083	440,166.000
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	129,986.000
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	409,000	482,620.000
	AIMS APAC REIT	89,000	127,270.000
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	86,478.000
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271,650	336,846.000
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	73,530.000
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	520,575	1,046,355.750
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539,516	1,607,757.680
	CAPITALAND MALL TRUST	531,500	1,339,380.000
	SUNTEC REIT	419,400	771,696.000
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	528,000	892,320.000
	KEPPEL REIT	343,400	422,382.000
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	129,960	217,033.200
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	213,600	288,360.000
	ESR-REIT	374,902	200,572.570
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	157,600	255,312.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	130,668	360,643.680
	STARHILL GLOBAL REIT	243,800	175,536.000
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	145,396	231,179.640
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,300	225,225.000
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	64,128.000
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,580	686,685.800
	CACHE LOGISTICS TRUST	174,500	124,767.500
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	395,284	932,870.240
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	134,754.000
	SPH REIT	166,600	176,596.000
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	112,100	58,852.500
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	58,468.000
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148,900	168,257.000
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	436,063	244,195.280
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 12,360,223.840 (991,413,554)

ニュージーランド ド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	223,513.200	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	273,920	432,793.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56,800	151,940.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	188,250	401,913.750	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190,240	345,285.600	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,555,446.150 (109,861,162)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,600	441,028.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	114,409.000	
	WERELDHAVE NV	6,470	140,399.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,200	3,292,080.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,530	170,563.600	
	NSI NV	3,231	130,532.400	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	103,500.000	
	ICADE	4,560	414,276.000	
	ALTAREA	540	105,732.000	
	GECINA SA	9,241	1,448,988.800	
	KLEPIERRE	35,240	1,147,766.800	
	COVIVIO	7,562	759,224.800	
	MERCIALYS	4,030	48,360.000	
	AEDIFICA	4,144	459,984.000	
	COFINIMMO	4,070	546,194.000	
	BEFIMMO	3,720	217,620.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	90,197.500	
	RETAIL ESTATES	1,940	172,854.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,170	509,102.000	
	MONTEA	1,650	130,515.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	40,185.600	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	82,976.400	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	39,553	452,881.850		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	61,770	801,156.900		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58,050	102,168.000		
HIBERNIA REIT PLC	116,240	169,477.920		
ユーロ 小計			ユーロ 12,092,173.570 (1,461,460,098)	

韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 49,740,000.000
韓国・ウォン	小計		韓国・ウォン 49,740,000.000 (4,635,768)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287,000	香港・ドル 1,486,660.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	965,000.000
	FORTUNE REIT	245,000	2,227,050.000
	PROSPERITY REIT	195,000	579,150.000
	LINK REIT	387,500	31,000,000.000
	CHAMPION REIT	375,000	1,890,000.000
香港・ドル	小計		香港・ドル 38,147,860.000 (534,451,519)
投資証券	合計		25,887,626,426 [25,887,626,426]
合計			26,443,957,935 [26,443,957,935]

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 1銘柄 156銘柄	2.8%	97.2%	74.3%
イギリス・ポンド	投資証券 29銘柄	-%	100%	5.2%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	6.8%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	3.7%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	5.5%
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	2.0%

**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 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3期計算期間(2018年12月1日から2019年12月2日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年11月30日現在	第3期 2019年12月2日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	432,546	-
コール・ローン	841,202	1,217,386
親投資信託受益証券	561,199,416	595,706,879
流動資産合計	562,473,164	596,924,265
<b>資産合計</b>		
562,473,164		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	357,215	238,199
未払受託者報酬	57,235	62,203
未払委託者報酬	787,605	855,960
その他未払費用	14,235	15,656
流動負債合計	1,216,290	1,172,018
<b>負債合計</b>		
1,216,290		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 534,454,266	1 508,116,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,802,608	87,636,190
(分配準備積立金)	31,709,700	80,147,605
元本等合計	561,256,874	595,752,247
<b>純資産合計</b>		
561,256,874		
<b>負債純資産合計</b>		
562,473,164		
596,924,265		

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日		自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		25,932,578		65,639,463
その他収益		25		1,226
営業収益合計		25,932,603		65,640,690
営業費用				
支払利息		599		695
受託者報酬		96,615		122,146
委託者報酬		1,329,577		1,680,789
その他費用		24,042		30,577
営業費用合計		1,450,833		1,834,207
営業利益		24,481,770		63,806,483
経常利益		24,481,770		63,806,483
当期純利益		24,481,770		63,806,483
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		319,081		6,352,067
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,309,437		26,802,608
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		12,238,317
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		12,238,317
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,669,518		8,859,151
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		8,859,151
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,967,537		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,802,608		87,636,190

## (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3期	
	自 2018年12月1日	至 2019年12月2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2019年11月30日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年12月2日としております。このため、当計算期間は367日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1. 1 期首元本額	303,982,175円	534,454,266円
期中追加設定元本額	333,551,014円	146,810,171円
期中一部解約元本額	103,078,923円	173,148,380円
2. 計算期間末日における受益権の総数	534,454,266口	508,116,057口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期	第3期
	自 2017年12月1日 至 2018年11月30日	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(520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(57,453,488円)、投資信託約款に規定される収益調整金(16,119,520円)及び分配準備積立金(22,693,597円)より分配対象額は96,267,125円(1万口当たり1,894.59円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期
	2019年12月2日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	25,571,249	62,136,768
合計	25,571,249	62,136,768

## （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2期	第3期
2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期
自 2018年12月1日
至 2019年12月2日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	第2期	第3期
	2018年11月30日現在	2019年12月2日現在
1口当たり純資産額	1.0501円	1.1725円
（1万口当たり純資産額）	（10,501円）	（11,725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	230,518,876	595,706,879	
親投資信託受益証券 合計			595,706,879	
合計			595,706,879	

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。

## 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12月30日

資産総額	2,876,802,702円
負債総額	8,291,838円
純資産総額( - )	2,868,510,864円
発行済数量	2,419,627,490口
1単位当たり純資産額( / )	1.1855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12月30日

資産総額	169,845,085,798円
負債総額	11,544,804,005円
純資産総額( - )	158,300,281,793円
発行済数量	141,195,423,688口
1単位当たり純資産額( / )	1.1211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12月30日

資産総額	2,413,497,784円
負債総額	618,422円
純資産総額( - )	2,412,879,362円
発行済数量	1,800,542,115口
1単位当たり純資産額( / )	1.3401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12月30日

資産総額	52,958,361,279円
負債総額	323,844,128円
純資産総額( - )	52,634,517,151円
発行済数量	24,548,543,913口
1単位当たり純資産額( / )	2.1441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12月30日

資産総額	1,919,662,178円
負債総額	1,167,587円
純資産総額( - )	1,918,494,591円
発行済数量	1,459,508,846口
1単位当たり純資産額( / )	1.3145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12月30日

資産総額	135,752,817,795円
負債総額	119,590,641円
純資産総額( - )	135,633,227,154円
発行済数量	47,903,542,741口
1単位当たり純資産額( / )	2.8314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12月30日

資産総額	9,037,636,797円
負債総額	0円
純資産総額( - )	9,037,636,797円
発行済数量	5,308,832,796口
1単位当たり純資産額( / )	1.7024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12月30日

資産総額	2,174,166,379円
負債総額	2,208,492円
純資産総額( - )	2,171,957,887円
発行済数量	2,120,387,302口
1単位当たり純資産額( / )	1.0243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12月30日

資産総額	83,627,999,237円
負債総額	14,118,156円
純資産総額( - )	83,613,881,081円
発行済数量	58,487,810,699口
1単位当たり純資産額( / )	1.4296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12月30日

資産総額	3,546,935,706円
負債総額	736,569円
純資産総額( - )	3,546,199,137円
発行済数量	3,375,832,092口
1単位当たり純資産額( / )	1.0505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12月30日

資産総額	94,113,613,836円
負債総額	917,620,862円
純資産総額( - )	93,195,992,974円

発行済数量	91,809,606,005口
1単位当たり純資産額( / )	1.0151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12月30日

資産総額	2,873,397,461円
負債総額	616,207円
純資産総額( - )	2,872,781,254円
発行済数量	2,666,121,217口
1単位当たり純資産額( / )	1.0775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12月30日

資産総額	193,500,607,866円
負債総額	721,436,161円
純資産総額( - )	192,779,171,705円
発行済数量	66,705,505,834口
1単位当たり純資産額( / )	2.8900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12月30日

資産総額	15,551,677,225円
負債総額	979,753円
純資産総額( - )	15,550,697,472円
発行済数量	10,657,586,906口
1単位当たり純資産額( / )	1.4591円

ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	1,160,615,325円
負債総額	3,646,754円
純資産総額( - )	1,156,968,571円
発行済数量	889,828,365口
1単位当たり純資産額( / )	1.3002円

## (参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	383,557,030,855円
負債総額	3,159,305,203円
純資産総額( - )	380,397,725,652円
発行済数量	115,257,453,523口
1単位当たり純資産額( / )	3.3004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12月30日

資産総額	836,776,532円
負債総額	5,085,721円
純資産総額( - )	831,690,811円
発行済数量	718,391,973口
1単位当たり純資産額( / )	1.1577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12月30日

資産総額	27,627,260,932円
負債総額	2,600,638円
純資産総額( - )	27,624,660,294円
発行済数量	10,767,989,139口
1単位当たり純資産額( / )	2.5654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12月30日

資産総額	593,454,167円
負債総額	148,071円
純資産総額( - )	593,306,096円
発行済数量	509,866,143口
1単位当たり純資産額( / )	1.1637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  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

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

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2019年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

また、取締役、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。

###### 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. 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。

##### ハ. 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。

##### ニ. 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

###### ・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12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	63	112,878
追加型株式投資信託	699	16,658,358
株式投資信託 合計	762	16,771,237
単位型公社債投資信託	29	93,384
追加型公社債投資信託	14	1,514,905
公社債投資信託 合計	43	1,608,290
総合計	805	18,379,526

## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第60期事業年度（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。

また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	1
建物	213	206
器具備品	12	10
無形固定資産	200	195
ソフトウェア	2,614	2,821
ソフトウェア仮勘定	2,456	2,804
投資その他の資産	158	17
投資有価証券	15,066	12,799
	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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	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 (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)
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 (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)
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	利益剰余金 合計	
				剰余金 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 (2018年3月31日)	当事業年度 (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 (2018年3月31日)	当事業年度 (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せん。

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せん。

(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 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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
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。

剰余金の配当の総額	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
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、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係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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 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 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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 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 5年以内	5年超 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 <sub>    </sub> 其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 5年以内	5年超 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 <sub>    </sub> 其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. 其他有価証券

前事業年度(2018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	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 (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)
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 (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)
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 (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)
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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金		731
	719	
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
<b>繰延税金負債</b>		
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) 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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	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	株大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	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いません。

(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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2019年9月30日)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
固定資産		
有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
投資その他の資産		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2019年9月30日)
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		6,021

未払費用	3,486
未払法人税等	754
賞与引当金	506
その他	2 474
流動負債合計	11,243
固定負債	
退職給付引当金	2,483
役員退職慰労引当金	128
その他	7
固定負債合計	2,619
負債合計	13,862
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,968
利益剰余金合計	7,343
株主資本合計	34,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	10
評価・換算差額等合計	10
純資産合計	34,023
負債・純資産合計	47,886

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	35,076
その他営業収益	309
営業収益合計	35,385
営業費用	
支払手数料	15,895
その他営業費用	6,272

営業費用合計		22,167
一般管理費	1	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	2	968
営業外費用	3	148
経常利益		8,083
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		15
中間純利益		5,785

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金	
				剰余金		
			繰越利益			
				剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	6,083	6,083	6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	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	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	35	35	35
当中間期変動額合計	35	35	6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## （2）その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

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とおりであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

## （2）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年間)に基づく定額法によっております。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

#### (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### (1) 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。

#### (2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### (中間貸借対照表関係)

##### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2019年9月30日現在)
有形固定資産	310百万円

##### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

##### 3 保証債務

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っておりません。

#### (中間損益計算書関係)

##### 1 減価償却実施額

## 当中間会計期間

(自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日)

有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

## 2 営業外収益の主要項目

## 当中間会計期間

(自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日)

受取配当金	901百万円
-------	--------

## 3 営業外費用の主要項目

## 当中間会計期間

(自 2019年4月1日  
至 2019年9月30日)

有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 3月31日	2019年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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)。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	19,529	19,529	-
(2) 未収委託者報酬	11,175	11,175	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,986	7,986	-
資産合計	38,691	38,691	-
(1) 未払金	(5,965)	(5,965)	-
(2) 未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	-
負債合計	(8,833)	(8,833)	-

(\*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・預金及び(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) 未払金及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間（2019年9月30日）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 827百万円）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

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	344
小計	3,947	4,292	344
合計	7,986	7,975	10

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がなく、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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

該当事項はありません。

## (1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1 株当たり純資産額	13,043.35円
1 株当たり中間純利益	2,217.93円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。



#### 4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更(大和アセットマネジメント株式会社に変更)

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（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。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額 単位：百万円 （2019年3月 末日現在）	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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <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 【参考情報】

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

（提出年月日）	（書類名）
2019年2月21日	有価証券届出書、有価証券報告書
2019年8月23日	半期報告書、有価証券届出書

## 独立監査人の監査報告書

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 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 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

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12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

2019年12月27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 公認会計士 深井 康治 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックスの2018年12月1日から2019年12月2日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 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 - R E I T インデックスの2019年12月2日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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11月22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 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 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未 印
指定有限責任社員 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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 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、大和証券投資信託委託株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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。