

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年3月10日提出
【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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス ダイワファンドラップ 日経225インデックス ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップ 日本債券インデックス ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし) ダイワファンドラップ J-REITインデックス ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス
ダイワファンドラップ 日経225インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ J-REITインデックス
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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

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

（注3）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス : FW TOPIXインデックス
ダイワファンドラップ 日経225インデックス : FW 日経225インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス : FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス : FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス : FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）
エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス : FW 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス : FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス : FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス : FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）
エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ J-REITインデックス : FW J-REITインデックス
ス
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス : FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
ス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス : FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）
ス（為替ヘッジなし）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または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。

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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い合わせることにより知ることができます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

2020年3月11日から2020年9月8日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

大和証券株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

（国内のすべての営業所等で取扱います。）

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

大和証券株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

（国内のすべての営業所等で取扱います。）

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。受益権の取得申込者は、販売会社に投資一任契約の資産を管理する口座を開設した者に限るものとします。受益権の取得申込者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

下表に掲げる各ファンドについて、下表に掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受付は行ないません。

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

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合せ下さい。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等^{*}）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付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。

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

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契

約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるもの
とします（以下同じ。）。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機
関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の
振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

<FW TOPIXインデックス>

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

<FW 日経225インデックス>

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	株式
	補足分類	インデックス型
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式 一般））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	日経225

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

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

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	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	為替ヘッジなし
	対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイ指数（円ベース））

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

<FW 日本債券インデックス>

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

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	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	為替ヘッジなし
	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、ヘッジなし・円ベース））

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

<FW J - R E I Tインデックス>

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

<FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

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

<FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

（注1）商品分類の定義

- ・「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「海外」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「株式」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「債券」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「不動産投信（リート）」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「インデックス型」…目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「株式 一般」…大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「債券 一般」…公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
- ・「債券 公債」…目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
- ・「年1回」…目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」…目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの

- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジあり」...目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「その他の指数」...日経225、TOPIXにあてはまらないすべてのもの

<FW TOPIXインデックス>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日経225インデックス>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (除く日本)			
一般 大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	
債券	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
一般 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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日本債券インデックス>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	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。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

<FW 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW J - REITインデックス>

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	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		オセアニア		
公債	年12回 (毎月)	中南米		
社債		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数 (配当込み))
その他債券 クレジット属性 ()	日々	中近東 (中東)		
不動産投信	その他 ()	エマージング		
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。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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 その他資産 ()
	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
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。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

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

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

FW J - REITインデックス	各ファンドについて 1,000億円
FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）	
FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

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

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

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

●各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	FW TOPIXインデックス	東証株価指数(TOPIX)	トピックス・インデックス・ マザーファンド
	FW 日経225インデックス	日経平均株価(日経225)	ストックインデックス225・ マザーファンド
海外の 株式	FW 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)	外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド
	FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数(円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
	FW 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数(円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
		FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド
わが国の 債券	FW 日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数	日本債券インデックス マザーファンド
海外の 債券	FW 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
	FW 外国債券インデックスEM+ (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
		JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)	ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド
わが国の リート	FW J-REITインデックス	東証REIT指数(配当込み)	ダイワJ-REIT マザーファンド
海外の リート	FW 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース) ^(注)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
	FW 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

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

●各ファンドの運用方針

FW TOPIXインデックス

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

- ◆東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
 - (b)ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。
 - (c)株式の組入比率は、高位を保ちます。
- ◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注)を用います。
TOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

FW 日経225インデックス

日経平均株価（日経225）に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行ないます。

- ◆わが国の株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。
投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。
 - (a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。
 - (b)株式の組入比率は、高位を保ちます。
- ◆日経平均株価に採用されている銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします（ただし、財務リスクが高いと判断される銘柄については除く場合があります。）。
日経平均株価への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

FW 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

◆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いません。

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いません。

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

FW 日本債券インデックス

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

◆ポートフォリオの構築にあたっては、マルチファクターモデル^(注1)を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注1) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。

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

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(注2)リスクモデルでは、個別債券のキャッシュフロー(利金と償還金)や価格変化を分析することにより、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようなポートフォリオを構築することができます。

FW J-REITインデックス

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

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

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

FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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。

FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色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。

◆日経平均株価(日経225)

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所第一部上場銘柄のうち市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

◆MSCIコクサイ指数

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

◆FTSE RAFI エマージング インデックス

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

◆ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数

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

◆FTSE世界国債インデックス

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

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

-エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド(円換算)

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

◆東証REIT指数(配当込み)

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

◆S&P先進国REIT指数

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

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

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

〈分配方針〉

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

主な投資制限

●FW TOPIXインデックス

●FW 日経225インデックス

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

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

●FW 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)

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

●FW 日本債券インデックス

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

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

●FW 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

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

●FW J-REITインデックス

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

●FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

FW TOPIXインデックス

FW 日経225インデックス

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

*「FW TOPIXインデックス」および「FW 日経225インデックス」を除きます。

FW 日本債券インデックス

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

*「FW 日本債券インデックス」を除きます。

FW J-REITインデックス

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

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

FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- 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「株東京証券取引所」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株東京証券取引所が有します。
- 株東京証券取引所は、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。
- 株東京証券取引所は、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。
- 株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。
- 「FW TOPIX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、「FW TOPIXインデックス」の購入者または公衆に対し、「FW 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。
- 株東京証券取引所は、当社または「FW 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、株東京証券取引所は「FW 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。

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

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。

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

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

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

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

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

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

- 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。
- [FW 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、[FW J-REITインデックス]の購入者または公衆に対し、[FW 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[FW 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[FW J-REITインデックス]の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

2016年9月26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	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。 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
運用指図	2 損益 信託金（ 3）	
受託会社	<p><FW 日経225 インデックス> みずほ信託銀行 株式会社</p> <p>再信託受託会社： 資産管理サービス 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す。 なお、信託事務の一部につき資産管理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>
	<p><上記以外の各 ファンド> 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す。 なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		

投資対象

ファミリーファンド方式で運用を行いません。

<FW TOPIXインデックス>
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

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

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

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）、新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）、新興国の企業のDR（預託証券）、FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券） など

<FW 日本債券インデックス>
わが国の公社債 など

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

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

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

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

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

<委託会社の概況（2019年12月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	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
----	----	-------	----

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FW TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
FW 日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券およびダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
FW 日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券およびダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
FW J-REITインデックス	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
FW 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	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
FW 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(「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」は総称して)「マザーファンド」といいます。

投資態度

<FW TOPIXインデックス>

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

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

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

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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。

<FW 日経225インデックス>

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

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

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

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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。

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時
、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。

<FW 日本債券インデックス>

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

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

ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時
、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。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時
、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。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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。

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

<FW 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とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（「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。

<FW 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。

<FW 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。

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

(2) 【投資対象】

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」および「FW 日本債券インデックス」は本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

八．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、「FW 日経225インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「FW 日経225インデックス」以外の各ファンドは三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

1．株券または新株引受権証書

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. コマーシャル・ペーパー
 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
 9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 15. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 16. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- 委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

<FW J-REITインデックス>

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

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

イ. 有価証券

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

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券の性質を有するもの

3. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

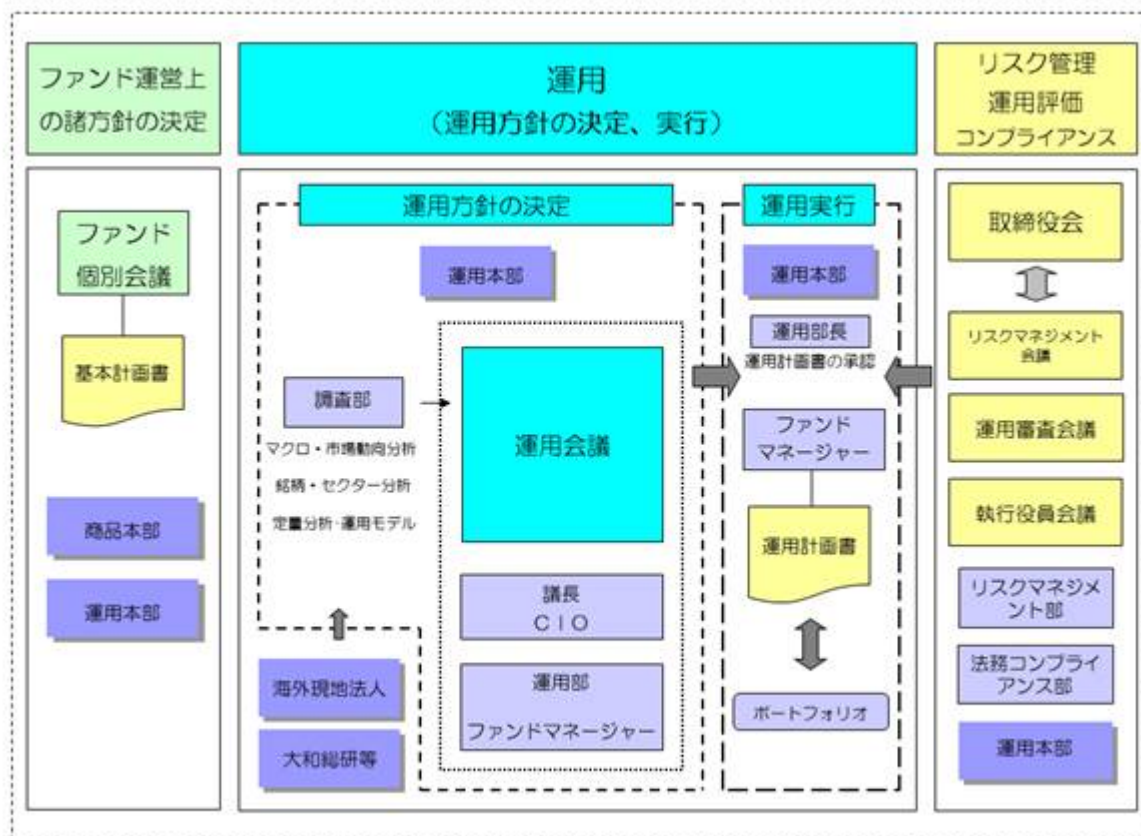
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

<各ファンド共通>

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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)

<各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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。

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FW J-REITインデックス>

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

- <上記以外の各ファンド>
- （規定なし）

投資信託証券(信託約款)

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 日本債券インデックス>
- <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

- <FW J-REITインデックス>

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

イ. 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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。

<FW J - REITインデックス>

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

信用取引(信託約款)

< FW TOPIXインデックス >

< FW 日経225インデックス >

< FW 日本債券インデックス >

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

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

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

< 上記以外の各ファンド >

(規定なし)

先物取引等(信託約款)

< FW TOPIXインデックス >

< FW 日経225インデックス >

< FW 日本債券インデックス >

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

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

< FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

< FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

< FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) >

< FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし) >

< FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) >

< FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし) >

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

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

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

<FW J-REITインデックス>

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

スワップ取引(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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。

- <FW J-REITインデックス>
- (規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

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

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

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

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

デリバティブ取引等(信託約款)

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

<FW J - R E I Tインデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW J - 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)

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

外国為替予約取引（信託約款）

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

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

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

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

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。

<参考> マザーファンドの概要

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。)を投資対象とします。
投資態度	投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。 ロ. ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。 ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

ストックインデックス225・マザーファンド

<p>運用の基本方針</p>	<p>わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。</p>
<p>主要投資対象</p>	<p>わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>イ. 投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 2. 株式の組入比率は、高位を保ちます。 <p>ロ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均株価が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

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、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

主な投資制限

へ. 委託会社は、金利先渡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。

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	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。 ロ. 保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 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。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	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。) ロ. 新興国の企業のDR(預託証券) ハ. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF(上場投資信託証券)
投資態度	イ. 主として、新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)()に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 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。 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。 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。 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。 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。

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

日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>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。</p> <p>ロ.当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>

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	<p>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。</p>
主要投資対象	<p>外国の公社債を主要投資対象とします。</p>
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、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

主な投資制限

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケッツ グローバルダイバーシファイド(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

投資態度	<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号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>イ. 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号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>

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

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

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈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

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

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

<為替変動のイメージ図>



※上記はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

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

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不

能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

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

その他

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

<FW 日本債券インデックス>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

その他

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

<FW外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

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

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の と同内容）

その他

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

<FW 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)

(FW日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

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

<FW J - R E I T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。

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

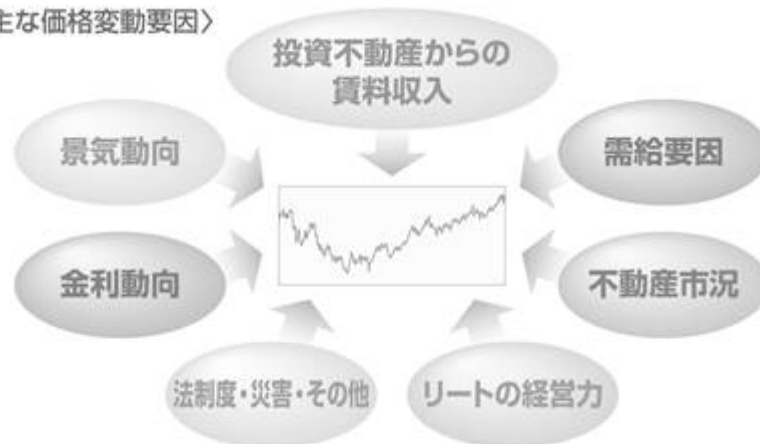
その他

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

<FW 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．リーートの価格や配当は、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーートの収益は、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。

二．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

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

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「FW T O P I Xインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J - R E I Tインデックス」を除きます。)その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消することがあります。

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

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

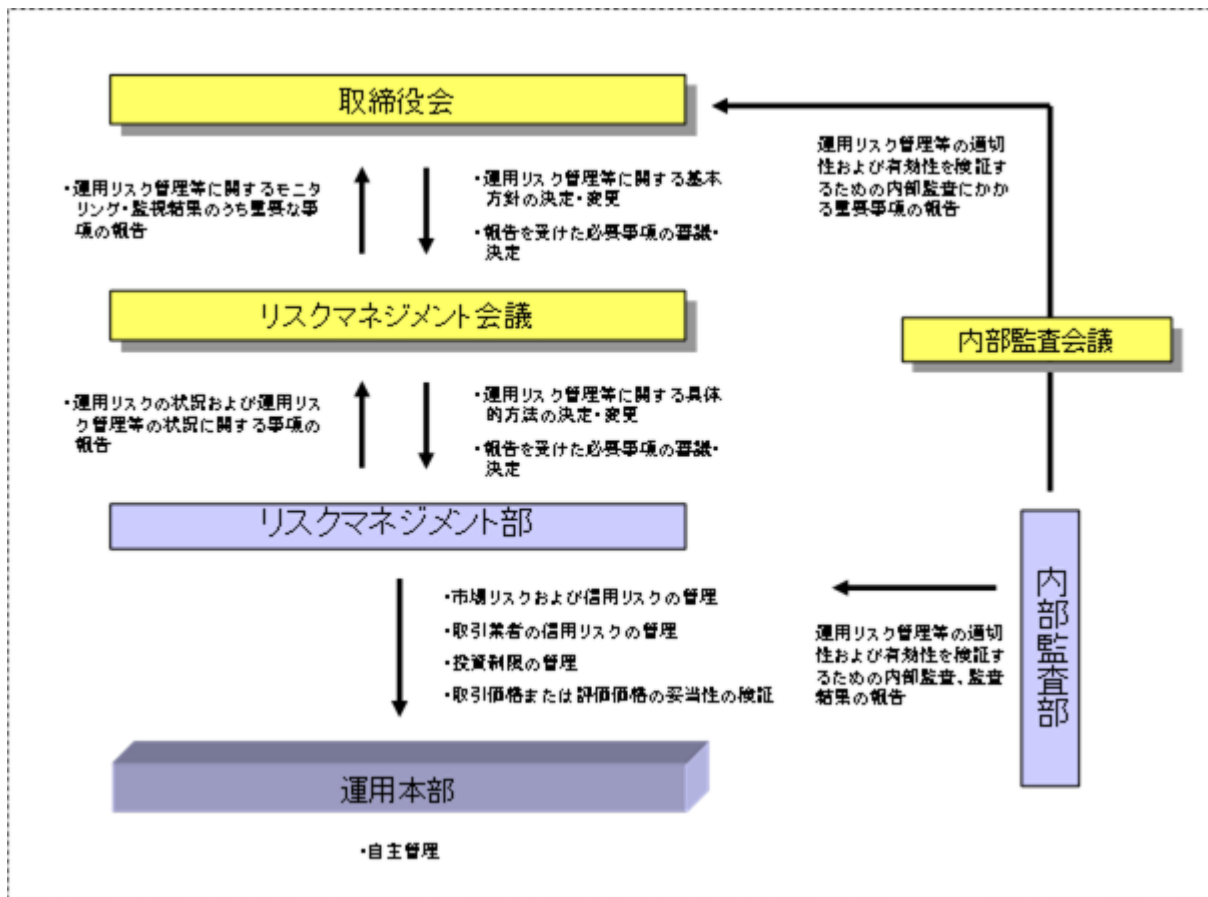
(3) その他の留意点

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参考情報

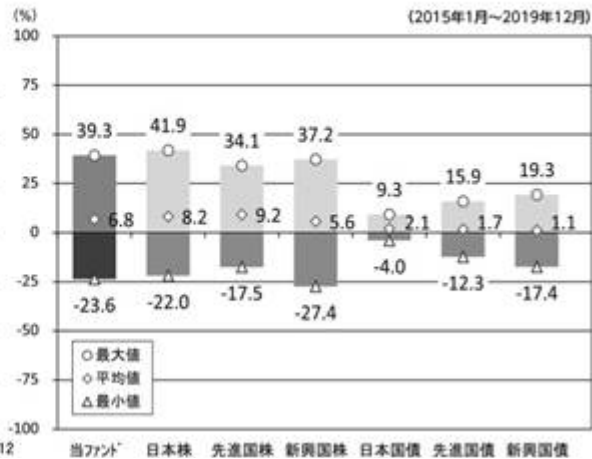
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

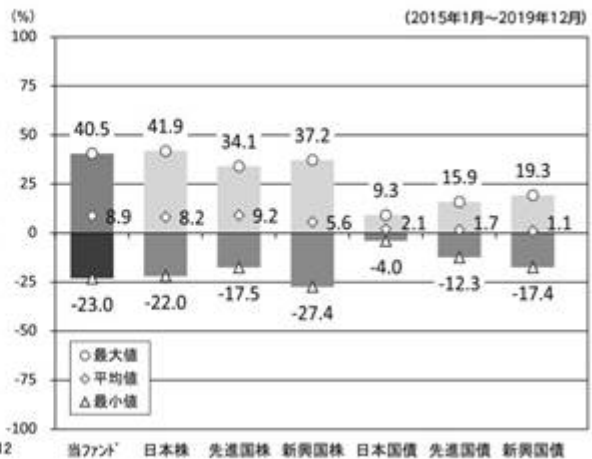
[FW TOPIXインデックス]



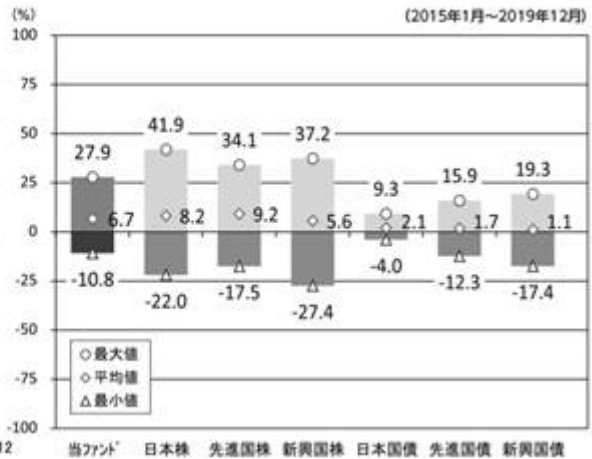
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



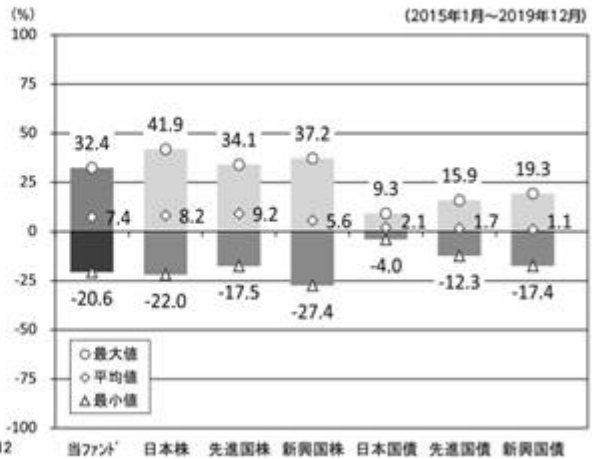
[FW 日経225インデックス]



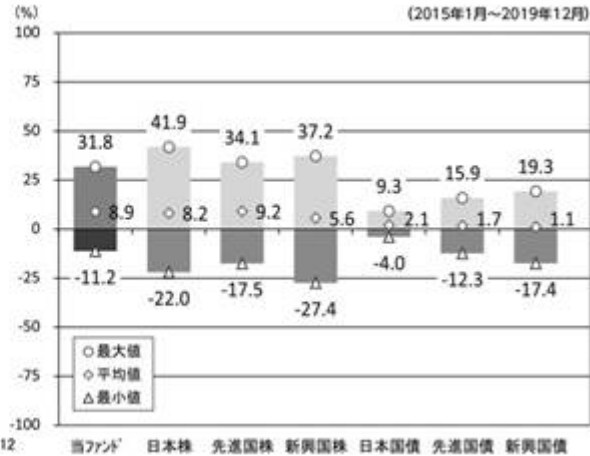
[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



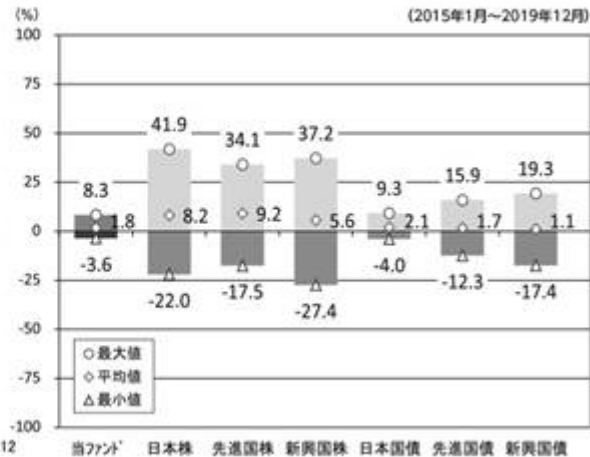
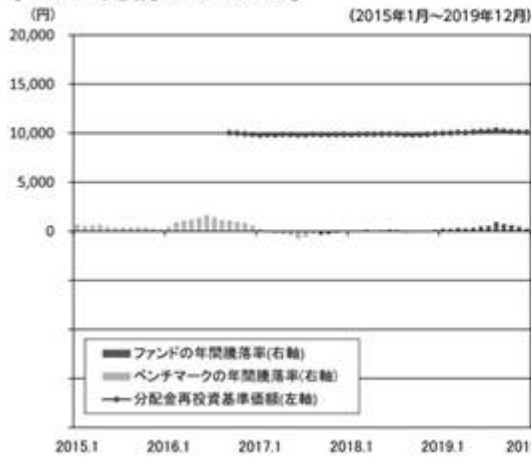
[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]



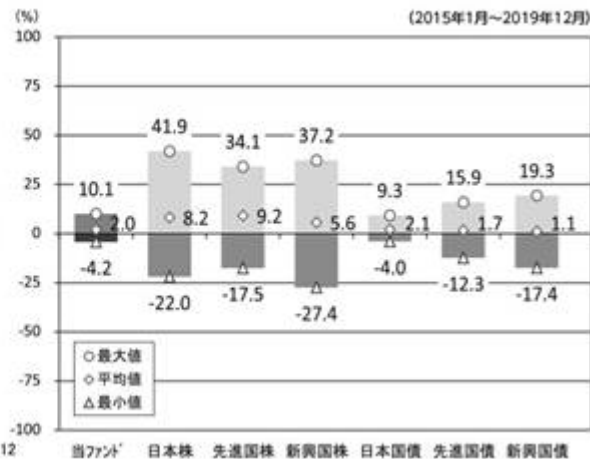
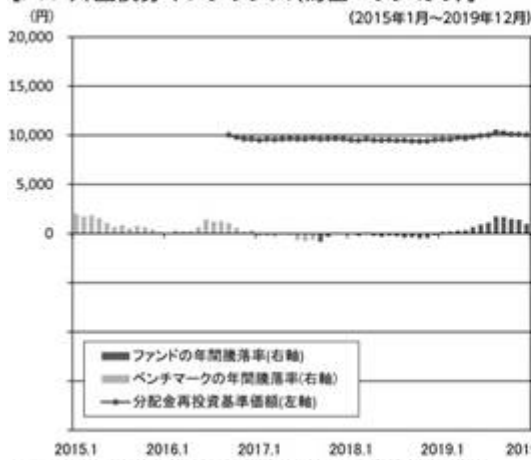
[FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



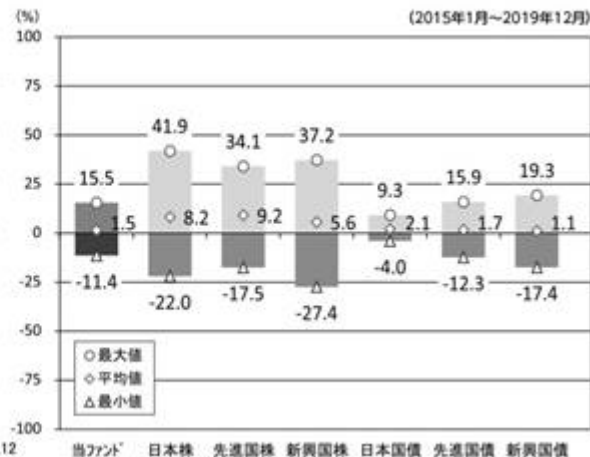
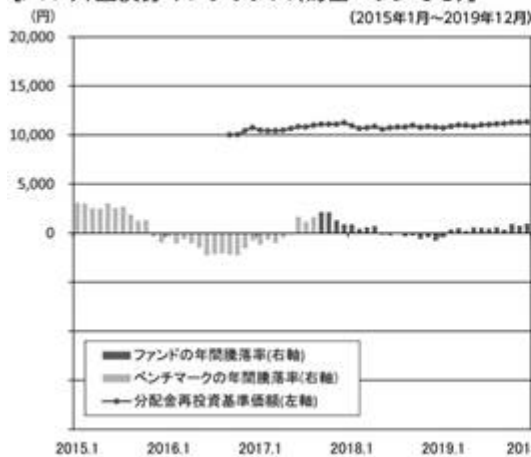
[FW 日本債券インデックス]



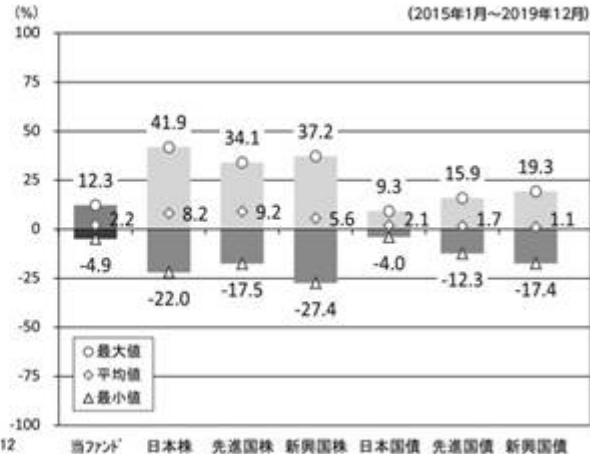
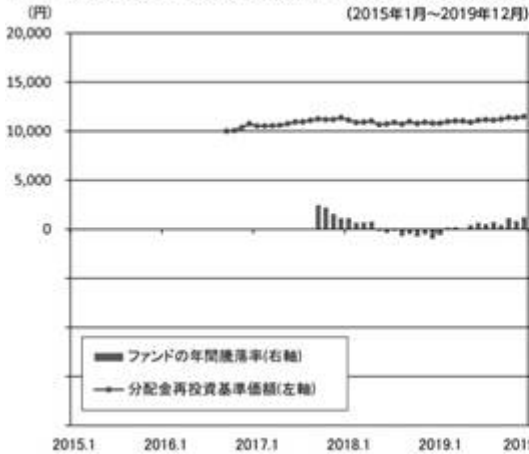
[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



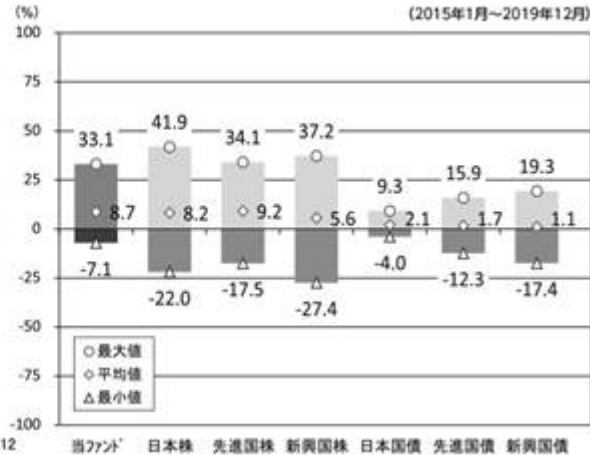
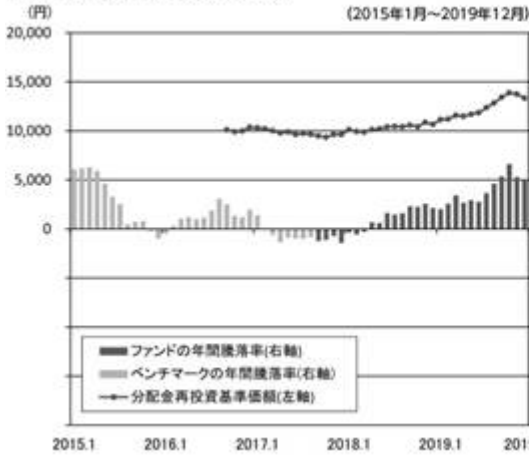
[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]



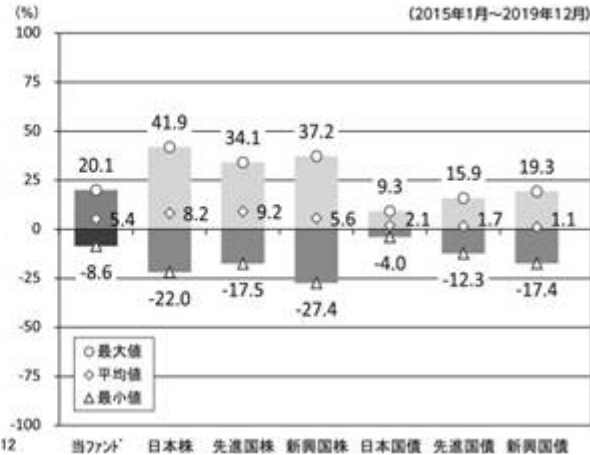
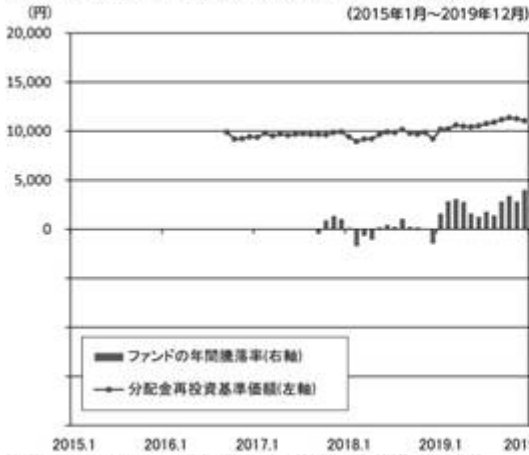
[FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



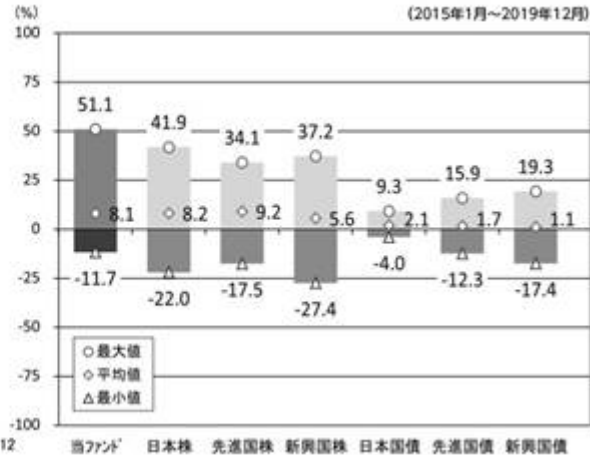
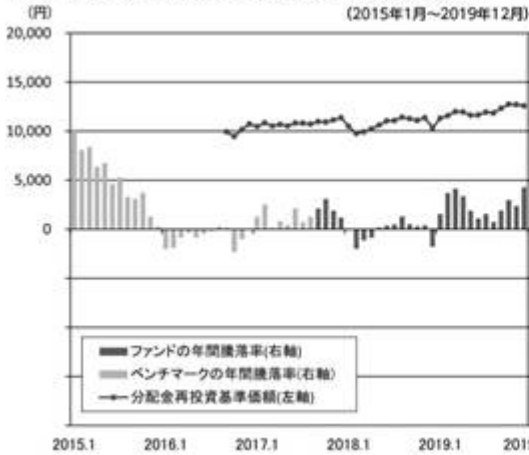
[FW J-REITインデックス]



[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社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。

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

()毎月10日(休業日の場合翌営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 年率0.1485% (税抜0.135%)

ロ. 1%以上の場合 年率0.3355% (税抜0.305%)

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

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

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

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.295% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<FW 日本債券インデックス>

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.27% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

<FW J-REITインデックス>

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

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW TOPIXインデックス」および「FW 日経225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月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

5 【運用状況】

【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

(1) 【投資状況】 (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	11,278,189,256	99.99
内 日本	11,278,189,256	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	800,587	0.01
純資産総額	11,278,989,843	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (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	10,059,931,546	0.9989 10,049,126,763	1.1211 11,278,189,256	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
2018年12月末日	7,817,706,227	-	1.1568	-
2019年1月末日	8,401,472,290	-	1.2135	-
2月末日	8,740,411,060	-	1.2446	-
3月末日	8,717,787,096	-	1.2453	-
4月末日	8,906,202,550	-	1.2657	-
5月末日	8,569,671,002	-	1.1830	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,839,299,537	8,839,299,537	1.2045	1.2045
6月末日	9,029,709,656	-	1.2151	-
7月末日	9,529,420,804	-	1.2258	-
8月末日	9,275,177,665	-	1.1841	-
9月末日	9,937,905,533	-	1.2552	-
10月末日	10,713,008,133	-	1.3176	-
11月末日	11,136,012,115	-	1.3429	-
12月末日	11,278,989,843	-	1.3619	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.6
第2計算期間	14.7
第3計算期間	12.2
2019年6月18日～ 2019年12月17日	14.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	4,454,641,067	310,563,294
第2計算期間	4,087,459,929	1,994,650,943
第3計算期間	2,901,918,904	1,801,264,876
2019年6月18日～ 2019年12月17日	2,081,777,643	1,204,788,059

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (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 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	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

●FW 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	13,619円
純資産総額	112億円



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	17.7%
3年間	20.0%
5年間	-
設定来	36.2%

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	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6月	第2期 18年6月	第3期 19年6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を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

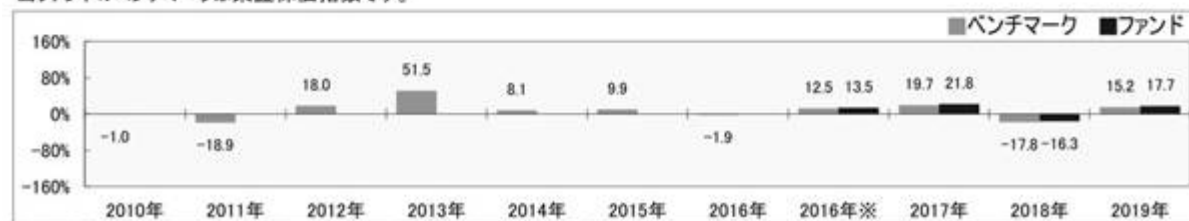
※比率は、純資産総額に対するものです。

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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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 日経225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	10,997,649,915	99.98
内 日本	10,997,649,915	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,835,800	0.02
純資産総額	10,999,485,715	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	ストックインデックス225・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	3,679,743,673	2.6701 9,825,583,626	2.9887 10,997,649,915	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
2018年12月末日	6,228,339,774	-	1.2432	-
2019年1月末日	6,731,341,899	-	1.2900	-
2月末日	7,110,414,755	-	1.3286	-
3月末日	7,257,388,390	-	1.3277	-
4月末日	7,741,586,712	-	1.3939	-
5月末日	7,382,733,632	-	1.2902	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,152,341,843	8,152,341,843	1.3227	1.3227
6月末日	8,246,780,624	-	1.3341	-
7月末日	8,773,536,674	-	1.3491	-
8月末日	8,886,316,508	-	1.2985	-
9月末日	9,666,936,878	-	1.3741	-
10月末日	9,895,982,657	-	1.4480	-
11月末日	10,313,065,741	-	1.4709	-
12月末日	10,999,485,715	-	1.4959	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	20.1
第2計算期間	17.1
第3計算期間	5.9
2019年6月18日～ 2019年12月17日	14.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,867,193,216	117,139,415
第2計算期間	2,980,382,583	1,019,368,476
第3計算期間	2,731,635,338	1,280,509,751
2019年6月18日～ 2019年12月17日	2,000,296,568	930,659,141

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

(1) 投資状況 (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	157,609,884,000	98.47
内 日本	157,609,884,000	98.47
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,454,677,445	1.53
純資産総額	160,064,561,445	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)	2,458,560,000	1.54
内 日本	2,458,560,000	1.54

(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	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	240,000	65,220.00 15,652,800,000	65,000.00 15,600,000,000	9.75

2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1,440,000	4,616.00 6,647,040,000	4,756.00 6,848,640,000	4.28
3	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	240,000	20,780.00 4,987,200,000	23,925.00 5,742,000,000	3.59
4	ファナック	日本	株式	電気機器	240,000	20,445.00 4,906,800,000	20,330.00 4,879,200,000	3.05
5	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,440,000	2,867.00 4,128,480,000	3,253.00 4,684,320,000	2.93
6	テルモ	日本	株式	精密機器	960,000	3,315.00 3,182,400,000	3,885.00 3,729,600,000	2.33
7	ダイキン工業	日本	株式	機械	240,000	14,475.00 3,474,000,000	15,450.00 3,708,000,000	2.32
8	京セラ	日本	株式	電気機器	480,000	6,785.00 3,256,800,000	7,480.00 3,590,400,000	2.24
9	TDK	日本	株式	電気機器	240,000	9,550.00 2,292,000,000	12,390.00 2,973,600,000	1.86
10	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	480,000	4,710.00 2,260,800,000	6,160.00 2,956,800,000	1.85
11	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	720,000	3,422.00 2,463,840,000	4,099.00 2,951,280,000	1.84
12	信越化学	日本	株式	化学	240,000	11,820.00 2,836,800,000	12,060.00 2,894,400,000	1.81
13	ファミリーマート	日本	株式	小売業	960,000	2,701.00 2,592,960,000	2,625.00 2,520,000,000	1.57
14	中外製薬	日本	株式	医薬品	240,000	8,020.00 1,924,800,000	10,080.00 2,419,200,000	1.51
15	セコム	日本	株式	サービス業	240,000	9,761.00 2,342,640,000	9,777.00 2,346,480,000	1.47
16	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,200,000	1,522.00 1,826,400,000	1,870.00 2,244,000,000	1.40
17	花王	日本	株式	化学	240,000	7,937.00 1,904,880,000	9,025.00 2,166,000,000	1.35
18	エーザイ	日本	株式	医薬品	240,000	5,412.00 1,298,880,000	8,204.00 1,968,960,000	1.23
19	エムスリー	日本	株式	サービス業	576,000	2,591.78 1,492,866,370	3,305.00 1,903,680,000	1.19
20	資生堂	日本	株式	化学	240,000	8,722.00 2,093,280,000	7,782.00 1,867,680,000	1.17
21	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	240,000	7,364.00 1,767,360,000	7,714.00 1,851,360,000	1.16

22	ソニー	日本	株式	電気機器	240,000	6,375.00 1,530,000,000	7,401.00 1,776,240,000	1.11
23	NTTデータ	日本	株式	情報・通信業	1,200,000	1,424.00 1,708,800,000	1,467.00 1,760,400,000	1.10
24	第一三共	日本	株式	医薬品	240,000	7,126.00 1,710,240,000	7,228.00 1,734,720,000	1.08
25	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	240,000	5,850.00 1,404,000,000	6,767.00 1,624,080,000	1.01
26	オリンパス	日本	株式	精密機器	960,000	1,405.00 1,348,800,000	1,689.00 1,621,440,000	1.01
27	バンダイナムコ HLDGS	日本	株式	その他製品	240,000	6,380.00 1,531,200,000	6,631.00 1,591,440,000	0.99
28	オムロン	日本	株式	電気機器	240,000	5,830.00 1,399,200,000	6,420.00 1,540,800,000	0.96
29	本田技研	日本	株式	輸送用機器	480,000	2,885.50 1,385,040,000	3,099.00 1,487,520,000	0.93
30	日東電工	日本	株式	化学	240,000	5,364.00 1,287,360,000	6,180.00 1,483,200,000	0.93

(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	98.47%
合計	98.47%

(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	0.14%
鉱業	0.07%
建設業	2.23%
食料品	3.81%
繊維製品	0.20%
パルプ・紙	0.12%
化学	7.97%
医薬品	8.33%
石油・石炭製品	0.26%
ゴム製品	0.77%
ガラス・土石製品	1.16%

鉄鋼	0.09%
非鉄金属	0.90%
金属製品	0.31%
機械	4.60%
電気機器	19.89%
輸送用機器	4.70%
精密機器	3.63%
その他製品	2.30%
電気・ガス業	0.19%
陸運業	1.97%
海運業	0.10%
空運業	0.05%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	10.13%
卸売業	2.06%
小売業	13.01%
銀行業	0.66%
証券、商品先物取引業	0.30%
保険業	0.93%
その他金融業	0.29%
不動産業	1.53%
サービス業	5.55%
合計	98.47%

(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	日経平均先物 2020年3月	買建	104	2,471,727,680	2,458,560,000	1.54%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW 日経225インデックス

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	14,959円
純資産総額	109億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	8.9%
6カ月間	12.1%
1年間	20.3%
3年間	30.1%
5年間	-
設定来	49.6%

※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)

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6月	第2期 18年6月	第3期 19年6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

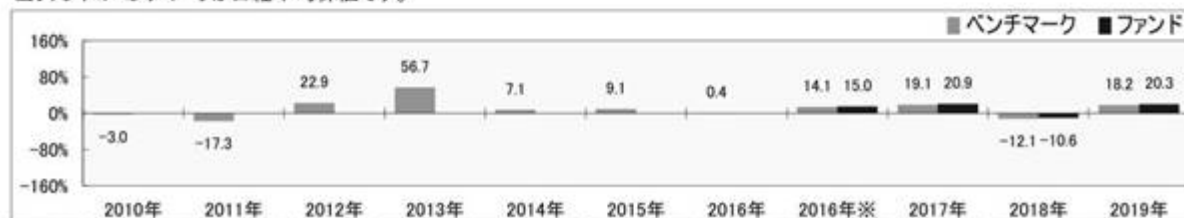
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	225	98.5%	電気機器	19.9%	ファーストリテイリング	小売業	9.7%
国内株式先物	1	1.5%	小売業	13.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.3%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	10.1%	東京エレクトロン	電気機器	3.6%
コール・ローン、その他	-	1.5%	医薬品	8.3%	ファナック	電気機器	3.0%
合計	226	-	化学	8.0%	KDDI	情報・通信業	2.9%
株式 市場・上場別構成			サービス業	5.6%	テルモ	精密機器	2.3%
一部(東証・名証)		98.5%	輸送用機器	4.7%	ダイキン工業	機械	2.3%
二部(東証・名証)		-	機械	4.6%	京セラ	電気機器	2.2%
新興市場他		-	食品	3.8%	TDK	電気機器	1.9%
その他		-	その他	20.5%	アドバンテスト	電気機器	1.8%
合計		98.5%	合計	98.5%	合計		34.2%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均株価です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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 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	42,354,784,444	99.99
内 日本	42,354,784,444	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,395,494	0.01
純資産総額	42,358,179,938	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	19,754,108,691	1.9485 38,491,001,292	2.1441 42,354,784,444	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
2018年12月末日	30,777,331,846	-	1.0906	-
2019年1月末日	33,043,377,946	-	1.1752	-
2月末日	34,653,917,226	-	1.2240	-
3月末日	34,945,844,078	-	1.2335	-
4月末日	35,916,442,023	-	1.2813	-
5月末日	34,867,729,645	-	1.2274	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	36,065,457,483	36,065,457,483	1.2648	1.2648
6月末日	36,877,246,774	-	1.2804	-
7月末日	37,374,205,229	-	1.3100	-
8月末日	37,125,101,516	-	1.2715	-
9月末日	38,061,831,995	-	1.2930	-
10月末日	39,404,451,236	-	1.3217	-
11月末日	41,429,253,681	-	1.3640	-
12月末日	42,358,179,938	-	1.3945	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.9
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
2019年6月18日～ 2019年12月17日	8.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
第3計算期間	9,938,067,643	7,085,414,359
2019年6月18日～ 2019年12月17日	6,306,527,363	4,601,073,810

(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	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	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

●FW 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	13,945円
純資産総額	423億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	7.8%
6カ月間	8.9%
1年間	27.9%
3年間	34.9%
5年間	-
設定来	39.5%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期							
	17年6月	18年6月	19年6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%
合計	1,320	-	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%
国・地域別構成			香港ドル	0.0%	生活必需品	8.0%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
アメリカ		69.4%	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%
イギリス		6.0%	カナダ・ドル	0.0%	素材	4.1%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
その他		25.3%	その他	-0.0%	公益事業、他	4.0%	NESTLE SA-REG	スイス	0.8%
合計		100.7%	合計	100.0%	合計	93.3%	合計		16.6%

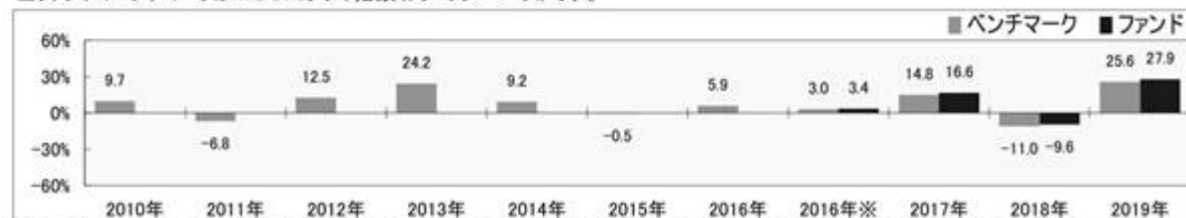
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26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 外国株式インデックス(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	5,452,347,227	99.99
内 日本	5,452,347,227	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	362,381	0.01
純資産総額	5,452,709,608	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	1,925,671,833	2.5257 4,863,741,853	2.8314 5,452,347,227	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
2018年12月末日	3,360,209,707	-	1.2300	-
2019年1月末日	3,778,328,782	-	1.3098	-
2月末日	4,128,423,316	-	1.3878	-
3月末日	4,101,709,642	-	1.3969	-
4月末日	4,287,541,063	-	1.4588	-
5月末日	4,077,208,073	-	1.3660	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	4,523,386,578	4,523,386,578	1.4011	1.4011
6月末日	4,647,181,323	-	1.4147	-
7月末日	4,723,517,050	-	1.4526	-
8月末日	4,632,247,692	-	1.3801	-
9月末日	4,880,923,076	-	1.4238	-
10月末日	4,763,763,662	-	1.4800	-
11月末日	5,120,619,426	-	1.5344	-
12月末日	5,452,709,608	-	1.5802	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.3
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
2019年6月18日～ 2019年12月17日	11.2

(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	1,475,674,063	70,680,538
第2計算期間	1,380,206,909	412,026,062
第3計算期間	1,523,438,524	669,208,679
2019年6月18日～ 2019年12月17日	906,691,959	722,733,752

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (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。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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	15,802円
純資産総額	54億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.0%
3カ月間	11.0%
6カ月間	11.7%
1年間	28.5%
3年間	34.9%
5年間	-
設定来	58.0%



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期							
	17年6月	18年6月	19年6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	1,255	97.4%	米ドル	69.3%	情報技術	16.9%	S&P500 EMINI FUT 202003	アメリカ	3.7%
外国リート	67	2.5%	ユーロ	11.6%	金融	15.3%	APPLE INC	アメリカ	3.0%
外国投資証券	6	0.1%	英ポンド	6.0%	ヘルスケア	12.6%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.6%
			カナダドル	3.7%	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		4.9%	スイス・フラン	3.4%	一般消費財・サービス	9.1%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.1%
合計	1,328	-	豪ドル	2.5%	生活必需品	7.9%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	1.0%
国・地域別構成			香港ドル	1.1%	コミュニケーション・サービス	7.9%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
アメリカ		69.0%	スウェーデン・クローネ	0.9%	エネルギー	5.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	0.9%
イギリス		6.0%	デンマーク・クローネ	0.6%	素材	4.1%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
その他		25.1%	その他	0.8%	公益事業、他	3.8%	NESTLE SA-REG	スイス	0.8%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	92.4%	合計		16.9%

※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(円ベース)です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年*は設定日(9月26日)から年末、2019年は12月30日までの騰落率を表示しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】 (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	1,951,110,346	99.22
内 日本	1,951,110,346	99.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,359,913	0.78
純資産総額	1,966,470,259	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	547,573,104	2.5155 1,377,444,399	2.8314 1,550,398,486	78.84
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	235,380,557	1.5329 360,816,711	1.7024 400,711,860	20.38

(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	99.22%
合計	99.22%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
2018年12月末日	1,539,652,934	-	1.2319	-
2019年1月末日	1,656,317,519	-	1.3136	-
2月末日	1,740,507,182	-	1.3837	-
3月末日	1,769,325,183	-	1.3853	-
4月末日	1,846,757,336	-	1.4427	-
5月末日	1,729,959,565	-	1.3485	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,747,579,023	1,747,579,023	1.3793	1.3793
6月末日	1,770,969,434	-	1.3990	-
7月末日	1,808,665,512	-	1.4270	-
8月末日	1,666,428,319	-	1.3432	-
9月末日	1,713,775,039	-	1.3911	-
10月末日	1,802,723,233	-	1.4500	-
11月末日	1,852,209,191	-	1.4942	-
12月末日	1,966,470,259	-	1.5491	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	21.6
第2計算期間	13.3
第3計算期間	0.1

2019年6月18日～ 2019年12月17日	10.4
----------------------------	------

(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	702,644,049	33,190,572
第2計算期間	695,338,362	142,407,106
第3計算期間	339,152,791	304,533,894
2019年6月18日～ 2019年12月17日	167,674,624	175,878,447

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（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

●FW 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	15,491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	10.7%
1年間	25.7%
3年間	32.6%
5年間	-
設定来	54.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期				
	17年6月	18年6月	19年6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	-	台湾ドル	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			スイス・フラン	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%

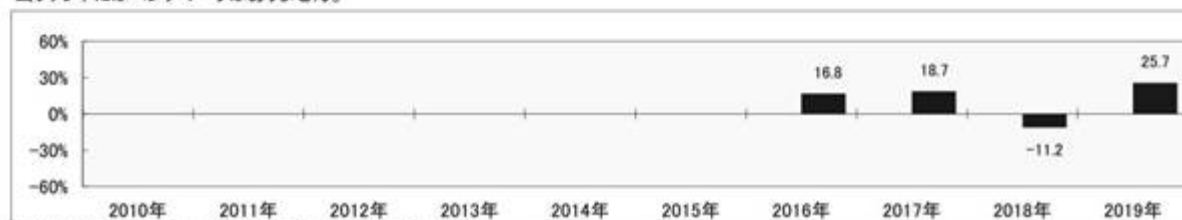
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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。

・2016年は設定日(9月26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 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	30,987,089,014	99.90
内 日本	30,987,089,014	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	30,588,123	0.10
純資産総額	31,017,677,137	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	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	21,675,356,054	1.4377 31,163,217,957	1.4296 30,987,089,014	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
2018年12月末日	25,971,659,068	-	0.9947	-
2019年1月末日	26,145,693,733	-	0.9985	-
2月末日	26,436,411,086	-	1.0005	-
3月末日	26,673,265,777	-	1.0075	-
4月末日	26,365,976,460	-	1.0041	-
5月末日	26,891,339,454	-	1.0105	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	27,372,292,105	27,372,292,105	1.0149	1.0149
6月末日	27,665,414,904	-	1.0166	-
7月末日	28,021,938,198	-	1.0176	-
8月末日	29,132,604,570	-	1.0317	-
9月末日	29,267,044,639	-	1.0202	-
10月末日	29,791,220,135	-	1.0155	-
11月末日	30,514,988,610	-	1.0118	-
12月末日	31,017,677,137	-	1.0086	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.4
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
2019年6月18日～ 2019年12月17日	0.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	15,709,737,796	1,257,184,902
第2計算期間	17,894,969,975	7,012,636,355
第3計算期間	9,926,740,515	8,292,385,149
2019年6月18日～ 2019年12月17日	7,880,423,286	4,419,511,974

(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

●FW 日本債券インデックス

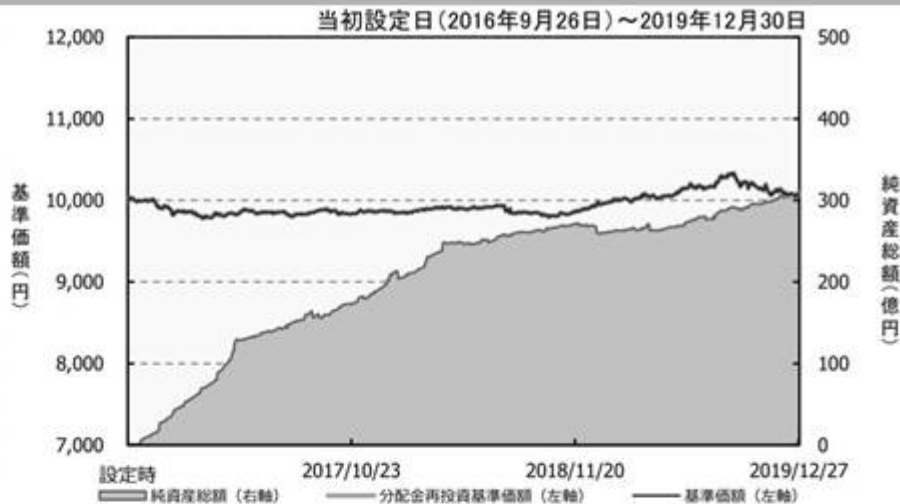
2019年12月30日現在

※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	10,086円
純資産総額	310億円

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	2.2%
5年間	-
設定来	0.9%



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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期							
	17年6月	18年6月	19年6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	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	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。
 ・2016年※は設定日(9月26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 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	83,101,761,993	99.91
内 日本	83,101,761,993	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	76,427,518	0.09
純資産総額	83,178,189,511	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	81,865,591,561	1.0046 82,246,126,993	1.0151 83,101,761,993	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6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
2018年12月末日	68,399,260,855	-	0.9542	-
2019年1月末日	67,378,114,655	-	0.9579	-
2月末日	68,010,186,485	-	0.9566	-
3月末日	69,514,140,663	-	0.9740	-
4月末日	69,498,816,718	-	0.9670	-
5月末日	71,641,290,093	-	0.9805	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	72,847,478,521	72,847,478,521	0.9905	0.9905
6月末日	73,835,227,213	-	0.9958	-
7月末日	75,022,993,085	-	0.9997	-
8月末日	79,220,099,744	-	1.0304	-
9月末日	79,774,093,266	-	1.0223	-
10月末日	80,764,292,460	-	1.0092	-
11月末日	82,562,197,324	-	1.0083	-
12月末日	83,178,189,511	-	1.0016	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.9
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.5
2019年6月18日～ 2019年12月17日	1.2

(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	37,021,440,339	2,368,454,114
第2計算期間	41,568,085,908	11,780,237,725
第3計算期間	27,255,813,662	18,253,054,308
2019年6月18日～ 2019年12月17日	18,680,083,050	9,965,837,859

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

(1) 投資状況(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 力	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 力	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・リングギット 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

●FW 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	10,016円
純資産総額	831億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.7%
3カ月間	-2.0%
6カ月間	0.6%
1年間	5.0%
3年間	4.2%
5年間	-
設定来	0.2%



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期						
	17年6月	18年6月	19年6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%

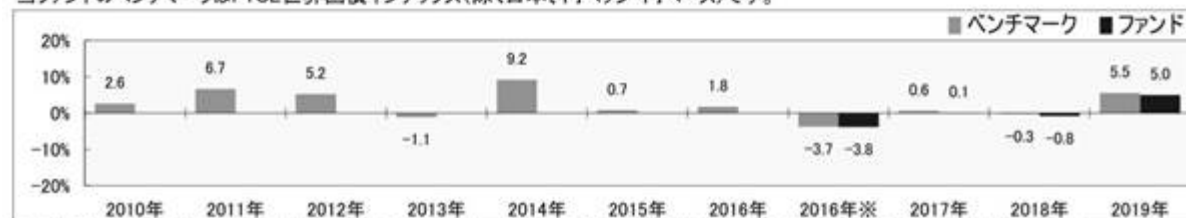
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

・2016年※は設定日(9月26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 外国債券インデックス(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	4,386,473,555	99.91
内 日本	4,386,473,555	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,035,571	0.09
純資産総額	4,390,509,126	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	1,517,810,919	2.8038 4,255,640,239	2.8900 4,386,473,555	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6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
2018年12月末日	3,103,520,500	-	1.0799	-
2019年1月末日	3,147,420,419	-	1.0728	-
2月末日	3,312,224,846	-	1.0875	-
3月末日	3,356,946,940	-	1.1016	-
4月末日	3,388,554,465	-	1.0982	-
5月末日	3,461,591,434	-	1.0890	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,676,403,565	3,676,403,565	1.0978	1.0978
6月末日	3,721,753,676	-	1.1029	-
7月末日	3,796,636,214	-	1.1058	-
8月末日	3,931,392,400	-	1.1127	-
9月末日	4,025,224,729	-	1.1177	-
10月末日	3,931,721,436	-	1.1282	-
11月末日	4,110,309,579	-	1.1284	-
12月末日	4,390,509,126	-	1.1332	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.5
2019年6月18日～ 2019年12月17日	3.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,394,396,399	72,737,713
第2計算期間	1,454,615,593	530,660,407
第3計算期間	1,649,381,625	547,264,585
2019年6月18日～ 2019年12月17日	969,986,907	499,067,399

(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。

(参考情報) 運用実績

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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	11,332円
純資産総額	43億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	1.4%
6カ月間	2.7%
1年間	4.9%
3年間	5.4%
5年間	-
設定来	13.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期						
	17年6月	18年6月	19年6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。

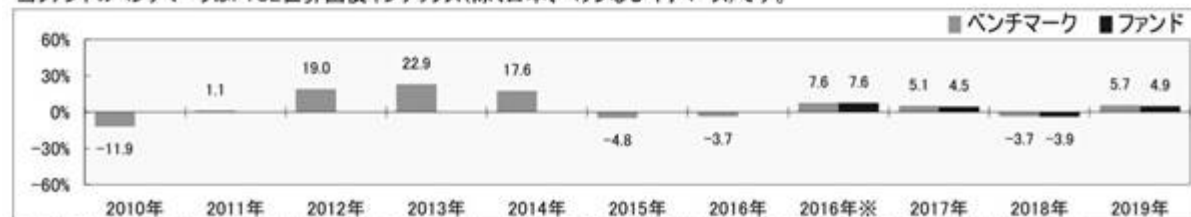
資産別構成		銘柄数		比率		通貨別構成		比率		債券ポートフォリオ特性値		組入上位10銘柄		償還日		比率	
外国債券	765	98.1%	米ドル	47.8%	直接利回り(%)	2.3	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	0.5%								
			ユーロ	37.7%	最終利回り(%)	1.2	United States Treasury Note/Bond	2028/11/15	0.5%								
			英ポンド	6.5%	修正デュレーション	7.6	United States Treasury Note/Bond	2021/04/30	0.5%								
コール・ローン、その他	1.9%	豪ドル	2.0%	残存年数	9.6	United States Treasury Note/Bond	2024/03/31	0.4%									
合計	765	100.0%	カナダ・ドル	1.9%	格付別構成	比率	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.4%								
債券種別構成	98.1%	合計	メキシコ・ペソ	0.9%	AAA	80.8%	United States Treasury Note/Bond	2029/05/15	0.4%								
			南アフリカ・ランド	0.6%	AA	7.7%	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%								
			ポーランド・ズロチ	0.6%	A	10.9%	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.4%								
			デンマーク・クローネ	0.5%	BBB	0.6%	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.4%								
			その他	1.5%	BB	-	United States Treasury Note/Bond	2029/08/15	0.4%								
			合計	98.1%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	4.2%							

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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 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	1,577,059,823	99.91
内 日本	1,577,059,823	99.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,384,404	0.09
純資産総額	1,578,444,227	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	436,217,610	2.8020 1,222,306,650	2.8900 1,260,668,892	79.87
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	216,839,786	1.3584 294,555,852	1.4591 316,390,931	20.04

(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6月15日)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
2018年12月末日	1,228,852,836	-	1.0806	-
2019年1月末日	1,251,267,729	-	1.0806	-
2月末日	1,274,642,928	-	1.0972	-
3月末日	1,319,375,545	-	1.1048	-
4月末日	1,342,639,136	-	1.1029	-
5月末日	1,345,173,004	-	1.0899	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,344,487,088	1,344,487,088	1.1026	1.1026
6月末日	1,350,671,382	-	1.1107	-
7月末日	1,391,845,891	-	1.1168	-
8月末日	1,390,379,481	-	1.1117	-
9月末日	1,387,270,430	-	1.1216	-
10月末日	1,436,702,461	-	1.1386	-
11月末日	1,486,014,034	-	1.1353	-
12月末日	1,578,444,227	-	1.1477	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.5
第2計算期間	0.0
第3計算期間	2.6
2019年6月18日～ 2019年12月17日	3.7

(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	571,935,222	15,390,972
第2計算期間	683,181,594	128,182,978
第3計算期間	364,448,905	257,568,148
2019年6月18日～ 2019年12月17日	261,343,269	127,390,251

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)」の記載と同じ。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (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

●FW 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	11,477円
純資産総額	15億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.1%
3カ月間	2.3%
6カ月間	3.3%
1年間	6.2%
3年間	6.7%
5年間	-
設定来	14.8%



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期							
	17年6月	18年6月	19年6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。

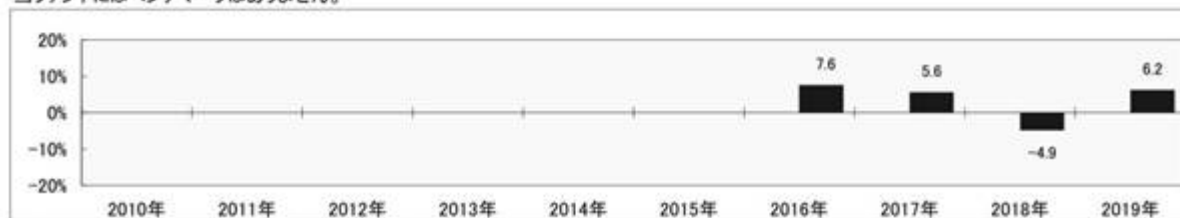
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	920	97.7%	米ドル	38.3%	直接利回り(%)	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.4%
			ユーロ	30.2%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.3%	英ポンド	5.2%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2028/11/15	0.4%
合計	920	100.0%	メキシコ・ペソ	2.7%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2021/04/30	0.4%
			南アフリカ・ランド	2.4%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2024/03/31	0.3%
債券種別構成			ポーランド・ズロチ	2.3%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.3%
国債		97.7%	ブラジル・リアル	2.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2029/05/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	2.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.3%
			タイ・バーツ	1.9%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.3%
			その他	13.2%	BB	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	2023/01/01	0.3%
合計		97.7%	合計	100.0%	合計	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。

・2016年は設定日(9月26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 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	4,249,208,038	99.95
内 日本	4,249,208,038	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,124,321	0.05
純資産総額	4,251,332,359	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	1,287,482,741	2.9832 3,840,846,206	3.3004 4,249,208,038	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
2018年12月末日	2,638,070,089	-	1.0667	-
2019年1月末日	2,755,653,692	-	1.1159	-
2月末日	2,835,425,984	-	1.1213	-
3月末日	2,957,493,841	-	1.1577	-
4月末日	2,958,866,444	-	1.1490	-
5月末日	3,103,337,502	-	1.1685	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,254,479,810	3,254,479,810	1.1818	1.1818
6月末日	3,303,917,351	-	1.1856	-
7月末日	3,590,456,772	-	1.2370	-
8月末日	3,866,163,457	-	1.2831	-
9月末日	4,102,968,034	-	1.3432	-
10月末日	4,021,819,131	-	1.3871	-
11月末日	4,122,069,143	-	1.3743	-
12月末日	4,251,332,359	-	1.3338	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
2019年6月18日～ 2019年12月17日	10.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,295,129,456	60,344,463
第2計算期間	1,366,263,589	304,124,518
第3計算期間	1,052,662,291	596,816,922
2019年6月18日～ 2019年12月17日	896,211,001	509,663,911

(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	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

●FW 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



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月						
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。

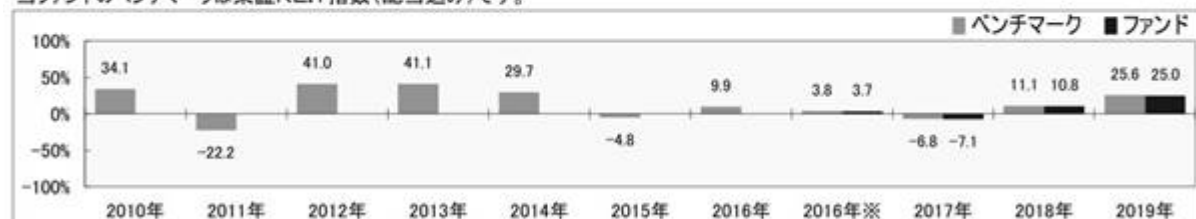
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	63	98.2%	オフィス不動産	32.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.9%
国内リート先物	1	1.7%	各種不動産	28.6%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	6.5%
			工業用不動産	13.5%	野村不動産マスターF	各種不動産	5.4%
			住宅用不動産	8.8%	オリックス不動産投資	オフィス不動産	4.2%
			店舗用不動産	8.7%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	4.1%
			ホテル・リゾート不動産	6.2%	日本リテールファンド	店舗用不動産	4.0%
			ヘルスケア不動産	0.4%	日本プロロジスリート	工業用不動産	3.6%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産	3.4%
					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とMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

※2016年※は設定日(9月26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 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	12,562,572,244	100.56
内 日本	12,562,572,244	100.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	69,884,910	0.56
純資産総額	12,492,687,334	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）	12,742,924,518	102.00
内 日本	12,742,924,518	102.00

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

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

(注3) 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	4,896,925,331	2.4356 11,927,062,860	2.5654 12,562,572,244	100.56

(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	100.56%
合計	100.56%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2020年1月	売建	11,210,500	830,869,995	857,266,935	6.86%
		カナダ・ドル売/円買 2020年1月	売建	2,990,000	246,389,737	250,352,700	2.00%
		ユーロ売/円買 2020年1月	売建	6,166,900	745,277,628	755,630,257	6.05%
		英ポンド売/円買 2020年1月	売建	4,773,900	675,234,561	684,624,999	5.48%
		米ドル売/円買 2020年1月	売建	85,929,300	9,393,653,837	9,406,680,471	75.30%
		イスラエル・シェケル売/円買 2020年1月	売建	337,100	10,628,156	10,669,215	0.09%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2020年1月	売建	750,600	52,876,103	55,139,076	0.44%
		シンガポール・ドル売/円買 2020年1月	売建	5,793,200	463,401,044	469,249,200	3.76%
		香港ドル売/円買 2020年1月	売建	18,029,300	251,718,914	253,311,665	2.03%

(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6月15日)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844

第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
2018年12月末日	9,193,881,672	-	0.9214	-
2019年1月末日	10,276,210,597	-	1.0185	-
2月末日	10,324,177,603	-	1.0235	-
3月末日	10,735,517,303	-	1.0609	-
4月末日	10,353,879,047	-	1.0497	-
5月末日	10,585,355,883	-	1.0435	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	10,895,667,977	10,895,667,977	1.0760	1.0760
6月末日	10,802,818,974	-	1.0548	-
7月末日	11,134,092,036	-	1.0754	-
8月末日	11,535,675,992	-	1.0898	-
9月末日	11,878,974,604	-	1.1173	-
10月末日	12,223,798,926	-	1.1361	-
11月末日	12,447,269,264	-	1.1263	-
12月末日	12,492,687,334	-	1.1064	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.6
第2計算期間	1.2
第3計算期間	10.7
2019年6月18日～ 2019年12月17日	1.3

(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	5,609,575,520	250,487,506
第2計算期間	4,660,565,456	1,092,724,304
第3計算期間	3,628,593,466	2,439,154,634

2019年6月18日～ 2019年12月17日	2,433,905,327	1,392,909,751
----------------------------	---------------	---------------

(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 IDXFRS 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

●FW 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	11,064円
純資産総額	124億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.8%
3カ月間	-1.0%
6カ月間	4.9%
1年間	20.1%
3年間	17.2%
5年間	-
設定来	10.6%



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期							
	17年6月	18年6月	19年6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。

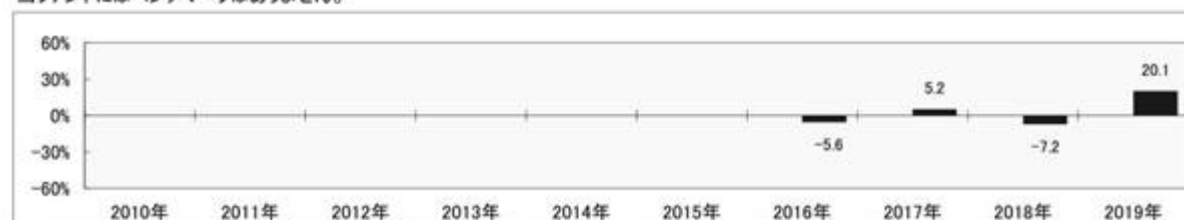
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	306	99.4%	日本円	101.2%	商業施設	20.0%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	4.1%
外国投資信託等	3	1.4%	ユーロ	0.2%	住宅	14.7%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	3.6%
コール・ローン、その他		1.2%	英ポンド	0.1%	オフィス	12.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.3%
合計	309	-	シンガポール・ドル	0.0%	産業施設	11.4%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
国・地域別構成			香港ドル	0.0%	各種不動産	11.2%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.3%
アメリカ		73.8%	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	9.3%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	2.1%
イギリス		5.3%	イスラエル・シェケル	-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	-1.5%			LINK REIT	商業施設	香港	1.6%
合計		100.8%	合計	100.0%	合計	97.5%	合計			25.1%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月26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 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	2,011,560,688	99.99
内 日本	2,011,560,688	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	101,238	0.01
純資産総額	2,011,661,926	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2019年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	784,111,908	2.4407 1,913,799,062	2.5654 2,011,560,688	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
2018年12月末日	1,273,188,435	-	1.0354	-
2019年1月末日	1,425,498,723	-	1.1316	-
2月末日	1,495,289,712	-	1.1581	-
3月末日	1,574,908,460	-	1.2003	-
4月末日	1,572,727,730	-	1.1962	-
5月末日	1,559,214,747	-	1.1623	-
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,667,702,163	1,667,702,163	1.1931	1.1931
6月末日	1,642,195,928	-	1.1652	-
7月末日	1,736,878,425	-	1.1939	-
8月末日	1,770,999,532	-	1.1849	-
9月末日	1,877,407,774	-	1.2340	-
10月末日	1,859,099,526	-	1.2754	-
11月末日	1,906,145,460	-	1.2711	-
12月末日	2,011,661,926	-	1.2578	-

【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
2019年6月18日～ 2019年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.3
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.8
2019年6月18日～ 2019年12月17日	3.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	593,727,416	35,333,000
第2計算期間	637,956,340	111,827,964
第3計算期間	579,621,490	276,337,306
2019年6月18日 ~ 2019年12月17日	410,746,782	226,572,328

(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 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

●FW 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	12,578円
純資産総額	20億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.0%
3カ月間	1.9%
6カ月間	7.9%
1年間	21.5%
3年間	17.3%
5年間	-
設定来	25.8%



※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)

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6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月			
分配金	0円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	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	1.4%	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	ヘルスクエア	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%	ヘルスクエア	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&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、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、翌営業日の扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等^{*}）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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

<一部解約>

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

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

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

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

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

FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW J - R E I Tインデックス FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）	5営業日目
FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）	6営業日目

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

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

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

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

[別表A]

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

[別表B]

ファンド名	価額
-------	----

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

*「FW J-REITインデックス」は除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・外国の金融商品取引所上場の投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 3. 価格情報会社の提供する価額
- ・不動産投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算時に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（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）。

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

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合（「FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）」を除きます。）、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

信託約款の変更等

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

6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、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て)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て)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	175,127	-
コール・ローン	15,945,816	15,008,455
親投資信託受益証券	8,561,785,181	8,838,674,747
未収入金	3,221,000	150,000
流動資産合計	8,581,127,124	8,853,833,202
資産合計	8,581,127,124	8,853,833,202
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,545,147	-
未払受託者報酬	843,000	922,584
未払委託者報酬	12,224,330	13,377,985
その他未払費用	210,914	233,096
流動負債合計	18,823,391	14,533,665
負債合計	18,823,391	14,533,665
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,237,886,759	1 7,338,540,787
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,324,416,974	1,500,758,750
（分配準備積立金）	843,028,662	648,712,408
元本等合計	8,562,303,733	8,839,299,537
純資産合計	8,562,303,733	8,839,299,537
負債純資産合計	8,581,127,124	8,853,833,202

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		-		17
有価証券売買等損益		866,569,234		1,115,734,434
営業収益合計		866,569,234		1,115,734,417
営業費用				
支払利息		8,696		11,028
受託者報酬		1,467,078		1,885,848
委託者報酬		21,274,146		27,346,035
その他費用		367,236		472,687
営業費用合計		23,117,156		29,715,598
営業利益又は営業損失()		843,452,078		1,145,450,015
経常利益又は経常損失()		843,452,078		1,145,450,015
当期純利益又は当期純損失()		843,452,078		1,145,450,015
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()		188,227,033		176,542,336
期首剰余金又は期首欠損金()		814,251,074		2,324,416,974
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,304,476,025		789,673,667
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,304,476,025		789,673,667
剰余金減少額又は欠損金増加額		449,535,170		644,424,212
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		449,535,170		644,424,212
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		2,324,416,974		1,500,758,750

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	4,145,077,773円	6,237,886,759円
期中追加設定元本額	4,087,459,929円	2,901,918,904円
期中一部解約元本額	1,994,650,943円	1,801,264,876円
2. 計算期間末日における受益権の総数	6,237,886,759口	7,338,540,787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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(655,231,694円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,481,395,946円)及び分配準備積立金(187,796,968円)より分配対象額は2,324,424,608円(1万口当たり3,726.30円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(852,061,854円)及び分配準備積立金(648,712,408円)より分配対象額は1,500,774,262円(1万口当たり2,045.06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6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	757,277,221	1,003,791,034
合計	757,277,221	1,003,791,034

(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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3726円 (13,726円)	1.2045円 (12,045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	8,930,660,551	8,838,674,747	
親投資信託受益証券 合計			8,838,674,747	
合計			8,838,674,747	

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6月15日現在	2019年6月17日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		120,882,976	-
コール・ローン		11,006,764,790	21,226,501,523
株式	3 4	144,768,159,960	134,161,291,380
派生商品評価勘定		265,140	3,346,000
未収入金		5,045,609	24,540,100
未収配当金		948,984,720	1,086,024,213
未収利息		368,056	720,429
前払金		7,485,000	-
その他未収収益	5	17,292,950	37,436,485
流動資産合計		156,875,249,201	156,539,860,130
資産合計		156,875,249,201	156,539,860,130
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		49,680	1,281,740
前受金		-	8,460,000
未払金		693,489,959	-
未払解約金		129,332,800	50,779,400
受入担保金		9,421,551,195	20,323,222,856
その他未払費用		145,460	-
流動負債合計		10,244,569,094	20,383,743,996
負債合計		10,244,569,094	20,383,743,996
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,458,954,190	137,575,273,801
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()	2	16,171,725,917	1,419,157,667
元本等合計		146,630,680,107	136,156,116,134
純資産合計		146,630,680,107	136,156,116,134
負債純資産合計		156,875,249,201	156,539,860,130

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6月16日 至 2019年6月17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。 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。 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。 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。 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。 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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	134,029,657,083円	130,458,954,190円
期中追加設定元本額	16,293,172,951円	19,483,159,298円

期中一部解約元本額	19,863,875,844円	12,366,839,687円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックス ファンド	4,153,396,880円	4,064,718,502円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	9,718,686,101円	7,831,019,610円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドVA2	61,521,904円	28,922,843円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	71,040,156円	60,746,661円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,168,663,058円	970,087,745円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,978,575円	49,591,649円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,610,026,616円	1,345,886,376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)	-円	17,407,313円
D-I's TOPIXイン デックス	27,076,578円	40,206,774円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	21,422,329円	19,956,909円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	637,974円	1,811,311円
iFree TOPIXイン デックス	501,844,025円	1,086,769,694円
iFree 8資産バランス	876,329,679円	1,719,726,019円
iFree 年金バランス	-円	45,351,886円
DCダイワ日本株式インデッ クス	62,933,028,590円	65,593,800,212円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,334,930,943円	2,830,723,893円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	2,510,392,046円	3,174,079,892円

ダイワ・ライフ・バランス70	2,438,475,706円	2,924,490,418円
年金ダイワ日本株式インデックス	4,407,980,880円	4,901,290,488円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	14,753,126円	15,661,912円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	48,545,108円	51,776,914円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	14,282,313円	18,724,906円
ダイワつみたてインデックス日本株式	- 円	124,032,077円
ダイワつみたてインデックスバランス30	- 円	198,705円
ダイワつみたてインデックスバランス50	- 円	298,057円
ダイワつみたてインデックスバランス70	- 円	447,086円
ダイワ世界分散バランスファンド15VA	334,996円	370,487円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA	343,410円	380,895円
ダイワ世界分散バランスファンド20VA(国内株式型)	684,622円	748,462円
ダイワ世界分散バランスファンド25VA	2,185,320円	4,378,927円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA	4,842,830円	4,332,378円
ダイワ世界分散バランスファンド30VA(国内株式型)	10,343,078円	8,522,639円
ダイワ世界バランスファンド40VA	234,779,386円	171,234,737円
ダイワ世界バランスファンド60VA	164,962,864円	171,314,178円
ダイワ・バランスファンド35VA	9,950,968,666円	9,583,310,698円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	50,169,076円	- 円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	44,279,094円	2,950,347円

	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	858,675,952円	825,721,462円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	129,181,252円	127,351,633円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	225,110,840円	223,926,223円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	102,672,198円	164,247,771円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	7,617,246,603円	8,930,660,551円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	89,512,504円	1,918,006,449円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	1,719,661,688円	2,518,767,124円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,348,424,482円	1,423,976,054円
	ダイワライフスタイル25	174,040,116円	192,967,338円
	ダイワライフスタイル50	615,588,461円	678,951,850円
	ダイワライフスタイル75	519,964,237円	559,984,571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)	13,621,969,928円	13,145,441,175円
	計	130,458,954,190円	137,575,273,801円
2.	期末日における受益権の総数	130,458,954,190口	137,575,273,801口
3.	2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は1,419,157,667円であり ます。
4.	3 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 8,912,218,000円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 19,310,988,920円

5.	4 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 756,200,000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。 株式 482,520,000円
6.	5 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分16,490,162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35,913,563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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	9,379,912,312	19,957,618,777
合計	9,379,912,312	19,957,618,777

(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9月20日から2018年6月15日まで、及び2018年9月20日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000	2,008,715,000	-	2,010,850,000	2,135,000
合計	1,804,600,000	-	1,804,870,000	270,000	2,008,715,000	-	2,010,850,000	2,135,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	1,1240円	0,9897円
(1万口当たり純資産額)	(11,240円)	(9,897円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	2,700	2,696.00	7,279,200	貸付株式数 200株
日本水産	82,500	667.00	55,027,500	貸付株式数 13,900株
マルハニチロ	11,900	3,165.00	37,663,500	
ハウスイ	500	842.00	421,000	貸付株式数 200株
カネコ種苗	2,400	1,277.00	3,064,800	
サカタのタネ	10,100	3,265.00	32,976,500	貸付株式数 3,900株
ホクト	6,900	1,816.00	12,530,400	貸付株式数 2,500株
ホクリヨウ	1,100	599.00	658,900	貸付株式数 400株
ヒノキヤグループ	2,300	2,196.00	5,050,800	貸付株式数 700株
ショーボンドHD	5,900	7,770.00	45,843,000	貸付株式数 2,300株 (1,600株)
ミライト・ホールディングス	23,200	1,669.00	38,720,800	貸付株式数 9,200株 (5,500株)
タマホーム	4,400	1,084.00	4,769,600	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
サンヨーホームズ	1,400	657.00	919,800	
日本アクア	2,600	500.00	1,300,000	
ファーストコーポレーション	2,400	775.00	1,860,000	貸付株式数 900株
ベステラ	1,600	1,295.00	2,072,000	貸付株式数 600株

スペースバリューHD	10,000	498.00	4,980,000	貸付株式数	400株
住石ホールディングス	18,100	120.00	2,172,000	貸付株式数	6,700株
日鉄鉱業	1,900	4,510.00	8,569,000		
三井松島HLDGS	3,400	1,327.00	4,511,800		
国際石油開発帝石	331,100	923.50	305,770,850	貸付株式数	131,600株
石油資源開発	11,900	2,313.00	27,524,700	貸付株式数	4,300株
K&Oエナジーグループ	4,000	1,614.00	6,456,000		
ダイセキ環境ソリューション	1,500	617.00	925,500	貸付株式数	400株
第一カッター興業	1,000	1,777.00	1,777,000	貸付株式数	400株
安藤・間	52,900	756.00	39,992,400		
東急建設	24,100	741.00	17,858,100		
コムシスホールディングス	29,300	2,710.00	79,403,000	貸付株式数	9,900株
ミサワホーム	6,800	1,021.00	6,942,800		
ピーアールホールディングス	8,800	330.00	2,904,000	貸付株式数	1,600株
高松コンストラクショングP	5,100	2,270.00	11,577,000	貸付株式数	1,100株
東建コーポレーション	2,500	6,640.00	16,600,000	貸付株式数	1,000株
ソネック	800	782.00	625,600		
ヤマウラ	3,000	848.00	2,544,000	貸付株式数	1,200株
大成建設	67,800	4,050.00	274,590,000		
大林組	204,100	1,037.00	211,651,700	貸付株式数	6,100株
清水建設	208,200	915.00	190,503,000	貸付株式数	28,400株
飛鳥建設	5,800	1,324.00	7,679,200		
長谷工コーポレーション	85,100	1,096.00	93,269,600	貸付株式数	500株
松井建設	7,400	632.00	4,676,800	貸付株式数	2,800株
銭高組	800	4,325.00	3,460,000		
鹿島建設	159,600	1,507.00	240,517,200	貸付株式数	19,200株
不動テトラ	5,000	1,344.00	6,720,000		
大末建設	2,400	923.00	2,215,200		
鉄建建設	4,100	3,030.00	12,423,000	貸付株式数	1,600株
西松建設	14,600	2,132.00	31,127,200	貸付株式数	5,800株
三井住友建設	49,200	610.00	30,012,000	貸付株式数	19,500株
大豊建設	4,600	2,727.00	12,544,200		
前田建設	48,500	872.00	42,292,000		
佐田建設	4,600	369.00	1,697,400		
ナカノフード建設	5,000	432.00	2,160,000		
奥村組	11,200	3,345.00	37,464,000		
東鉄工業	8,200	3,020.00	24,764,000	貸付株式数	3,200株
イチケン	1,200	1,636.00	1,963,200		
富士ピー・エス	2,700	454.00	1,225,800	貸付株式数	800株
浅沼組	2,400	3,485.00	8,364,000	貸付株式数	900株

戸田建設	78,800	597.00	47,043,600	貸付株式数	300株
熊谷組	9,700	3,065.00	29,730,500	貸付株式数	3,200株
青木あすなろ建設	3,600	811.00	2,919,600	貸付株式数	1,300株
北野建設	1,400	2,661.00	3,725,400		
植木組	800	2,135.00	1,708,000		
矢作建設	9,100	736.00	6,697,600	貸付株式数	3,400株
ピーエス三菱	7,000	621.00	4,347,000	貸付株式数	2,300株
日本ハウスHLDGS	12,900	409.00	5,276,100	貸付株式数	4,700株
大東建託	24,200	13,910.00	336,622,000	貸付株式数	4,300株
新日本建設	8,200	897.00	7,355,400	貸付株式数	2,200株
NIPPO	18,000	2,139.00	38,502,000	貸付株式数	1,300株
東亜道路	1,200	3,135.00	3,762,000		
前田道路	21,300	2,169.00	46,199,700		
日本道路	1,800	6,310.00	11,358,000		
東亜建設	5,900	1,507.00	8,891,300	貸付株式数	2,300株
日本国土開発	11,100	508.00	5,638,800		
若築建設	3,400	1,334.00	4,535,600		
東洋建設	24,900	421.00	10,482,900	貸付株式数	9,400株
五洋建設	80,900	513.00	41,501,700		
世紀東急	9,900	615.00	6,088,500	貸付株式数	1,200株
福田組	2,200	4,575.00	10,065,000	貸付株式数	200株
日本ドライケミカル	1,500	1,101.00	1,651,500	貸付株式数	400株
住友林業	48,300	1,254.00	60,568,200	貸付株式数	12,800株
日本基礎技術	6,800	355.00	2,414,000	貸付株式数	2,600株
巴コーポレーション	8,300	366.00	3,037,800	貸付株式数	3,300株
大和ハウス	188,500	3,352.00	631,852,000	貸付株式数	25,600株
ライト工業	13,100	1,434.00	18,785,400	貸付株式数	4,600株
積水ハウス	208,300	1,797.00	374,315,100		
日特建設	5,700	596.00	3,397,200		
北陸電気工事	3,300	879.00	2,900,700		
ユアテック	11,000	753.00	8,283,000	貸付株式数	4,300株
四電工	1,000	2,685.00	2,685,000	貸付株式数	200株
中電工	8,800	2,277.00	20,037,600		
関電工	31,000	894.00	27,714,000	貸付株式数	1,600株
きんでん	45,300	1,661.00	75,243,300	貸付株式数	15,000株
東京エネシス	6,900	917.00	6,327,300	貸付株式数	2,400株
トーエネック	1,900	3,020.00	5,738,000	貸付株式数	600株
住友電設	4,700	1,735.00	8,154,500	貸付株式数	1,200株
日本電設工業	11,600	2,216.00	25,705,600	貸付株式数	4,600株
協和エクシオ	26,700	2,675.00	71,422,500		

新日本空調	5,700	1,714.00	9,769,800		
日本工営	3,900	2,375.00	9,262,500		
九電工	13,400	3,195.00	42,813,000	貸付株式数	4,400株
三機工業	15,300	1,248.00	19,094,400	貸付株式数	6,000株
日 揮	58,600	1,423.00	83,387,800	貸付株式数	23,300株
中外炉工業	1,900	1,630.00	3,097,000		
ヤマト	6,100	571.00	3,483,100	貸付株式数	2,100株
太平電業	4,600	2,087.00	9,600,200	貸付株式数	400株
高砂熱学	16,500	1,747.00	28,825,500	貸付株式数	3,700株
三晃金属	800	2,430.00	1,944,000		
N E C ネットズエスアイ	6,600	2,830.00	18,678,000		
朝日工業社	1,400	2,657.00	3,719,800		
明星工業	12,300	663.00	8,154,900	貸付株式数	2,700株
大 氣 社	9,300	3,265.00	30,364,500	貸付株式数	2,100株 (2,100株)
ダイダン	4,500	2,188.00	9,846,000	貸付株式数	900株
日比谷総合設備	6,100	1,864.00	11,370,400	貸付株式数	1,800株
東芝プラントシステム	14,700	2,043.00	30,032,100	貸付株式数	5,000株 (3,700株)
日本製粉	19,300	1,766.00	34,083,800	貸付株式数	7,600株
日清製粉G本社	69,000	2,521.00	173,949,000	貸付株式数	13,800株
日東富士製粉	400	5,610.00	2,244,000		
昭和産業	5,600	3,080.00	17,248,000		
鳥越製粉	5,300	838.00	4,441,400		
中部飼料	7,400	1,195.00	8,843,000	貸付株式数	2,200株
フィード・ワン	40,900	179.00	7,321,100		
東洋精糖	900	985.00	886,500	貸付株式数	300株
日本甜菜糖	3,400	1,916.00	6,514,400	貸付株式数	1,300株
三井製糖	4,800	2,329.00	11,179,200	貸付株式数	200株
塩水港精糖	6,500	207.00	1,345,500		
日新製糖	2,900	1,830.00	5,307,000		
L I F U L L	21,100	514.00	10,845,400	貸付株式数	1,700株
ジェイエシーリクルートメント	4,700	2,503.00	11,764,100	貸付株式数	1,800株
日本M & Aセンター	43,300	2,601.00	112,623,300	貸付株式数	17,200株
メンバーズ	1,900	1,999.00	3,798,100	貸付株式数	500株
中広	500	583.00	291,500		
アイティメディア	1,000	528.00	528,000		
タケエイ	6,000	884.00	5,304,000	貸付株式数	2,300株
E・Jホールディングス	700	1,052.00	736,400		

トラスト・テック	3,200	3,235.00	10,352,000	
コシダカホールディングス	14,200	1,402.00	19,908,400	貸付株式数 6,100株
アルトナー	1,300	722.00	938,600	貸付株式数 500株
パソナグループ	7,100	1,657.00	11,764,700	貸付株式数 2,800株
C D S	1,400	1,302.00	1,822,800	貸付株式数 500株
リンクアンドモチベーション	10,600	593.00	6,285,800	貸付株式数 4,200株
G C A	5,800	722.00	4,187,600	
エス・エム・エス	21,300	2,622.00	55,848,600	
サニーサイドアップ	600	2,258.00	1,354,800	
パーソルホールディングス	58,100	2,463.00	143,100,300	貸付株式数 22,800株
リニカル	3,200	1,045.00	3,344,000	貸付株式数 1,200株 (600株)
クックパッド	18,000	328.00	5,904,000	貸付株式数 7,200株
エスクリ	1,600	780.00	1,248,000	
アイ・ケイ・ケイ	2,800	691.00	1,934,800	貸付株式数 1,100株
森永製菓	15,300	5,230.00	80,019,000	貸付株式数 3,000株
中村屋	1,600	4,200.00	6,720,000	貸付株式数 500株
江崎グリコ	18,300	4,845.00	88,663,500	貸付株式数 7,200株
名糖産業	2,900	1,421.00	4,120,900	貸付株式数 1,100株
井村屋グループ	2,600	2,096.00	5,449,600	
不二家	3,400	1,971.00	6,701,400	貸付株式数 1,300株
山崎製パン	49,900	1,535.00	76,596,500	貸付株式数 19,800株
第一屋製パン	1,100	1,010.00	1,111,000	貸付株式数 400株
モロゾフ	1,000	4,860.00	4,860,000	貸付株式数 400株
亀田製菓	3,800	4,795.00	18,221,000	貸付株式数 1,400株
寿スピリッツ	6,500	5,220.00	33,930,000	
カルビー	27,800	2,971.00	82,593,800	貸付株式数 11,000株
森永乳業	12,200	4,380.00	53,436,000	貸付株式数 1,500株
六甲バター	4,400	1,942.00	8,544,800	
ヤクルト	45,200	6,370.00	287,924,000	貸付株式数 16,500株
明治ホールディングス	43,200	7,680.00	331,776,000	
雪印メグミルク	14,700	2,349.00	34,530,300	
プリマハム	8,600	2,012.00	17,303,200	
日本ハム	25,200	4,700.00	118,440,000	貸付株式数 6,100株
林兼産業	1,800	606.00	1,090,800	
丸大食品	6,500	1,911.00	12,421,500	
S Foods	5,500	3,675.00	20,212,500	貸付株式数 300株
伊藤ハム米久HLDGS	39,300	692.00	27,195,600	貸付株式数 1,100株
学情	2,300	1,193.00	2,743,900	貸付株式数 900株
スタジオアリス	2,900	2,118.00	6,142,200	貸付株式数 1,100株

クロスキャット	1,500	954.00	1,431,000	
シミックホールディングス	3,200	2,024.00	6,476,800	貸付株式数 1,100株
システナ	21,300	1,761.00	37,509,300	貸付株式数 4,700株
N J S	1,200	1,749.00	2,098,800	
デジタルアーツ	3,200	9,180.00	29,376,000	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
日鉄ソリューションズ	8,900	3,415.00	30,393,500	
総合警備保障	23,100	5,200.00	120,120,000	
キューブシステム	3,100	800.00	2,480,000	貸付株式数 100株
いちご	76,200	330.00	25,146,000	
エイジア	1,200	1,198.00	1,437,600	貸付株式数 400株
日本駐車場開発	71,300	172.00	12,263,600	貸付株式数 26,300株
コア	2,500	1,619.00	4,047,500	
カカクコム	43,400	2,040.00	88,536,000	貸付株式数 17,200株
アイロムグループ	2,200	1,543.00	3,394,600	貸付株式数 800株
セントケア・ホールディング	4,200	465.00	1,953,000	貸付株式数 1,600株
サイネックス	900	634.00	570,600	貸付株式数 200株
ルネサンス	3,200	1,828.00	5,849,600	貸付株式数 1,200株
ディップ	9,300	1,795.00	16,693,500	貸付株式数 3,700株
S B Sホールディングス	6,100	1,515.00	9,241,500	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
オプトホールディング	3,500	1,568.00	5,488,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
新日本科学	7,900	697.00	5,506,300	貸付株式数 2,600株
ツクイ	13,600	545.00	7,412,000	貸付株式数 5,300株
キャリアデザインセンター	1,400	1,621.00	2,269,400	貸付株式数 100株
ベネフィット・ワン	16,100	1,905.00	30,670,500	貸付株式数 6,400株
エムスリー	122,200	2,022.00	247,088,400	貸付株式数 14,500株
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	607.00	2,306,600	貸付株式数 1,400株
プラス	500	635.00	317,500	貸付株式数 200株
アウトソーシング	30,600	1,228.00	37,576,800	貸付株式数 12,100株
ウェルネット	5,700	1,002.00	5,711,400	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	1,600	1,698.00	2,716,800	貸付株式数 600株
ディー・エヌ・エー	31,200	2,191.00	68,359,200	
博報堂D Y H L D G S	80,700	1,827.00	147,438,900	
ぐるなび	8,200	623.00	5,108,600	貸付株式数 3,200株
タカミヤ	6,100	777.00	4,739,700	貸付株式数 2,300株
ジャパンベストレスキューS	4,400	1,451.00	6,384,400	貸付株式数 1,500株
ファンコミュニケーションズ	15,900	560.00	8,904,000	貸付株式数 6,300株
ライク	2,300	1,350.00	3,105,000	

ビジネス・ブレイクスルー	2,300	357.00	821,100	貸付株式数	900株
WDBホールディングス	2,600	2,780.00	7,228,000		
ティア	3,300	645.00	2,128,500		
CDG	500	1,341.00	670,500	貸付株式数	100株
バリューコマース	3,900	2,556.00	9,968,400	貸付株式数	1,500株 (1,300株)
インフォマート	31,800	1,863.00	59,243,400	貸付株式数	12,400株
サッポロホールディングス	22,300	2,276.00	50,754,800	貸付株式数	8,800株
アサヒグループホールディング	127,700	4,917.00	627,900,900		
キリンHD	275,900	2,292.50	632,500,750	貸付株式数	35,300株
宝ホールディングス	45,700	1,135.00	51,869,500	貸付株式数	7,600株
オエノンホールディングス	17,100	362.00	6,190,200		
養命酒	1,900	2,017.00	3,832,300		
コカ・コーラボトラーズJHD	46,700	2,711.00	126,603,700	貸付株式数	18,500株
サントリー食品インター	40,800	4,575.00	186,660,000		
ダイドーグループHD	3,400	4,590.00	15,606,000	貸付株式数	400株
伊藤園	18,500	5,230.00	96,755,000	貸付株式数	7,300株
キーコーヒー	6,000	2,102.00	12,612,000	貸付株式数	2,100株
ユニカフェ	1,800	982.00	1,767,600		
ジャパンフーズ	800	1,197.00	957,600		
日清オイリオグループ	7,800	3,130.00	24,414,000	貸付株式数	1,100株
不二製油グループ	14,900	3,115.00	46,413,500		
かどや製油	700	3,905.00	2,733,500		
J-オイルミルズ	3,100	4,075.00	12,632,500	貸付株式数	1,200株
ローソン	15,100	5,130.00	77,463,000	貸付株式数	6,000株
サンエー	4,500	4,335.00	19,507,500	貸付株式数	1,500株
カワチ薬品	4,600	1,900.00	8,740,000	貸付株式数	1,800株
エービーシー・マート	9,300	7,050.00	65,565,000	貸付株式数	3,700株
ハードオフコーポレーション	2,300	699.00	1,607,700	貸付株式数	800株
高千穂交易	2,200	1,030.00	2,266,000	貸付株式数	800株
アスクル	6,300	2,546.00	16,039,800	貸付株式数	1,600株
ゲオホールディングス	9,100	1,405.00	12,785,500	貸付株式数	3,000株
アダストリア	8,300	2,523.00	20,940,900	貸付株式数	3,200株
ジーフット	3,900	664.00	2,589,600	貸付株式数	1,100株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	660.00	528,000	貸付株式数	100株
伊藤忠食品	1,500	4,620.00	6,930,000		
くら寿司	3,500	4,560.00	15,960,000	貸付株式数	1,400株

キャンドウ	2,800	1,650.00	4,620,000	貸付株式数	1,100株 (600株)
エレマテック	5,500	998.00	5,489,000	貸付株式数	1,800株
パルグループHLDGS	3,000	3,315.00	9,945,000	貸付株式数	100株
JALUX	1,700	2,840.00	4,828,000		
エディオン	25,300	1,004.00	25,401,200	貸付株式数	10,000株
あらた	4,400	3,780.00	16,632,000	貸付株式数	500株
サーラコーポレーション	12,100	580.00	7,018,000	貸付株式数	1,900株
ワッツ	2,500	685.00	1,712,500	貸付株式数	1,000株
トーメンデバイス	900	2,260.00	2,034,000	貸付株式数	100株
ハローズ	2,200	2,297.00	5,053,400		
J Pホールディングス	16,400	291.00	4,772,400	貸付株式数	6,400株 (2,000株)
フジオフードシステム	2,500	2,901.00	7,252,500	貸付株式数	900株
あみやき亭	1,300	3,460.00	4,498,000	貸付株式数	300株
東京エレクトロデバイス	2,100	1,889.00	3,966,900	貸付株式数	800株
ひらまつ	11,700	342.00	4,001,400	貸付株式数	2,100株
フィールズ	5,200	511.00	2,657,200	貸付株式数	2,000株
双日	330,300	347.00	114,614,100		
アルフレッサホールディングス	66,500	2,714.00	180,481,000	貸付株式数	26,400株
大黒天物産	1,400	3,470.00	4,858,000		
ハニーズホールディングス	5,600	1,007.00	5,639,200		
ファーマライズHD	1,400	526.00	736,400	貸付株式数	500株 (500株)
キッコーマン	40,300	4,640.00	186,992,000	貸付株式数	10,300株
味の素	134,700	1,892.50	254,919,750	貸付株式数	20,800株
キューピー	34,000	2,396.00	81,464,000	貸付株式数	13,400株
ハウス食品G本社	22,800	4,200.00	95,760,000	貸付株式数	5,000株
カゴメ	24,400	2,463.00	60,097,200	貸付株式数	9,700株
焼津水産化工	2,900	1,096.00	3,178,400		
アリアケジャパン	5,600	6,960.00	38,976,000	貸付株式数	2,200株
ピエトロ	700	1,610.00	1,127,000	貸付株式数	200株
エバラ食品工業	1,400	2,133.00	2,986,200		
ニチレイ	31,700	2,754.00	87,301,800		
横浜冷凍	16,800	961.00	16,144,800	貸付株式数	6,400株
東洋水産	31,400	4,355.00	136,747,000	貸付株式数	12,200株
イトアアンド	2,100	1,652.00	3,469,200	貸付株式数	800株
大冷	700	1,823.00	1,276,100	貸付株式数	100株

ヨシムラ・フード・HLDGS	1,600	940.00	1,504,000	貸付株式数	600株
日清食品HD	25,900	6,750.00	174,825,000	貸付株式数	10,300株
永谷園ホールディングス	3,300	2,134.00	7,042,200	貸付株式数	900株
一正蒲鉾	2,300	1,131.00	2,601,300	貸付株式数	900株 (800株)
フジッコ	6,600	2,054.00	13,556,400	貸付株式数	2,500株
ロックフィールド	6,500	1,442.00	9,373,000	貸付株式数	2,600株 (2,500株)
日本たばこ産業	352,200	2,499.00	880,147,800		
ケンコーマヨネーズ	3,400	2,237.00	7,605,800	貸付株式数	300株
わらべや日洋HD	4,000	1,669.00	6,676,000	貸付株式数	1,500株
なとり	3,300	1,558.00	5,141,400		
イフジ産業	1,000	656.00	656,000	貸付株式数	300株
ピクルスコーポレーション	1,400	1,922.00	2,690,800		
北の達人コーポ	23,900	574.00	13,718,600	貸付株式数	9,500株 (2,200株)
ユーグレナ	26,000	964.00	25,064,000	貸付株式数	9,600株 (5,800株)
片倉工業	7,200	1,290.00	9,288,000		
グンゼ	4,000	4,805.00	19,220,000	貸付株式数	1,500株
ヒューリック	124,600	864.00	107,654,400	貸付株式数	34,200株
神栄	700	765.00	535,500		
ラサ商事	3,200	793.00	2,537,600		
アルペン	4,600	1,593.00	7,327,800	貸付株式数	1,800株
ハブ	1,900	1,194.00	2,268,600		
ラクーンホールディングス	3,400	684.00	2,325,600		
クオールホールディングス	8,800	1,517.00	13,349,600	貸付株式数	3,400株
アルコニックス	6,300	1,331.00	8,385,300	貸付株式数	1,900株 (1,700株)
神戸物産	9,000	5,420.00	48,780,000	貸付株式数	3,500株
ソリトンシステムズ	3,300	1,020.00	3,366,000	貸付株式数	1,300株
ジンス	3,200	6,390.00	20,448,000	貸付株式数	1,200株
ビックカメラ	35,500	1,132.00	40,186,000	貸付株式数	14,100株
DCMホールディングス	32,200	1,077.00	34,679,400	貸付株式数	12,800株 (9,100株)
ペッパーフードサービス	4,700	1,891.00	8,887,700	貸付株式数	1,800株 (300株)
Monotaro	37,800	2,562.00	96,843,600	貸付株式数	15,000株

東京一番フーズ	1,400	603.00	844,200	貸付株式数 500株 (500株)
DDホールディングス	1,300	2,081.00	2,705,300	
あいホールディングス	8,700	1,768.00	15,381,600	貸付株式数 3,300株
ディービーエックス	2,300	806.00	1,853,800	
きちりホールディングス	1,500	726.00	1,089,000	貸付株式数 600株
アークランドサービスHD	4,400	1,880.00	8,272,000	貸付株式数 1,700株
J. フロントリテイリング	76,500	1,143.00	87,439,500	貸付株式数 4,700株
ドトール・日レスHD	10,500	2,085.00	21,892,500	貸付株式数 300株
マツモトキヨシHLDGS	24,700	3,195.00	78,916,500	
ブロンコビリー	3,100	2,227.00	6,903,700	貸付株式数 1,400株 (900株)
ZOZO	64,700	1,909.00	123,512,300	貸付株式数 25,700株
トレジャー・ファクトリー	1,700	901.00	1,531,700	貸付株式数 600株
物語コーポレーション	1,500	8,330.00	12,495,000	貸付株式数 500株
ココカラファイン	6,700	5,750.00	38,525,000	
三越伊勢丹HD	112,000	891.00	99,792,000	貸付株式数 44,500株
東洋紡	25,100	1,221.00	30,647,100	貸付株式数 10,000株
ユニチカ	17,400	364.00	6,333,600	貸付株式数 1,000株
富士紡ホールディングス	3,100	2,292.00	7,105,200	
日清紡ホールディングス	33,700	807.00	27,195,900	貸付株式数 6,900株
倉敷紡績	5,600	1,952.00	10,931,200	貸付株式数 600株
ダイワボウHD	5,400	4,980.00	26,892,000	貸付株式数 2,000株
シキボウ	3,200	958.00	3,065,600	貸付株式数 1,200株
日東紡績	9,100	2,141.00	19,483,100	
トヨタ紡織	21,200	1,389.00	29,446,800	貸付株式数 7,700株
マクニカ・富士エレHLDGS	16,600	1,326.00	22,011,600	貸付株式数 6,600株
Hamee	1,800	689.00	1,240,200	貸付株式数 700株
ラクト・ジャパン	2,600	3,865.00	10,049,000	貸付株式数 1,000株 (500株)
ウエルシアHD	15,800	4,310.00	68,098,000	貸付株式数 6,200株
クリエイイトSDH	8,800	2,478.00	21,806,400	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
バイタルKSKHD	11,100	1,044.00	11,588,400	貸付株式数 800株
八洲電機	5,400	816.00	4,406,400	貸付株式数 1,400株
メディアスホールディングス	3,300	719.00	2,372,700	貸付株式数 1,300株
レスターホールディングス	6,600	1,448.00	9,556,800	貸付株式数 1,000株
ジューテックHD	1,300	919.00	1,194,700	貸付株式数 500株

丸善CHI HD	6,600	377.00	2,488,200	貸付株式数	2,600株
大光	2,500	638.00	1,595,000	貸付株式数	500株
OCHIホールディングス	1,800	1,193.00	2,147,400		
TOKAIホールディングス	31,600	902.00	28,503,200	貸付株式数	12,500株
黒谷	1,300	448.00	582,400	貸付株式数	400株
ミサワ	1,000	445.00	445,000		
ティーライフ	800	865.00	692,000	貸付株式数	300株
Cominix	1,000	836.00	836,000		
エー・ピーカンパニー	1,000	460.00	460,000	貸付株式数	300株
三洋貿易	3,000	2,385.00	7,155,000	貸付株式数	1,000株
チムニー	1,800	2,450.00	4,410,000	貸付株式数	700株
シュッピン	4,000	766.00	3,064,000	貸付株式数	1,600株 (1,400株)
ビューティガレージ	900	1,586.00	1,427,400	貸付株式数	300株
ウイン・パートナーズ	3,800	1,108.00	4,210,400	貸付株式数	1,300株
ネクステージ	9,600	1,238.00	11,884,800		
ジョイフル本田	17,500	1,202.00	21,035,000	貸付株式数	6,900株
鳥貴族	2,000	2,176.00	4,352,000	貸付株式数	900株
キリン堂ホールディングス	2,300	1,742.00	4,006,600	貸付株式数	900株
ホットランド	3,100	1,583.00	4,907,300	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
すかいらくHD	55,800	1,959.00	109,312,200	貸付株式数	22,200株 (2,800株)
SFPホールディングス	2,500	1,796.00	4,490,000		
綿半ホールディングス	2,200	2,483.00	5,462,600	貸付株式数	800株
日本毛織	19,700	864.00	17,020,800	貸付株式数	2,200株
ダイトウボウ	12,700	82.00	1,041,400	貸付株式数	3,700株
トーア紡コーポレーション	2,600	456.00	1,185,600	貸付株式数	100株
ダイドーリミテッド	6,900	303.00	2,090,700	貸付株式数	1,200株 (200株)
ヨシックス	1,000	2,360.00	2,360,000	貸付株式数	300株 (200株)
ユナイテッド・スーパーマーケ	17,400	926.00	16,112,400	貸付株式数	6,800株
三栄建築設計	2,600	1,489.00	3,871,400	貸付株式数	900株
野村不動産HLDGS	39,700	2,348.00	93,215,600		
三重交通グループHD	12,500	588.00	7,350,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
サムティ	8,300	1,532.00	12,715,600	貸付株式数	1,000株
エー・ディー・ワークス	96,100	39.00	3,747,900		

日本商業開発	4,100	1,476.00	6,051,600	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーション	9,600	1,603.00	15,388,800	貸付株式数	3,700株
ユニゾホールディングス	8,900	1,876.00	16,696,400		
日本管理センター	4,100	1,174.00	4,813,400	貸付株式数	1,500株
サンセイランディック	1,900	740.00	1,406,000	貸付株式数	100株
エストラスト	1,300	712.00	925,600	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,400	615.00	8,241,000		
オープンハウス	8,700	4,730.00	41,151,000	貸付株式数	3,800株
東急不動産HD	160,700	601.00	96,580,700	貸付株式数	63,800株
飯田GHD	49,800	1,755.00	87,399,000	貸付株式数	19,700株
イーグランド	1,100	672.00	739,200		
帝国繊維	6,700	2,267.00	15,188,900		
日本コークス工業	51,200	92.00	4,710,400		
ゴルフダイジェスト・オン	2,400	667.00	1,600,800	貸付株式数	900株
ミタチ産業	1,700	692.00	1,176,400		
B E E N O S	2,100	1,863.00	3,912,300	貸付株式数	800株
あさひ	4,900	1,264.00	6,193,600	貸付株式数	1,900株
日本調剤	2,100	3,640.00	7,644,000	貸付株式数	300株
コスモス薬品	2,600	18,000.00	46,800,000	貸付株式数	1,000株
シップヘルスケアHD	12,500	4,735.00	59,187,500	貸付株式数	4,100株
トーエル	2,800	710.00	1,988,000	貸付株式数	100株
ソフトクリエイイトHD	2,600	1,587.00	4,126,200	貸付株式数	800株
オンリー	1,000	811.00	811,000	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	250,900	3,703.00	929,082,700	貸付株式数	30,800株
薬王堂	2,600	2,317.00	6,024,200	貸付株式数	800株
クリエイイト・レストランツ・ホール	16,100	1,419.00	22,845,900		
明治電機工業	1,800	1,405.00	2,529,000	貸付株式数	300株
ツルハホールディングス	13,000	9,060.00	117,780,000	貸付株式数	5,100株
デリカフーズHLDGS	1,000	1,452.00	1,452,000	貸付株式数	300株
スターティアホールディングス	1,100	537.00	590,700		
サンマルクホールディングス	4,700	2,335.00	10,974,500	貸付株式数	1,400株
フェリシモ	1,300	973.00	1,264,900	貸付株式数	500株
トリドールホールディングス	7,400	1,977.00	14,629,800	貸付株式数	2,900株 (800株)
帝人	48,500	1,795.00	87,057,500	貸付株式数	13,400株
東レ	461,700	808.70	373,376,790	貸付株式数	93,300株
クラレ	100,300	1,273.00	127,681,900	貸付株式数	16,900株
旭化成	423,300	1,126.00	476,635,800	貸付株式数	54,700株

サカイ オーベックス	1,400	1,666.00	2,332,400	
TOKYO BASE	5,300	827.00	4,383,100	
稲葉製作所	3,300	1,458.00	4,811,400	貸付株式数 1,300株
宮地エンジニアリングG	1,800	1,785.00	3,213,000	貸付株式数 700株
トーカロ	15,500	753.00	11,671,500	貸付株式数 1,300株
アルファCO	2,100	1,237.00	2,597,700	
SUMCO	66,400	1,201.00	79,746,400	貸付株式数 8,600株
川田テクノロジーズ	1,300	8,420.00	10,946,000	貸付株式数 500株
RS TECHNOLOGIES	1,200	2,534.00	3,040,800	貸付株式数 400株
信和	3,100	952.00	2,951,200	
ビーロット	1,200	2,208.00	2,649,600	貸付株式数 400株
ファーストブラザーズ	1,600	1,001.00	1,601,600	貸付株式数 500株
ハウスドゥ	3,200	1,579.00	5,052,800	貸付株式数 1,200株
シーアールイー	2,300	1,026.00	2,359,800	
プロパティエージェント	800	959.00	767,200	貸付株式数 100株
ケイアイスター不動産	1,800	1,535.00	2,763,000	貸付株式数 600株
アグレ都市デザイン	1,000	456.00	456,000	
ジェイ・エス・ビー	200	4,055.00	811,000	
テンポイノベーション	700	1,505.00	1,053,500	貸付株式数 100株
グローバルリンクマネジメント	500	596.00	298,000	貸付株式数 200株
住江織物	1,700	2,917.00	4,958,900	貸付株式数 500株
日本フェルト	3,200	470.00	1,504,000	貸付株式数 900株
イチカワ	800	1,572.00	1,257,600	
エコナックホールディングス	10,400	126.00	1,310,400	貸付株式数 4,100株
日東製網	600	1,482.00	889,200	貸付株式数 200株
芦森工業	1,200	1,625.00	1,950,000	
アツギ	4,800	905.00	4,344,000	貸付株式数 1,900株
ウイルプラスHLDGS	900	847.00	762,300	貸付株式数 300株
ジャパンミート	3,000	1,690.00	5,070,000	
コメダホールディングス	13,800	2,134.00	29,449,200	貸付株式数 5,400株
サッドラホールディングス	1,000	1,908.00	1,908,000	貸付株式数 300株
デファクトスタンダード	400	342.00	136,800	貸付株式数 100株
アレンザホールディングス	3,200	840.00	2,688,000	貸付株式数 200株
バロックジャパン	4,800	882.00	4,233,600	貸付株式数 1,500株
クスリのアオキHLDGS	5,900	7,440.00	43,896,000	貸付株式数 2,300株
ダイニック	2,400	725.00	1,740,000	貸付株式数 400株
共和レザー	3,600	778.00	2,800,800	
力の源HD	2,200	733.00	1,612,600	貸付株式数 800株

スシローグローバルHLDGS	6,600	7,770.00	51,282,000	
LIXILピバ	5,000	1,193.00	5,965,000	貸付株式数 1,100株
セーレン	14,600	1,470.00	21,462,000	
ソトー	2,200	976.00	2,147,200	
東海染工	800	1,141.00	912,800	
小松マテーレ	9,700	788.00	7,643,600	貸付株式数 3,700株
ワコールホールディングス	17,300	2,776.00	48,024,800	貸付株式数 5,000株
ホギメディカル	7,400	3,355.00	24,827,000	貸付株式数 600株
レナウン	16,700	99.00	1,653,300	貸付株式数 6,600株
クラウドディアHLDGS	1,400	501.00	701,400	貸付株式数 500株
TSIホールディングス	21,800	654.00	14,257,200	
マツオカコーポレーション	1,900	2,600.00	4,940,000	貸付株式数 700株
ワールド	7,800	2,112.00	16,473,600	
TIS	19,900	5,390.00	107,261,000	
ネオス	2,400	868.00	2,083,200	貸付株式数 900株
電算システム	2,300	3,600.00	8,280,000	貸付株式数 800株
グリー	40,900	495.00	20,245,500	貸付株式数 12,700株
コーエーテクモHD	12,200	1,993.00	24,314,600	
三菱総合研究所	2,600	3,260.00	8,476,000	貸付株式数 900株
ボルテージ	1,200	503.00	603,600	
電算	700	1,985.00	1,389,500	貸付株式数 100株 (100株)
AGS	3,300	675.00	2,227,500	貸付株式数 400株
ファインデックス	5,000	851.00	4,255,000	
ブレインパッド	1,200	6,950.00	8,340,000	貸付株式数 500株
KLab	10,600	827.00	8,766,200	貸付株式数 4,200株
ポルトゥウィン・ピットクル	7,900	1,275.00	10,072,500	貸付株式数 600株 (600株)
イーブクイニシアティブ	900	2,348.00	2,113,200	
ネクソン	152,100	1,580.00	240,318,000	貸付株式数 19,300株
アイスタイル	15,200	720.00	10,944,000	貸付株式数 6,000株
エムアップ	2,000	2,224.00	4,448,000	貸付株式数 800株 (800株)
エイチーム	4,000	1,246.00	4,984,000	貸付株式数 1,700株
エニグモ	2,100	3,085.00	6,478,500	
テクノスジャパン	4,900	574.00	2,812,600	
enish	2,300	546.00	1,255,800	貸付株式数 900株
コロプラ	19,500	715.00	13,942,500	貸付株式数 7,700株 (4,500株)

オルトプラス	3,900	231.00	900,900	貸付株式数	1,500株
ブロードリーフ	29,500	542.00	15,989,000	貸付株式数	11,600株
クロス・マーケティングG	2,100	355.00	745,500	貸付株式数	300株
デジタルハーツHLDGS	2,700	1,084.00	2,926,800	貸付株式数	1,100株
システム情報	3,000	825.00	2,475,000	貸付株式数	1,000株
メディアドゥHLDGS	1,800	3,420.00	6,156,000		
じげん	8,400	802.00	6,736,800	貸付株式数	3,300株
ブイキューブ	3,100	569.00	1,763,900	貸付株式数	1,200株
エンカレッジ・テクノロジー	800	865.00	692,000		
サイバーリンクス	900	1,148.00	1,033,200	貸付株式数	100株
ディー・エル・イー	3,900	237.00	924,300		
フィックスターズ	6,300	1,990.00	12,537,000	貸付株式数	1,500株
CARTA HOLDINGS	3,100	1,380.00	4,278,000	貸付株式数	1,200株
オブティム	2,600	3,590.00	9,334,000	貸付株式数	1,000株
セレス	1,900	1,770.00	3,363,000	貸付株式数	700株
特種東海製紙	3,800	3,785.00	14,383,000	貸付株式数	1,000株
ティーガイア	5,900	1,965.00	11,593,500	貸付株式数	1,500株
セック	1,000	3,355.00	3,355,000		
日本アジアグループ	6,400	346.00	2,214,400	貸付株式数	1,200株
豆蔵ホールディングス	4,000	1,311.00	5,244,000		
テクマトリックス	4,200	2,077.00	8,723,400	貸付株式数	1,200株
プロシップ	1,700	1,148.00	1,951,600	貸付株式数	600株
ガンホー・オンライン・エンター	143,600	303.00	43,510,800		
GMOペイメントゲートウェイ	9,800	6,900.00	67,620,000	貸付株式数	3,800株
ザッパラス	3,000	373.00	1,119,000	貸付株式数	800株
システムリサーチ	800	3,075.00	2,460,000	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	9,700	2,021.00	19,603,700		
さくらインターネット	7,000	534.00	3,738,000		
ヴィンクス	2,000	1,199.00	2,398,000	貸付株式数	700株
GMOクラウド	1,300	3,060.00	3,978,000	貸付株式数	500株
SRAホールディングス	3,100	2,400.00	7,440,000		
MINORIソリューションズ	1,100	1,827.00	2,009,700	貸付株式数	400株
システムインテグレータ	1,600	715.00	1,144,000	貸付株式数	600株
朝日ネット	4,900	661.00	3,238,900	貸付株式数	1,500株
eBASE	3,500	1,149.00	4,021,500	貸付株式数	1,400株

アバント	2,100	2,235.00	4,693,500	貸付株式数	800株
アドソル日進	2,100	1,578.00	3,313,800	貸付株式数	800株
フリービット	4,000	1,300.00	5,200,000	貸付株式数	1,300株 (700株)
コムチュア	3,300	4,065.00	13,414,500	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
サイバーコム	1,000	2,005.00	2,005,000	貸付株式数	400株
アステリア	3,900	1,015.00	3,958,500		
王子ホールディングス	267,900	601.00	161,007,900	貸付株式数	38,300株
日本製紙	28,500	1,866.00	53,181,000	貸付株式数	10,300株
三菱製紙	9,800	542.00	5,311,600	貸付株式数	2,400株
北越コーポレーション	39,400	555.00	21,867,000	貸付株式数	13,100株
中越パルプ	2,600	1,460.00	3,796,000	貸付株式数	800株
巴川製紙	1,900	938.00	1,782,200	貸付株式数	200株
大王製紙	29,000	1,229.00	35,641,000	貸付株式数	8,700株
阿波製紙	1,500	433.00	649,500	貸付株式数	100株 (100株)
マークラインズ	2,700	1,966.00	5,308,200	貸付株式数	1,000株
メディカル・データ・ビジ	5,300	1,174.00	6,222,200	貸付株式数	100株 (100株)
g u m i	7,600	531.00	4,035,600	貸付株式数	2,900株
ショーケース	1,200	528.00	633,600	貸付株式数	400株
モバイルファクトリー	1,600	1,414.00	2,262,400	貸付株式数	600株
テラスカイ	1,200	1,575.00	1,890,000	貸付株式数	300株
デジタル・インフォメーション	2,600	1,857.00	4,828,200	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	1,200	2,021.00	2,425,200	貸付株式数	400株
パイプドHD	900	1,229.00	1,106,100	貸付株式数	300株
アイビーシー	1,100	1,259.00	1,384,900	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,100	912.00	1,003,200	貸付株式数	300株
P R T I M E S	500	3,080.00	1,540,000	貸付株式数	200株
ランドコンピュータ	900	1,167.00	1,050,300		
ダブルスタンダード	500	4,695.00	2,347,500	貸付株式数	200株
オープンドア	2,900	2,990.00	8,671,000		
マイネット	1,900	718.00	1,364,200		
アカツキ	2,100	5,510.00	11,571,000	貸付株式数	800株
ベネフィットジャパン	400	848.00	339,200	貸付株式数	100株 (100株)
U B I C O Mホールディングス	1,100	1,740.00	1,914,000	貸付株式数	400株

LINE	18,100	2,940.00	53,214,000	貸付株式数 7,100株 (2,100株)
カナミックネットワーク	1,200	2,314.00	2,776,800	貸付株式数 400株
ノムラシステムコーポレーション	600	744.00	446,400	
レンゴー	61,300	863.00	52,901,900	
トーモク	3,700	1,673.00	6,190,100	貸付株式数 1,400株
ザ・パック	4,500	3,095.00	13,927,500	貸付株式数 1,700株
チェンジ	1,200	2,736.00	3,283,200	貸付株式数 400株
シンクロ・フード	2,500	619.00	1,547,500	貸付株式数 1,000株
オークネット	3,100	1,291.00	4,002,100	貸付株式数 100株
エイトレッド	600	2,063.00	1,237,800	貸付株式数 200株
AOI TYO HOLDINGS	6,400	740.00	4,736,000	貸付株式数 2,500株
マクロミル	10,500	1,154.00	12,117,000	
ビーグリー	1,400	807.00	1,129,800	貸付株式数 500株
オロ	1,600	2,571.00	4,113,600	貸付株式数 600株
テモナ	700	461.00	322,700	
昭和電工	39,500	3,060.00	120,870,000	
住友化学	468,300	480.00	224,784,000	
住友精化	2,900	3,220.00	9,338,000	貸付株式数 1,000株
日産化学	36,300	4,775.00	173,332,500	
ラサ工業	2,100	1,322.00	2,776,200	貸付株式数 1,100株
クレハ	5,500	7,450.00	40,975,000	貸付株式数 2,100株
多木化学	1,800	4,315.00	7,767,000	貸付株式数 600株
テイカ	4,800	2,445.00	11,736,000	
石原産業	11,300	1,252.00	14,147,600	貸付株式数 4,500株
片倉コープアグリ	2,200	1,071.00	2,356,200	
日東エフシー	3,800	1,201.00	4,563,800	
日本曹達	9,300	2,622.00	24,384,600	貸付株式数 3,100株
東ソー	91,900	1,431.00	131,508,900	
トクヤマ	17,100	2,483.00	42,459,300	
セントラル硝子	13,000	2,355.00	30,615,000	
東亜合成	37,200	1,182.00	43,970,400	
大阪ソーダ	6,400	2,694.00	17,241,600	貸付株式数 2,500株
関東電化	14,000	734.00	10,276,000	貸付株式数 5,500株
デンカ	23,400	3,145.00	73,593,000	貸付株式数 3,700株
イビデン	37,200	1,781.00	66,253,200	貸付株式数 14,800株
信越化学	104,900	9,217.00	966,863,300	
日本カ・バイド	2,000	1,312.00	2,624,000	

堺 化 学	3,900	2,467.00	9,621,300		
第一稀元素化学工	6,400	829.00	5,305,600	貸付株式数	2,500株
エア・ウォーター	48,600	1,803.00	87,625,800	貸付株式数	18,700株
大陽日酸	49,000	2,296.00	112,504,000	貸付株式数	19,400株
日本化学工業	2,000	1,833.00	3,666,000	貸付株式数	700株
東邦アセチレン	1,000	1,332.00	1,332,000	貸付株式数	300株
日本パ - カライジング	32,500	1,205.00	39,162,500		
高压ガス	9,500	802.00	7,619,000	貸付株式数	1,100株
チタン工業	800	2,879.00	2,303,200	貸付株式数	200株
四国化成	9,900	1,090.00	10,791,000	貸付株式数	3,600株
戸田工業	1,300	2,118.00	2,753,400		
ステラ ケミファ	3,500	2,998.00	10,493,000	貸付株式数	1,300株 (500株)
保土谷化学	2,000	2,563.00	5,126,000		
日本触媒	10,000	7,030.00	70,300,000		
大日精化	4,900	2,821.00	13,822,900	貸付株式数	300株
カネカ	15,400	3,930.00	60,522,000		
協和発酵キリン	71,300	2,027.00	144,525,100	貸付株式数	28,300株
三菱瓦斯化学	60,800	1,364.00	82,931,200		
三井化学	54,000	2,578.00	139,212,000	貸付株式数	19,000株
J S R	59,700	1,641.00	97,967,700	貸付株式数	23,700株
東京応化工業	10,200	3,325.00	33,915,000	貸付株式数	4,000株
大阪有機化学	5,400	972.00	5,248,800	貸付株式数	700株
三菱ケミカルH L D G S	397,800	731.70	291,070,260	貸付株式数	161,600株
K H ネオケム	9,000	2,689.00	24,201,000	貸付株式数	3,600株
ダイセル	87,600	957.00	83,833,200		
住友ベ - クライト	10,300	3,710.00	38,213,000	貸付株式数	4,000株
積水化学	129,400	1,599.00	206,910,600	貸付株式数	41,800株
日本ゼオン	53,700	1,155.00	62,023,500	貸付株式数	21,300株
アイカ工業	17,800	3,705.00	65,949,000		
宇部興産	30,000	2,103.00	63,090,000		
積水樹脂	9,800	2,092.00	20,501,600	貸付株式数	2,800株
タキロンシーアイ	12,900	664.00	8,565,600	貸付株式数	5,000株
旭有機材	4,100	1,345.00	5,514,500	貸付株式数	700株
日立化成	27,500	2,985.00	82,087,500	貸付株式数	10,800株 (10,800株)
ニチバン	3,100	2,227.00	6,903,700	貸付株式数	1,200株
リケンテクノス	16,300	487.00	7,938,100	貸付株式数	6,100株
大倉工業	3,000	1,702.00	5,106,000	貸付株式数	1,200株
積水化成成品	8,900	718.00	6,390,200		

群栄化学	1,600	2,481.00	3,969,600	
タイガース ポリマー	3,100	573.00	1,776,300	貸付株式数 100株
ミライアル	1,700	1,196.00	2,033,200	貸付株式数 600株
ダイキアクシス	2,100	892.00	1,873,200	
ダイキョーニシカワ	12,500	829.00	10,362,500	貸付株式数 4,900株
竹本容器	2,100	1,203.00	2,526,300	貸付株式数 300株
森六ホールディングス	3,100	2,421.00	7,505,100	
日本化薬	37,600	1,287.00	48,391,200	
カーリットホールディングス	6,300	647.00	4,076,100	貸付株式数 2,500株
E P Sホールディングス	8,700	1,750.00	15,225,000	貸付株式数 1,600株
ソルクシーズ	2,500	869.00	2,172,500	
レグス	1,500	1,620.00	2,430,000	貸付株式数 500株
プレステージ・インター	10,800	1,586.00	17,128,800	貸付株式数 400株
フェイス	2,300	930.00	2,139,000	貸付株式数 400株
プロトコーポレーション	2,600	1,994.00	5,184,400	
ハイマックス	700	1,848.00	1,293,600	
アミューズ	3,500	2,505.00	8,767,500	貸付株式数 1,300株
野村総合研究所	37,900	5,200.00	197,080,000	
ドリームインキュベータ	1,700	1,636.00	2,781,200	
サイバネットシステム	4,800	655.00	3,144,000	貸付株式数 400株
クイック	3,600	1,594.00	5,738,400	貸付株式数 1,400株
T A C	3,100	193.00	598,300	貸付株式数 1,200株
C Eホールディングス	1,700	973.00	1,654,100	貸付株式数 600株
ケネディクス	50,800	531.00	26,974,800	
日本システム技術	900	1,747.00	1,572,300	貸付株式数 300株
電通	70,700	3,775.00	266,892,500	
インテージホールディングス	7,600	1,000.00	7,600,000	貸付株式数 2,900株
テイクアンドギヴニーズ	2,200	1,093.00	2,404,600	
東邦システムサイエンス	1,800	911.00	1,639,800	貸付株式数 500株
ぴあ	1,700	4,925.00	8,372,500	貸付株式数 200株
イオンファンタジー	1,900	2,233.00	4,242,700	貸付株式数 700株
ソースネクスト	23,100	410.00	9,471,000	貸付株式数 9,200株 (9,100株)
シーティーエス	6,500	632.00	4,108,000	貸付株式数 1,700株
ネクシィーズグループ	2,000	2,161.00	4,322,000	貸付株式数 600株
インフォコム	6,500	2,511.00	16,321,500	
メディカルシステムネット ワーク	6,300	496.00	3,124,800	貸付株式数 1,600株
日本精化	4,900	1,225.00	6,002,500	貸付株式数 1,800株
扶桑化学工業	6,000	2,066.00	12,396,000	

トリケミカル	1,300	4,460.00	5,798,000	
F I G	5,200	315.00	1,638,000	
A D E K A	29,200	1,576.00	46,019,200	
日油	22,400	4,075.00	91,280,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,055.00	2,954,000	貸付株式数 1,000株
新日本理化	11,300	212.00	2,395,600	貸付株式数 4,200株
ハリマ化成グループ	5,000	993.00	4,965,000	
アルテリア・ネットワークス	6,600	1,177.00	7,768,200	貸付株式数 2,400株
ヒト・コミュニケーションズ H D	1,300	1,749.00	2,273,700	貸付株式数 500株
花 王	147,500	8,475.00	1,250,062,500	
第一工業製薬	2,200	3,480.00	7,656,000	
石原ケミカル	1,600	1,582.00	2,531,200	
日華化学	2,100	859.00	1,803,900	貸付株式数 200株
ニイタカ	900	1,445.00	1,300,500	貸付株式数 200株
三洋化成	4,000	5,690.00	22,760,000	貸付株式数 1,300株
武田薬品	530,500	3,697.00	1,961,258,500	
アステラス製薬	552,400	1,460.50	806,780,200	
大日本住友製薬	45,000	2,060.00	92,700,000	貸付株式数 11,400株
塩野義製薬	77,700	6,110.00	474,747,000	
田辺三菱製薬	63,500	1,250.00	79,375,000	
わかもと製薬	7,100	262.00	1,860,200	貸付株式数 1,200株
あすか製薬	7,500	1,198.00	8,985,000	貸付株式数 1,000株
日本新薬	15,900	8,260.00	131,334,000	貸付株式数 3,100株
バイオフェルミン製薬	1,000	2,282.00	2,282,000	
中外製薬	63,300	7,010.00	443,733,000	
科研製薬	10,900	5,190.00	56,571,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
エーザイ	72,700	6,263.00	455,320,100	貸付株式数 14,000株
理研ビタミン	2,900	3,450.00	10,005,000	貸付株式数 600株
ロート製薬	31,200	3,005.00	93,756,000	貸付株式数 12,400株
小野薬品	143,500	1,951.00	279,968,500	貸付株式数 4,000株
久光製薬	17,900	4,320.00	77,328,000	貸付株式数 1,000株
有機合成薬品	6,700	219.00	1,467,300	
持田製薬	9,200	4,740.00	43,608,000	貸付株式数 3,600株
参天製薬	113,100	1,676.00	189,555,600	貸付株式数 45,000株
扶桑薬品	2,100	1,968.00	4,132,800	
日本ケミファ	800	2,922.00	2,337,600	
ツムラ	18,800	2,985.00	56,118,000	貸付株式数 7,300株
日医工	15,900	1,193.00	18,968,700	貸付株式数 6,300株

テ ル モ	172,000	3,237.00	556,764,000	貸付株式数	68,400株
みらかホールディングス	16,200	2,640.00	42,768,000	貸付株式数	6,400株
キッセイ薬品工業	10,700	2,616.00	27,991,200		
生化学工業	11,700	1,226.00	14,344,200	貸付株式数	3,800株
栄研化学	10,600	1,782.00	18,889,200	貸付株式数	3,500株
日水製薬	2,500	1,193.00	2,982,500		
鳥居薬品	3,200	2,521.00	8,067,200	貸付株式数	1,200株
J C R ファーマ	4,300	6,340.00	27,262,000		
東和薬品	8,700	2,784.00	24,220,800	貸付株式数	3,400株
富士製薬工業	4,100	1,402.00	5,748,200	貸付株式数	100株
沢井製薬	12,500	5,880.00	73,500,000	貸付株式数	2,300株
ゼリア新薬工業	12,000	2,164.00	25,968,000	貸付株式数	4,000株
第一三共	173,900	6,093.00	1,059,572,700	貸付株式数	69,100株
キョーリン製薬HD	13,400	1,860.00	24,924,000	貸付株式数	2,800株
大幸薬品	2,700	2,146.00	5,794,200		
ダイト	3,500	3,510.00	12,285,000	貸付株式数	100株
大塚ホールディングス	115,800	3,589.00	415,606,200		
大正製薬HD	13,500	8,300.00	112,050,000	貸付株式数	5,100株
ペプチドリーム	30,400	5,570.00	169,328,000	貸付株式数	12,100株
大日本塗料	7,000	1,062.00	7,434,000		
日本ペイントHOLD	49,100	4,255.00	208,920,500	貸付株式数	16,800株
関西ペイント	66,800	2,197.00	146,759,600	貸付株式数	26,600株
神東塗料	7,900	170.00	1,343,000	貸付株式数	1,800株
中国塗料	19,400	917.00	17,789,800	貸付株式数	7,600株
日本特殊塗料	4,400	1,245.00	5,478,000		
藤倉化成	8,200	560.00	4,592,000	貸付株式数	3,100株
太陽ホールディングス	4,900	3,250.00	15,925,000	貸付株式数	1,400株
D I C	26,900	2,783.00	74,862,700		
サカタインクス	12,900	973.00	12,551,700	貸付株式数	5,100株
東洋インキSCホールディング	12,500	2,300.00	28,750,000	貸付株式数	4,900株
T & K T O K A	4,700	961.00	4,516,700		
アルプス技研	5,100	1,826.00	9,312,600		
サニックス	10,000	219.00	2,190,000	貸付株式数	1,700株
ダイオーズ	1,300	1,372.00	1,783,600	貸付株式数	500株
日本空調サービス	6,500	680.00	4,420,000	貸付株式数	2,100株
オリエンタルランド	68,600	13,410.00	919,926,000	貸付株式数	27,200株
フォーカスシステムズ	4,000	881.00	3,524,000		
ダスキン	14,900	2,902.00	43,239,800	貸付株式数	5,700株
パーク24	35,000	2,478.00	86,730,000	貸付株式数	13,900株
明光ネットワークジャパン	7,200	964.00	6,940,800	貸付株式数	2,800株

ファルコホールディングス	3,200	1,780.00	5,696,000	貸付株式数	1,200株
クレスコ	1,800	3,375.00	6,075,000		
フジ・メディア・HD	61,700	1,470.00	90,699,000		
秀英予備校	1,500	432.00	648,000	貸付株式数	600株
田谷	1,400	608.00	851,200	貸付株式数	400株
ラウンドワン	18,000	1,483.00	26,694,000	貸付株式数	7,100株
リゾートトラスト	24,500	1,644.00	40,278,000	貸付株式数	9,600株
オービック	20,700	12,960.00	268,272,000	貸付株式数	1,700株
ジャストシステム	8,500	3,595.00	30,557,500	貸付株式数	3,300株
TDCソフト	5,100	823.00	4,197,300	貸付株式数	800株
ヤフー	388,400	306.00	118,850,400	貸付株式数	76,000株
ビー・エム・エル	7,500	3,230.00	24,225,000	貸付株式数	900株
ワタベウェディング	1,000	651.00	651,000	貸付株式数	300株
トレンドマイクロ	31,800	4,945.00	157,251,000	貸付株式数	12,600株
りらいあコミュニケーション	10,400	1,244.00	12,937,600	貸付株式数	3,800株 (3,800株)
IDホールディングス	2,200	1,087.00	2,391,400		
リソー教育	29,400	454.00	13,347,600		
日本オラクル	12,100	7,660.00	92,686,000	貸付株式数	3,700株
早稲田アカデミー	1,600	766.00	1,225,600	貸付株式数	600株
アルファシステムズ	1,900	2,998.00	5,696,200	貸付株式数	600株
フューチャー	8,100	2,075.00	16,807,500		
CAC HOLDINGS	4,400	1,569.00	6,903,600	貸付株式数	600株
ソフトバンク・テクノ	2,500	2,461.00	6,152,500	貸付株式数	1,000株
トーセ	1,600	831.00	1,329,600	貸付株式数	600株
ユー・エス・エス	70,900	2,180.00	154,562,000	貸付株式数	28,200株
オービックビジネスC	6,100	5,150.00	31,415,000	貸付株式数	2,400株
伊藤忠テクノソリューションズ	27,200	2,712.00	73,766,400	貸付株式数	10,800株
アイティフォー	7,200	821.00	5,911,200		
東京個別指導学院	2,000	886.00	1,772,000	貸付株式数	800株
東計電算	900	3,080.00	2,772,000		
サイバーエージェント	33,400	4,110.00	137,274,000	貸付株式数	14,100株
楽天	270,600	1,276.00	345,285,600	貸付株式数	107,600株
エックスネット	1,100	911.00	1,002,100		
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,268.00	4,311,200	貸付株式数	1,300株
テー・オー・ダブリュー	5,400	813.00	4,390,200	貸付株式数	2,000株
大塚商会	32,300	4,340.00	140,182,000	貸付株式数	2,000株
サイボウズ	6,900	1,294.00	8,928,600	貸付株式数	2,700株
ソフトブレーン	4,600	487.00	2,240,200	貸付株式数	1,400株
山田コンサルティングGP	2,800	2,068.00	5,790,400		

セントラルスポーツ	2,100	3,190.00	6,699,000	貸付株式数	800株
パラカ	1,500	1,986.00	2,979,000	貸付株式数	800株
電通国際情報S	3,700	3,435.00	12,709,500		
デジタルガレージ	11,600	3,440.00	39,904,000	貸付株式数	4,500株
イーエムシステムズ	4,800	1,588.00	7,622,400	貸付株式数	1,900株
ウェザーニューズ	2,000	3,215.00	6,430,000	貸付株式数	700株 (700株)
C I J	4,600	976.00	4,489,600	貸付株式数	1,200株
東洋ビジネスエンジ	600	2,045.00	1,227,000	貸付株式数	100株
日本エンタープライズ	5,800	170.00	986,000	貸付株式数	1,300株
WOWOW	2,800	2,614.00	7,319,200		
スカラ	4,700	998.00	4,690,600	貸付株式数	600株
インテリジェント ウェイブ	2,200	873.00	1,920,600		
フルキャストホールディングス	5,800	2,247.00	13,032,600	貸付株式数	2,200株
エン・ジャパン	8,400	4,005.00	33,642,000	貸付株式数	1,100株
富士フイルムHLDGS	126,200	5,384.00	679,460,800		
コニカミノルタ	132,800	1,014.00	134,659,200	貸付株式数	52,800株
資生堂	120,800	8,553.00	1,033,202,400		
ライオン	84,600	2,036.00	172,245,600	貸付株式数	33,600株
高砂香料	4,100	2,912.00	11,939,200	貸付株式数	1,000株
マンダム	13,700	2,638.00	36,140,600	貸付株式数	5,300株 (2,900株)
ミルボン	7,500	5,270.00	39,525,000		
ファンケル	27,100	2,893.00	78,400,300	貸付株式数	1,400株
コーセー	10,300	17,950.00	184,885,000		
コタ	3,200	1,182.00	3,782,400		
シーボン	700	2,380.00	1,666,000	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスHD	25,900	3,035.00	78,606,500		
ノエビアホールディングス	5,800	5,790.00	33,582,000	貸付株式数	2,300株
アジュバンコスメジャパン	1,300	933.00	1,212,900	貸付株式数	500株
エステー	4,300	1,704.00	7,327,200	貸付株式数	1,500株
アグロカネショウ	2,400	2,059.00	4,941,600	貸付株式数	600株
コニシ	10,700	1,552.00	16,606,400	貸付株式数	1,200株
長谷川香料	8,000	1,820.00	14,560,000	貸付株式数	3,100株
星光PMC	4,300	761.00	3,272,300	貸付株式数	1,000株
小林製薬	17,000	7,830.00	133,110,000	貸付株式数	6,700株 (4,300株)
荒川化学工業	5,400	1,308.00	7,063,200		

メック	4,100	1,038.00	4,255,800	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
日本高純度化学	2,000	2,359.00	4,718,000	貸付株式数 300株
タカラバイオ	15,900	2,022.00	32,149,800	貸付株式数 6,300株
J C U	7,800	1,953.00	15,233,400	貸付株式数 2,000株
新田ゼラチン	3,900	684.00	2,667,600	貸付株式数 1,400株
O A T アグリオ	800	1,342.00	1,073,600	
デクセリアルズ	15,500	696.00	10,788,000	貸付株式数 300株
アース製薬	4,600	4,820.00	22,172,000	貸付株式数 1,800株
北興化学	6,500	474.00	3,081,000	貸付株式数 1,000株
大成ラミック	2,000	2,797.00	5,594,000	
クミアイ化学	25,000	705.00	17,625,000	貸付株式数 9,900株
日本農薬	11,900	408.00	4,855,200	貸付株式数 1,100株
富士興産	2,300	963.00	2,214,900	貸付株式数 800株 (500株)
ニチレキ	7,800	1,013.00	7,901,400	貸付株式数 2,600株
ユシロ化学	3,100	1,336.00	4,141,600	貸付株式数 1,100株
ビーピー・カストロール	2,200	1,462.00	3,216,400	
富士石油	14,400	259.00	3,729,600	貸付株式数 5,700株
M O R E S C O	2,400	1,493.00	3,583,200	貸付株式数 600株
出光興産	70,200	3,020.00	212,004,000	
J X T G ホールディングス	1,022,100	510.90	522,190,890	
コスモエネルギーHLDGS	17,600	2,184.00	38,438,400	貸付株式数 7,000株
横浜ゴム	35,200	1,958.00	68,921,600	
T O Y O T I R E	31,200	1,501.00	46,831,200	貸付株式数 12,400株
ブリヂストン	186,800	4,224.00	789,043,200	
住友ゴム	54,600	1,231.00	67,212,600	貸付株式数 21,100株 (200株)
藤倉コンポジット	5,300	397.00	2,104,100	貸付株式数 1,000株
オカモト	4,200	4,805.00	20,181,000	
アキレス	4,400	1,968.00	8,659,200	
フ コ ク	2,600	735.00	1,911,000	
ニッタ	6,900	2,993.00	20,651,700	
クリエートメディック	1,900	926.00	1,759,400	貸付株式数 100株
住友理工	11,900	800.00	9,520,000	貸付株式数 4,300株
三ツ星ベルト	8,000	1,882.00	15,056,000	貸付株式数 1,600株
バンドー化学	11,600	932.00	10,811,200	
A G C	60,100	3,590.00	215,759,000	
日本板硝子	29,200	711.00	20,761,200	貸付株式数 11,400株
石塚硝子	1,000	2,195.00	2,195,000	

有沢製作所	9,500	818.00	7,771,000	貸付株式数	1,100株
日本山村硝子	2,500	1,409.00	3,522,500		
日本電気硝子	26,300	2,633.00	69,247,900	貸付株式数	4,200株
オハラ	2,400	1,420.00	3,408,000	貸付株式数	900株
住友大阪セメント	12,300	4,380.00	53,874,000	貸付株式数	4,800株
太平洋セメント	38,400	3,245.00	124,608,000		
リソルホールディングス	600	3,815.00	2,289,000		
日本ヒュ-ム	6,100	726.00	4,428,600	貸付株式数	2,300株
日本コンクリ-ト	12,900	289.00	3,728,100	貸付株式数	5,100株
三谷セキサン	2,800	2,891.00	8,094,800		
アジアパイルHD	8,600	593.00	5,099,800	貸付株式数	2,900株
東海カーボン	55,200	1,118.00	61,713,600	貸付株式数	21,900株 (100株)
日本カーボン	2,900	4,200.00	12,180,000	貸付株式数	1,100株
東洋炭素	3,600	2,100.00	7,560,000	貸付株式数	1,400株
ノリタケ	3,600	4,510.00	16,236,000	貸付株式数	1,400株
TOTO	46,800	4,175.00	195,390,000		
日本碍子	74,200	1,492.00	110,706,400		
日本特殊陶業	51,300	1,937.00	99,368,100	貸付株式数	4,500株
ダントーホールディングス	5,600	111.00	621,600	貸付株式数	1,500株
MARUWA	2,100	4,900.00	10,290,000	貸付株式数	800株
品川リフラクトリーズ	1,600	2,961.00	4,737,600	貸付株式数	600株
黒崎播磨	1,200	5,960.00	7,152,000	貸付株式数	400株 (400株)
ヨータイ	5,200	556.00	2,891,200	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,100	449.00	1,391,900		
東京窯業	7,700	294.00	2,263,800	貸付株式数	3,000株
ニッカトー	2,700	655.00	1,768,500		
フジミインコーポレーテッド	5,400	2,142.00	11,566,800		
クニミネ工業	2,600	795.00	2,067,000		
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,010.00	1,111,000	貸付株式数	100株
ニチアス	16,600	1,880.00	31,208,000		
日本製鉄	279,400	1,828.50	510,882,900	貸付株式数	111,100株
神戸製鋼所	110,000	679.00	74,690,000	貸付株式数	43,700株
中山製鋼所	8,300	457.00	3,793,100	貸付株式数	300株
合同製鐵	2,900	1,984.00	5,753,600	貸付株式数	1,100株
JFEホールディングス	162,300	1,510.00	245,073,000		
東京製鐵	32,100	833.00	26,739,300	貸付株式数	2,700株
共英製鋼	6,800	1,796.00	12,212,800	貸付株式数	2,400株
大和工業	12,800	3,050.00	39,040,000	貸付株式数	4,300株

東京鐵鋼	2,500	1,237.00	3,092,500	貸付株式数	900株
大阪製鐵	4,000	1,587.00	6,348,000		
淀川製鋼所	8,100	2,043.00	16,548,300	貸付株式数	3,200株
丸一鋼管	21,300	2,855.00	60,811,500		
モリ工業	1,800	1,897.00	3,414,600		
大同特殊鋼	9,800	3,955.00	38,759,000	貸付株式数	3,900株
日本高周波	2,100	447.00	938,700	貸付株式数	300株
日本冶金工	49,700	211.00	10,486,700	貸付株式数	19,600株
山陽特殊製鋼	7,600	1,453.00	11,042,800		
愛知製鋼	3,400	3,100.00	10,540,000	貸付株式数	1,100株
日立金属	64,800	1,222.00	79,185,600	貸付株式数	25,700株
日本金属	1,400	884.00	1,237,600		
大平洋金属	4,000	2,101.00	8,404,000	貸付株式数	1,600株
新日本電工	35,400	196.00	6,938,400	貸付株式数	8,000株
栗本鉄工所	3,100	1,328.00	4,116,800		
虹 技	800	1,244.00	995,200	貸付株式数	300株
日本鑄鉄管	500	626.00	313,000	貸付株式数	200株
日本製鋼所	18,200	1,801.00	32,778,200		
三菱製鋼	4,500	1,160.00	5,220,000	貸付株式数	1,200株
日亜鋼業	8,500	331.00	2,813,500	貸付株式数	3,300株
日本精線	800	2,588.00	2,070,400		
エンビプロHD	2,200	611.00	1,344,200	貸付株式数	800株
大紀アルミニウム	9,800	738.00	7,232,400	貸付株式数	3,500株
日本軽金属HD	163,800	234.00	38,329,200	貸付株式数	6,300株
三井金属	16,200	2,432.00	39,398,400	貸付株式数	6,400株
東邦亜鉛	3,300	2,378.00	7,847,400		
三菱マテリアル	39,700	2,961.00	117,551,700	貸付株式数	15,800株
住友鉱山	82,300	2,900.00	238,670,000		
DOWAホールディングス	14,000	3,465.00	48,510,000	貸付株式数	5,500株
古河機金	9,900	1,387.00	13,731,300		
エス・サイエンス	26,400	61.00	1,610,400	貸付株式数	4,400株 (100株)
大阪チタニウム	6,900	1,733.00	11,957,700	貸付株式数	2,700株 (2,700株)
東邦チタニウム	10,800	1,126.00	12,160,800	貸付株式数	4,200株
UACJ	9,100	1,686.00	15,342,600	貸付株式数	100株 (100株)
CKサンエツ	1,100	2,766.00	3,042,600		
古河電工	17,300	3,025.00	52,332,500		
住友電工	224,900	1,357.00	305,189,300	貸付株式数	89,400株

フジクラ	72,700	368.00	26,753,600		
昭和電線HLDGS	7,000	782.00	5,474,000	貸付株式数	1,400株
東京特殊電線	800	1,672.00	1,337,600		
タツタ電線	11,900	468.00	5,569,200	貸付株式数	4,700株
カナレ電気	1,000	1,908.00	1,908,000	貸付株式数	300株
平河ヒューテック	2,500	1,147.00	2,867,500	貸付株式数	300株
リョービ	7,400	2,028.00	15,007,200	貸付株式数	1,500株
アーレステイ	7,200	525.00	3,780,000	貸付株式数	1,000株
アサヒHD	11,200	2,204.00	24,684,800	貸付株式数	3,500株
東洋製罐グループHD	38,300	2,237.00	85,677,100	貸付株式数	10,700株
ホッカンホールディングス	3,000	1,721.00	5,163,000		
コロナ	3,300	979.00	3,230,700	貸付株式数	600株
横河ブリッジHLDGS	11,200	1,668.00	18,681,600	貸付株式数	1,200株
OSJBHD	29,900	269.00	8,043,100		
駒井ハルテック	1,100	1,631.00	1,794,100		
高田機工	500	2,493.00	1,246,500		
三和ホールディングス	62,100	1,107.00	68,744,700	貸付株式数	24,600株
文化シャッタ-	17,600	810.00	14,256,000	貸付株式数	7,000株
三協立山	8,300	1,134.00	9,412,200	貸付株式数	700株
アルインコ	4,700	942.00	4,427,400	貸付株式数	600株
東洋シャッタ-	1,400	641.00	897,400		
LIxILグループ	88,700	1,498.00	132,872,600	貸付株式数	27,700株
日本ファイルコン	4,400	504.00	2,217,600	貸付株式数	1,700株
ノーリツ	13,400	1,347.00	18,049,800	貸付株式数	1,100株
長府製作所	6,100	2,167.00	13,218,700	貸付株式数	2,400株
リンナイ	10,700	6,870.00	73,509,000		
ユニプレス	11,800	1,743.00	20,567,400	貸付株式数	4,600株
ダイニチ工業	3,100	594.00	1,841,400	貸付株式数	200株
日東精工	8,300	568.00	4,714,400		
三洋工業	800	1,772.00	1,417,600		
岡部	12,200	963.00	11,748,600	貸付株式数	4,800株
ジーテクト	6,600	1,506.00	9,939,600		
中国工業	900	513.00	461,700		
東プレ	11,200	1,743.00	19,521,600	貸付株式数	4,400株
高周波熱錬	11,600	823.00	9,546,800	貸付株式数	4,500株
東京製綱	3,700	1,012.00	3,744,400	貸付株式数	1,300株
サンコール	3,300	507.00	1,673,100		
モリテックスチル	4,600	393.00	1,807,800		
パイオラックス	9,600	1,854.00	17,798,400	貸付株式数	1,100株
エイチワン	5,800	754.00	4,373,200	貸付株式数	2,300株

日本発条	59,900	818.00	48,998,200	貸付株式数	23,800株
中央発條	700	2,897.00	2,027,900	貸付株式数	200株
アドバネクス	800	1,605.00	1,284,000	貸付株式数	300株 (300株)
三浦工業	26,000	3,285.00	85,410,000	貸付株式数	10,200株
タクマ	21,900	1,372.00	30,046,800		
テクノプロ・ホールディング	11,600	5,840.00	67,744,000	貸付株式数	4,300株
アトラ	1,200	283.00	339,600	貸付株式数	400株
インターワークス	1,100	606.00	666,600		
アイ・アールジャパンHD	2,300	2,906.00	6,683,800	貸付株式数	900株
Keepers 技研	2,100	1,400.00	2,940,000	貸付株式数	800株 (700株)
ファーストロジック	1,200	639.00	766,800	貸付株式数	400株
三機サービス	1,200	1,215.00	1,458,000	貸付株式数	300株
Gunosy	4,000	1,901.00	7,604,000	貸付株式数	1,600株
デザインワン・ジャパン	1,200	298.00	357,600		
イー・ガーディアン	2,900	1,818.00	5,272,200	貸付株式数	1,000株
リブセンス	3,100	255.00	790,500	貸付株式数	1,200株
ジャパンマテリアル	15,900	1,375.00	21,862,500		
ベクトル	7,100	1,055.00	7,490,500	貸付株式数	2,800株
ウチヤマホールディングス	3,000	551.00	1,653,000	貸付株式数	900株
チャームケアコーポレーション	1,800	1,702.00	3,063,600		
ライクキッズネクスト	1,300	940.00	1,222,000	貸付株式数	500株
キャリアリンク	2,100	436.00	915,600	貸付株式数	800株
IBJ	3,900	890.00	3,471,000	貸付株式数	1,500株
アサンテ	2,300	2,224.00	5,115,200		
N・フィールド	3,700	686.00	2,538,200	貸付株式数	1,000株
バリューHR	1,200	3,560.00	4,272,000		
M&Aキャピタルパートナー	2,100	6,570.00	13,797,000	貸付株式数	800株 (600株)
ライドオンエクスプレスHD	2,400	1,207.00	2,896,800		
ERIホールディングス	1,600	943.00	1,508,800	貸付株式数	600株
アビスト	900	2,626.00	2,363,400	貸付株式数	300株 (300株)
シグマクシス	2,800	1,209.00	3,385,200	貸付株式数	800株
ウィルグループ	3,700	889.00	3,289,300		
エスクローAJ	7,900	269.00	2,125,100	貸付株式数	3,200株
日本ビューホテル	1,800	1,323.00	2,381,400		
リクルートホールディングス	416,000	3,486.00	1,450,176,000		

エラン	4,000	1,994.00	7,976,000	貸付株式数	400株
ツガミ	13,500	829.00	11,191,500	貸付株式数	5,300株
オークマ	7,700	5,270.00	40,579,000	貸付株式数	3,000株
東芝機械	6,800	2,413.00	16,408,400	貸付株式数	2,700株
アマダホールディングス	90,300	1,160.00	104,748,000	貸付株式数	35,900株
アイダエンジニア	16,200	761.00	12,328,200		
滝澤鉄工所	1,800	1,395.00	2,511,000	貸付株式数	600株
F U J I	24,000	1,206.00	28,944,000	貸付株式数	9,500株
牧野フライス	7,100	3,980.00	28,258,000	貸付株式数	2,800株
オーエスジー	29,600	2,091.00	61,893,600	貸付株式数	11,700株
ダイジェット	700	1,233.00	863,100	貸付株式数	200株
旭ダイヤモンド	15,700	624.00	9,796,800	貸付株式数	5,900株
D M G 森精機	38,100	1,525.00	58,102,500	貸付株式数	14,800株
ソディック	13,100	902.00	11,816,200	貸付株式数	1,800株
ディスコ	8,100	15,140.00	122,634,000	貸付株式数	3,200株
日東工器	3,300	2,148.00	7,088,400		
日進工具	1,800	2,059.00	3,706,200	貸付株式数	700株
パンチ工業	4,100	472.00	1,935,200	貸付株式数	1,600株
富士ダイス	2,600	564.00	1,466,400	貸付株式数	1,000株
土木管理総合試験	2,500	483.00	1,207,500	貸付株式数	1,000株
ネットマーケティング	1,900	506.00	961,400		
日本郵政	475,700	1,191.00	566,558,700		
ベルシステム24HLDGS	9,700	1,502.00	14,569,400	貸付株式数	3,800株
鎌倉新書	4,200	1,416.00	5,947,200	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ソネット・メディア・ネット ワー	700	802.00	561,400	貸付株式数	200株
一蔵	700	645.00	451,500	貸付株式数	200株
L I T A L I C O	1,300	1,701.00	2,211,300	貸付株式数	500株
グローバルキッズCOMP	900	914.00	822,600	貸付株式数	300株
エボラブルアジア	2,500	2,646.00	6,615,000	貸付株式数	1,000株
アトラエ	1,500	2,824.00	4,236,000	貸付株式数	500株
ストライク	2,200	2,131.00	4,688,200	貸付株式数	600株 (100株)
ソラスト	14,200	984.00	13,972,800		
セラク	1,800	618.00	1,112,400	貸付株式数	600株
インソース	2,200	2,474.00	5,442,800	貸付株式数	800株
豊田自動織機	49,200	5,780.00	284,376,000	貸付株式数	17,100株
豊和工業	3,300	831.00	2,742,300	貸付株式数	300株
O K K	2,500	717.00	1,792,500	貸付株式数	900株

石川製作所	1,400	1,434.00	2,007,600	貸付株式数	100株
東洋機械金属	4,200	576.00	2,419,200	貸付株式数	1,500株
津田駒工業	1,300	1,534.00	1,994,200		
エンシュウ	1,500	1,095.00	1,642,500		
島精機製作所	8,300	3,005.00	24,941,500	貸付株式数	3,200株
オプトラン	5,900	2,130.00	12,567,000	貸付株式数	2,200株
NCホールディングス	1,800	493.00	887,400	貸付株式数	300株
イワキポンプ	2,500	1,054.00	2,635,000		
フリーー	4,700	1,122.00	5,273,400		
ヤマシンフィルタ	10,400	611.00	6,354,400	貸付株式数	4,100株 (1,800株)
日阪製作所	7,400	886.00	6,556,400	貸付株式数	100株
やまびこ	11,600	921.00	10,683,600	貸付株式数	2,700株
平田機工	2,800	5,210.00	14,588,000	貸付株式数	1,100株 (200株)
ペガサスミシン製造	5,600	540.00	3,024,000	貸付株式数	1,500株
マルマエ	2,400	673.00	1,615,200	貸付株式数	900株
タツモ	2,500	749.00	1,872,500		
ナプテスコ	33,100	2,885.00	95,493,500	貸付株式数	13,100株
三井海洋開発	6,400	2,793.00	17,875,200		
レオン自動機	5,900	1,754.00	10,348,600		
S M C	17,800	37,500.00	667,500,000	貸付株式数	7,000株
新川	4,500	355.00	1,597,500	貸付株式数	1,700株
ホソカワミクロン	2,100	4,450.00	9,345,000		
ユニオンツール	2,600	2,722.00	7,077,200	貸付株式数	1,000株
オイレス工業	8,400	1,521.00	12,776,400	貸付株式数	2,300株
日精エーエスビー	2,000	2,454.00	4,908,000	貸付株式数	800株
サト - ホールディングス	7,200	2,652.00	19,094,400		
技研製作所	5,300	3,290.00	17,437,000		
日本エアーテック	1,800	580.00	1,044,000		
カワタ	1,600	1,004.00	1,606,400	貸付株式数	600株
日精樹脂工業	5,000	892.00	4,460,000	貸付株式数	400株
オカダアイヨン	2,000	1,209.00	2,418,000	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,300	821.00	1,888,300	貸付株式数	900株
小松製作所	275,200	2,430.00	668,736,000	貸付株式数	108,800株
住友重機械	34,800	3,515.00	122,322,000	貸付株式数	4,600株
日立建機	24,400	2,818.00	68,759,200	貸付株式数	8,200株
日工	1,600	2,695.00	4,312,000	貸付株式数	500株
巴工業	2,500	2,427.00	6,067,500		

井関農機	6,100	1,435.00	8,753,500	
TOWA	5,100	751.00	3,830,100	貸付株式数 2,000株
丸山製作所	1,300	1,073.00	1,394,900	
北川鉄工所	2,700	2,068.00	5,583,600	
シンニッタン	9,200	321.00	2,953,200	貸付株式数 3,400株
ローツェ	2,700	2,134.00	5,761,800	貸付株式数 1,000株
タカキタ	2,000	553.00	1,106,000	貸付株式数 300株
クボタ	325,600	1,757.50	572,242,000	貸付株式数 13,500株
荏原実業	1,700	1,998.00	3,396,600	貸付株式数 200株
東洋エンジニア	8,000	468.00	3,744,000	貸付株式数 3,100株 (700株)
三菱化工機	2,000	1,684.00	3,368,000	貸付株式数 800株
月島機械	12,000	1,224.00	14,688,000	貸付株式数 4,400株
帝国電機製作所	4,200	1,264.00	5,308,800	
東京機械	2,400	416.00	998,400	貸付株式数 900株
新東工業	14,400	935.00	13,464,000	貸付株式数 2,100株
渋谷工業	5,300	2,811.00	14,898,300	貸付株式数 700株
アイチ コーポレーション	10,400	675.00	7,020,000	貸付株式数 400株
小森コーポレーション	15,300	1,152.00	17,625,600	
鶴見製作所	4,700	1,934.00	9,089,800	
住友精密	1,000	2,763.00	2,763,000	
酒井重工業	1,100	2,500.00	2,750,000	貸付株式数 400株
荏原製作所	26,900	2,869.00	77,176,100	貸付株式数 3,200株
石井鉄工所	1,100	1,985.00	2,183,500	貸付株式数 100株
西島製作所	6,200	1,050.00	6,510,000	
北越工業	6,200	1,214.00	7,526,800	
千代田化工建	49,000	322.00	15,778,000	貸付株式数 16,900株
ダイキン工業	82,900	13,855.00	1,148,579,500	
オルガノ	2,200	3,475.00	7,645,000	貸付株式数 700株
ト - ヨ - カネツ	2,300	2,015.00	4,634,500	貸付株式数 700株
栗田工業	32,900	2,539.00	83,533,100	貸付株式数 1,000株
椿本チエイン	8,000	3,305.00	26,440,000	
大同工業	3,000	827.00	2,481,000	
日 機 装	19,600	1,433.00	28,086,800	貸付株式数 7,700株
木村化工機	4,900	337.00	1,651,300	貸付株式数 800株
新興プランテック	12,200	1,338.00	16,323,600	貸付株式数 4,800株
アネスト岩田	9,500	942.00	8,949,000	貸付株式数 3,700株
ダイフク	33,400	5,760.00	192,384,000	貸付株式数 13,300株
サムコ	1,600	785.00	1,256,000	貸付株式数 200株
加藤製作所	3,100	1,946.00	6,032,600	

油研工業	1,000	1,604.00	1,604,000	貸付株式数	200株
タダノ	29,300	1,056.00	30,940,800	貸付株式数	11,600株
フジテック	22,100	1,415.00	31,271,500	貸付株式数	2,700株
C K D	16,900	997.00	16,849,300	貸付株式数	700株
キトー	4,600	1,680.00	7,728,000	貸付株式数	200株
平和	16,900	2,223.00	37,568,700	貸付株式数	400株
理想科学工業	5,400	1,673.00	9,034,200	貸付株式数	1,900株
S A N K Y O	15,200	4,140.00	62,928,000	貸付株式数	6,000株
日本金銭機械	6,700	1,115.00	7,470,500	貸付株式数	2,600株 (2,100株)
マースグループH L D G S	3,800	2,043.00	7,763,400	貸付株式数	1,000株
福島工業	3,800	3,460.00	13,148,000	貸付株式数	400株
オーイズミ	2,800	383.00	1,072,400	貸付株式数	300株
ダイコク電機	2,800	1,276.00	3,572,800	貸付株式数	1,100株
竹内製作所	10,200	1,842.00	18,788,400	貸付株式数	1,500株
ア マ ノ	17,400	2,937.00	51,103,800	貸付株式数	5,800株
J U K I	8,400	920.00	7,728,000	貸付株式数	600株
サンデンホールディングス	7,300	502.00	3,664,600	貸付株式数	2,900株
蛇の目マシン	5,600	437.00	2,447,200	貸付株式数	1,800株
ブラザー工業	79,200	1,881.00	148,975,200	貸付株式数	3,300株
マックス	9,200	1,529.00	14,066,800	貸付株式数	3,600株
モリタホールディングス	10,600	1,859.00	19,705,400	貸付株式数	3,800株
グローリー	16,800	2,805.00	47,124,000	貸付株式数	2,600株
新晃工業	5,500	1,603.00	8,816,500	貸付株式数	1,500株
大和冷機工業	8,700	1,110.00	9,657,000	貸付株式数	3,400株
セガサミーホールディングス	60,300	1,295.00	78,088,500	貸付株式数	13,500株
日本ピストンリング	2,200	1,375.00	3,025,000		
リ ケ ン	2,800	4,055.00	11,354,000	貸付株式数	400株
T P R	8,100	1,749.00	14,166,900	貸付株式数	2,700株
ツバキ・ナカシマ	9,300	1,687.00	15,689,100	貸付株式数	2,700株 (1,700株)
ホシザキ	17,700	7,780.00	137,706,000	貸付株式数	7,000株
大豊工業	4,900	782.00	3,831,800		
日本精工	124,900	897.00	112,035,300		
N T N	131,100	301.00	39,461,100	貸付株式数	52,000株
ジェイテクト	58,400	1,217.00	71,072,800	貸付株式数	13,800株
不 二 越	5,700	4,185.00	23,854,500	貸付株式数	2,200株
ミネベアミツミ	112,800	1,659.00	187,135,200	貸付株式数	44,800株
日本トムソン	18,000	449.00	8,082,000		
T H K	37,900	2,430.00	92,097,000	貸付株式数	100株

ユーシン精機	4,700	963.00	4,526,100	
前澤給装工業	2,400	1,941.00	4,658,400	貸付株式数 900株
イーグル工業	7,500	995.00	7,462,500	貸付株式数 2,000株
前澤工業	4,300	350.00	1,505,000	
日本ピラ - 工業	6,100	1,050.00	6,405,000	貸付株式数 1,000株
キッツ	24,600	712.00	17,515,200	貸付株式数 9,800株
日立	273,500	3,967.00	1,084,974,500	
三菱電機	607,500	1,363.00	828,022,500	
富士電機	39,400	3,675.00	144,795,000	
東洋電機製造	2,700	1,362.00	3,677,400	貸付株式数 200株
安川電機	70,500	3,275.00	230,887,500	貸付株式数 21,300株
シンフォニア テクノロジー	8,300	1,170.00	9,711,000	
明電舎	11,800	1,571.00	18,537,800	
オリジン	1,600	1,414.00	2,262,400	
山洋電気	2,900	4,125.00	11,962,500	貸付株式数 800株
デンヨー	5,800	1,421.00	8,241,800	
ベイカレントコンサルティング	4,100	4,010.00	16,441,000	
ORCHESTRA HLDGS	1,000	1,418.00	1,418,000	貸付株式数 300株
アイモバイル	1,800	880.00	1,584,000	貸付株式数 600株
キャリアインデックス	2,000	807.00	1,614,000	貸付株式数 700株
MS - Japan	2,300	1,543.00	3,548,900	貸付株式数 900株
船場	900	950.00	855,000	
グレイステクノロジー	2,100	2,930.00	6,153,000	貸付株式数 800株
ジャパンエレベーターSHD	4,600	2,599.00	11,955,400	貸付株式数 1,800株
フルテック	700	1,168.00	817,600	
グリーンズ	2,200	1,486.00	3,269,200	
ツナググループHLDGS	600	584.00	350,400	貸付株式数 200株
ソウルドアウト	600	2,302.00	1,381,200	貸付株式数 200株
MS&CONSULTING	900	1,168.00	1,051,200	貸付株式数 300株
日総工産	4,200	1,460.00	6,132,000	貸付株式数 1,000株
キュービーネットHLDGS	3,500	2,496.00	8,736,000	貸付株式数 1,400株 (1,000株)
RPAホールディングス	1,200	5,230.00	6,276,000	
三桜工業	7,600	405.00	3,078,000	
マキタ	74,000	3,390.00	250,860,000	貸付株式数 29,400株
東芝テック	7,600	2,728.00	20,732,800	貸付株式数 2,500株
芝浦メカトロニクス	1,100	2,576.00	2,833,600	貸付株式数 400株
マブチモーター	16,800	3,645.00	61,236,000	貸付株式数 6,600株

日本電産	73,100	13,915.00	1,017,186,500	貸付株式数	29,000株
ユーエムシーエレクトロニクス	3,300	1,235.00	4,075,500		
トレックス・セミコンダクター	2,700	1,166.00	3,148,200	貸付株式数	400株
東光高岳	3,400	1,177.00	4,001,800	貸付株式数	100株
ダブル・スコープ	8,900	1,605.00	14,284,500	貸付株式数	3,500株 (800株)
宮越ホールディングス	2,400	909.00	2,181,600	貸付株式数	900株
ダイヘン	6,500	3,200.00	20,800,000		
ヤーマン	8,800	877.00	7,717,600	貸付株式数	3,500株
JVCケンウッド	46,400	234.00	10,857,600		
ミマキエンジニアリング	5,400	630.00	3,402,000	貸付株式数	2,100株
第一精工	2,500	1,297.00	3,242,500	貸付株式数	1,000株
日新電機	14,100	1,141.00	16,088,100		
大崎電気	12,400	665.00	8,246,000		
オムロン	64,600	5,310.00	343,026,000	貸付株式数	25,600株
日東工業	9,900	1,972.00	19,522,800	貸付株式数	3,300株
I D E C	8,200	1,949.00	15,981,800	貸付株式数	2,400株
正興電機製作所	900	774.00	696,600		
不二電機工業	600	1,226.00	735,600	貸付株式数	200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	21,900	2,004.00	43,887,600	貸付株式数	3,500株
サクサホールディングス	1,500	1,907.00	2,860,500	貸付株式数	600株
メルコホールディングス	2,500	3,045.00	7,612,500	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,400	2,164.00	3,029,600	貸付株式数	200株
日本電気	78,600	4,040.00	317,544,000	貸付株式数	18,900株 (100株)
富士通	58,600	7,555.00	442,723,000	貸付株式数	10,300株
沖電気	26,300	1,297.00	34,111,100		
岩崎通信機	2,800	785.00	2,198,000		
電気興業	3,200	3,180.00	10,176,000		
サンケン電気	7,100	2,215.00	15,726,500	貸付株式数	2,800株
ナカヨ	1,100	1,557.00	1,712,700		
アイホン	3,400	1,742.00	5,922,800	貸付株式数	800株
ルネサスエレクトロニクス	63,800	501.00	31,963,800	貸付株式数	15,600株
セイコーエプソン	75,400	1,649.00	124,334,600	貸付株式数	30,000株
ワコム	44,000	337.00	14,828,000	貸付株式数	17,200株
アルバック	12,100	3,080.00	37,268,000	貸付株式数	4,700株
アクセル	2,500	542.00	1,355,000	貸付株式数	1,000株

E I Z O	5,600	3,790.00	21,224,000	貸付株式数	600株
ジャパンディスプレイ	141,700	53.00	7,510,100	貸付株式数	55,600株
日本信号	15,100	1,144.00	17,274,400		
京三製作所	12,400	349.00	4,327,600		
能美防災	7,900	2,222.00	17,553,800	貸付株式数	3,100株
ホーチキ	3,900	1,216.00	4,742,400	貸付株式数	1,400株
星和電機	3,000	496.00	1,488,000	貸付株式数	1,000株
エレコム	5,800	3,415.00	19,807,000	貸付株式数	2,200株 (2,200株)
パナソニック	694,000	857.60	595,174,400	貸付株式数	123,500株
シャープ	60,300	1,066.00	64,279,800	貸付株式数	24,000株
アンリツ	39,100	1,843.00	72,061,300	貸付株式数	15,500株
富士通ゼネラル	18,600	1,611.00	29,964,600	貸付株式数	7,300株
ソニー	407,800	5,635.00	2,297,953,000		
T D K	31,800	7,570.00	240,726,000	貸付株式数	12,600株
帝国通信工業	2,600	1,139.00	2,961,400		
タムラ製作所	23,400	549.00	12,846,600	貸付株式数	2,800株
アルプスアルパイン	63,300	1,796.00	113,686,800		
池上通信機	1,900	1,070.00	2,033,000	貸付株式数	900株
日本電波工業	5,500	456.00	2,508,000	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,200	614.00	1,964,800	貸付株式数	1,200株
日本トリム	1,100	5,160.00	5,676,000	貸付株式数	400株 (200株)
ローランド ディー . ジー .	3,100	2,378.00	7,371,800	貸付株式数	200株
フオスタ - 電機	7,000	1,446.00	10,122,000	貸付株式数	2,700株
S M K	1,700	2,640.00	4,488,000	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,300	2,082.00	8,952,600		
ティアック	4,200	186.00	781,200	貸付株式数	1,600株
ホシデン	17,900	1,107.00	19,815,300	貸付株式数	7,000株
ヒロセ電機	8,700	11,570.00	100,659,000	貸付株式数	3,400株
日本航空電子	13,900	1,496.00	20,794,400	貸付株式数	5,500株
T O A	6,500	1,289.00	8,378,500	貸付株式数	2,300株
マクセルホールディングス	13,000	1,768.00	22,984,000	貸付株式数	5,100株
古野電気	7,800	939.00	7,324,200	貸付株式数	3,100株
ユニデンホールディングス	1,800	1,796.00	3,232,800	貸付株式数	600株
スミダコーポレーション	5,200	1,115.00	5,798,000	貸付株式数	2,000株 (1,700株)
アイコム	3,300	2,388.00	7,880,400		
リオン	2,800	2,125.00	5,950,000	貸付株式数	1,100株
本多通信工業	5,100	504.00	2,570,400	貸付株式数	2,000株

船井電機	6,100	786.00	4,794,600	貸付株式数 1,900株 (1,800株)
横河電機	60,800	2,040.00	124,032,000	貸付株式数 12,900株
新電元工業	2,100	3,455.00	7,255,500	
アズビル	38,800	2,539.00	98,513,200	
東亜ディーケーケー	2,900	838.00	2,430,200	
日本光電工業	26,800	3,135.00	84,018,000	
チノー	2,000	1,144.00	2,288,000	
共和電業	6,300	416.00	2,620,800	貸付株式数 100株
日本電子材料	2,400	496.00	1,190,400	
堀場製作所	12,000	5,150.00	61,800,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
アドバンテスト	41,400	2,529.00	104,700,600	貸付株式数 16,400株
小野測器	2,600	555.00	1,443,000	
エスペック	5,300	2,190.00	11,607,000	貸付株式数 1,000株
キーエンス	29,800	61,970.00	1,846,706,000	貸付株式数 2,800株
日置電機	3,200	3,465.00	11,088,000	
シスメックス	47,400	7,742.00	366,970,800	貸付株式数 18,800株
日本マイクロニクス	10,600	915.00	9,699,000	貸付株式数 4,300株 (4,300株)
メガチップス	4,800	1,279.00	6,139,200	貸付株式数 2,100株 (2,100株)
OBARA GROUP	3,200	3,740.00	11,968,000	貸付株式数 1,100株
IMAGICA GROUP	5,000	556.00	2,780,000	貸付株式数 1,100株
澤藤電機	700	1,615.00	1,130,500	
デンソー	133,800	4,460.00	596,748,000	貸付株式数 20,200株
原田工業	2,400	787.00	1,888,800	
コーセル	8,000	1,049.00	8,392,000	貸付株式数 3,100株
イリソ電子工業	5,600	5,260.00	29,456,000	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	10,600	1,248.00	13,228,800	貸付株式数 4,200株
千代田インテグレ	2,600	2,001.00	5,202,600	貸付株式数 600株
アイ・オー・データ	2,400	1,060.00	2,544,000	
レーザーテック	12,400	3,670.00	45,508,000	貸付株式数 3,000株
スタンレー電気	42,900	2,497.00	107,121,300	貸付株式数 6,000株
岩崎電気	2,800	1,302.00	3,645,600	貸付株式数 800株
ウシオ電機	35,200	1,348.00	47,449,600	
岡谷電機	4,300	372.00	1,599,600	
ヘリオステクノH	5,500	590.00	3,245,000	貸付株式数 1,100株
エノモト	1,600	739.00	1,182,400	貸付株式数 600株
日本セラミック	6,100	2,768.00	16,884,800	貸付株式数 2,400株

遠藤照明	3,500	738.00	2,583,000		
古河電池	5,000	643.00	3,215,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
双信電機	2,900	514.00	1,490,600	貸付株式数	1,100株
山一電機	4,400	893.00	3,929,200		
図 研	3,900	1,572.00	6,130,800		
日本電子	12,000	2,426.00	29,112,000	貸付株式数	4,700株
カ シ オ	53,800	1,324.00	71,231,200	貸付株式数	19,800株
ファナック	57,700	19,280.00	1,112,456,000	貸付株式数	21,200株
日本シイエムケイ	15,400	623.00	9,594,200	貸付株式数	6,000株
エンプラス	2,700	3,090.00	8,343,000	貸付株式数	1,000株 (700株)
大真空	2,200	1,072.00	2,358,400		
ロ - ム	29,100	6,770.00	197,007,000		
浜松ホトニクス	43,600	3,975.00	173,310,000		
三井ハイテック	6,700	1,043.00	6,988,100	貸付株式数	2,600株 (100株)
新光電気工業	20,400	903.00	18,421,200		
京 セ ラ	92,600	6,898.00	638,754,800		
協栄産業	700	1,414.00	989,800	貸付株式数	100株
太陽誘電	27,000	1,795.00	48,465,000	貸付株式数	10,700株
村田製作所	191,300	4,616.00	883,040,800		
ユーシン	1,400	983.00	1,376,200		
双葉電子工業	9,900	1,375.00	13,612,500	貸付株式数	3,600株
日東電工	41,900	5,043.00	211,301,700		
北陸電気工業	2,200	944.00	2,076,800		
東海理化電機	16,000	1,685.00	26,960,000	貸付株式数	5,400株
ニチコン	19,100	795.00	15,184,500	貸付株式数	1,800株
日本ケミコン	4,300	1,470.00	6,321,000		
K O A	9,100	1,280.00	11,648,000		
三井E & S H D	21,700	929.00	20,159,300		
日立造船	48,200	357.00	17,207,400	貸付株式数	19,100株
三菱重工業	101,800	4,646.00	472,962,800		
川崎重工業	47,300	2,485.00	117,540,500	貸付株式数	18,800株
I H I	46,700	2,578.00	120,392,600		
名村造船所	18,100	313.00	5,665,300	貸付株式数	7,100株
サノヤスホールディングス	7,900	228.00	1,801,200	貸付株式数	3,100株 (2,900株)
スプリックス	1,900	1,944.00	3,693,600	貸付株式数	700株
日本車輛	2,200	2,487.00	5,471,400	貸付株式数	800株

三菱ロジスネクスト	7,200	1,162.00	8,366,400	貸付株式数	2,800株
近畿車輛	900	1,772.00	1,594,800		
F P G	18,800	873.00	16,412,400	貸付株式数	900株
島根銀行	1,400	706.00	988,400	貸付株式数	200株
じもとホールディングス	40,000	97.00	3,880,000	貸付株式数	15,900株
全国保証	16,900	4,230.00	71,487,000	貸付株式数	6,700株
めぶきフィナンシャルG	311,300	270.00	84,051,000	貸付株式数	49,800株
東京きらぼしF G	8,100	1,676.00	13,575,600		
九州フィナンシャルG	98,300	430.00	42,269,000		
かんぼ生命保険	22,500	2,016.00	45,360,000		
ゆうちょ銀行	169,800	1,078.00	183,044,400	貸付株式数	67,500株
富山第一銀行	14,300	306.00	4,375,800		
コンコルディア・フィナンシャル	376,100	395.00	148,559,500		
ジェイリース	1,500	321.00	481,500	貸付株式数	600株
西日本フィナンシャルHD	37,600	789.00	29,666,400		
マーキュリアインベストメント	2,300	711.00	1,635,300	貸付株式数	300株
イントラスト	1,700	482.00	819,400	貸付株式数	600株
日本モーゲージサービス	1,100	1,126.00	1,238,600	貸付株式数	400株
C a s a	2,700	1,064.00	2,872,800		
アルヒ	5,400	1,783.00	9,628,200	貸付株式数	2,700株
プレミアグループ	3,400	1,939.00	6,592,600		
日産自動車	716,800	757.90	543,262,720	貸付株式数	140,600株
いすゞ自動車	192,100	1,225.00	235,322,500	貸付株式数	23,600株
トヨタ自動車	677,200	6,727.00	4,555,524,400		
日野自動車	75,900	883.00	67,019,700	貸付株式数	14,300株
三菱自動車工業	225,000	500.00	112,500,000	貸付株式数	89,500株
エフテック	4,200	726.00	3,049,200	貸付株式数	1,600株
レシップホールディングス	3,900	798.00	3,112,200	貸付株式数	700株
G M B	1,100	817.00	898,700	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	784.00	784,000		
武蔵精密工業	14,800	1,349.00	19,965,200	貸付株式数	5,800株
日産車体	11,900	1,037.00	12,340,300	貸付株式数	4,700株
新明和工業	25,400	1,312.00	33,324,800	貸付株式数	10,100株
極東開発工業	12,000	1,284.00	15,408,000	貸付株式数	3,600株
日信工業	11,100	1,396.00	15,495,600		
トピー工業	5,000	2,414.00	12,070,000		
ティラド	2,200	1,812.00	3,986,400	貸付株式数	100株
タチエス	10,100	1,281.00	12,938,100	貸付株式数	2,900株

N O K	32,700	1,458.00	47,676,600	貸付株式数	13,000株
フタバ産業	16,900	549.00	9,278,100	貸付株式数	6,200株
K Y B	6,300	2,894.00	18,232,200	貸付株式数	2,400株
市光工業	9,100	617.00	5,614,700		
大同メタル工業	9,900	639.00	6,326,100	貸付株式数	3,300株
プレス工業	30,000	467.00	14,010,000	貸付株式数	11,900株
ミクニ	7,600	375.00	2,850,000	貸付株式数	200株
太平洋工業	12,700	1,432.00	18,186,400	貸付株式数	4,900株
ケーヒン	13,900	1,486.00	20,655,400		
河西工業	7,400	740.00	5,476,000		
アイシン精機	50,000	3,610.00	180,500,000	貸付株式数	19,900株
マ ツ ダ	190,700	1,104.00	210,532,800		
今仙電機製作所	5,600	913.00	5,112,800		
本田技研	512,700	2,775.00	1,422,742,500		
スズキ	111,200	5,177.00	575,682,400	貸付株式数	44,200株
S U B A R U	188,600	2,568.50	484,419,100	貸付株式数	75,000株
安永	2,900	1,430.00	4,147,000	貸付株式数	1,100株
ヤマハ発動機	85,800	1,882.00	161,475,600	貸付株式数	15,600株
ショーワ	14,300	1,378.00	19,705,400		
小糸製作所	36,400	5,440.00	198,016,000	貸付株式数	14,400株
T B K	7,000	385.00	2,695,000	貸付株式数	2,400株
エクセディ	8,300	2,168.00	17,994,400	貸付株式数	600株
ミツバ	11,100	583.00	6,471,300	貸付株式数	4,400株
豊田合成	19,600	1,986.00	38,925,600	貸付株式数	7,800株
愛三工業	9,500	673.00	6,393,500		
盟和産業	1,000	1,034.00	1,034,000	貸付株式数	200株
日本プラスト	4,600	668.00	3,072,800		
ヨ ロ ズ	5,700	1,307.00	7,449,900		
エフ・シー・シー	10,900	2,293.00	24,993,700		
新家工業	1,300	1,455.00	1,891,500		
シマノ	24,500	16,530.00	404,985,000		
テイ・エス テック	14,100	2,801.00	39,494,100		
関西みらいF G	28,100	719.00	20,203,900	貸付株式数	11,200株
3 3 F G	5,200	1,545.00	8,034,000	貸付株式数	500株
第四北越フィナンシャルG	10,400	2,807.00	29,192,800	貸付株式数	1,000株
ジャムコ	3,000	2,156.00	6,468,000	貸付株式数	900株 (900株)
小 野 建	5,300	1,401.00	7,425,300	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
はるやまH L D G S	2,700	826.00	2,230,200		

南陽	1,200	1,527.00	1,832,400		
ノジマ	10,600	1,767.00	18,730,200	貸付株式数	1,000株
佐島電機	4,400	859.00	3,779,600	貸付株式数	1,000株
カップ・クリエイト	8,400	1,375.00	11,550,000	貸付株式数	3,300株
エコトレーディング	1,500	522.00	783,000		
伯東	4,100	1,136.00	4,657,600	貸付株式数	1,000株
コンドーテック	4,600	947.00	4,356,200	貸付株式数	1,600株
中山福	3,400	557.00	1,893,800		
ライトオン	5,000	728.00	3,640,000	貸付株式数	1,700株 (1,400株)
ナガイレベン	8,600	2,507.00	21,560,200	貸付株式数	3,400株
ジーンズメイト	1,800	326.00	586,800	貸付株式数	700株
三菱食品	6,600	2,877.00	18,988,200	貸付株式数	2,300株
良品計画	8,500	19,220.00	163,370,000	貸付株式数	3,300株
三城ホールディングス	7,500	332.00	2,490,000	貸付株式数	2,600株
松田産業	4,500	1,483.00	6,673,500	貸付株式数	1,500株
第一興商	8,900	5,020.00	44,678,000	貸付株式数	1,300株
メディパルHD	64,600	2,372.00	153,231,200		
アドヴァン	9,100	1,095.00	9,964,500	貸付株式数	1,500株 (600株)
S P K	1,200	2,362.00	2,834,400		
萩原電気HLDGS	2,200	2,626.00	5,777,200		
アルビス	2,300	2,473.00	5,687,900	貸付株式数	800株
アズワン	4,300	9,470.00	40,721,000	貸付株式数	800株
スズデン	2,000	1,303.00	2,606,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,277.00	2,426,300		
シモジマ	3,600	1,122.00	4,039,200		
ドウシシャ	5,600	1,800.00	10,080,000	貸付株式数	1,300株
小津産業	1,300	1,718.00	2,233,400		
コナカ	7,700	411.00	3,164,700	貸付株式数	100株
高速	3,500	1,135.00	3,972,500	貸付株式数	100株
ハウスローゼ	700	1,672.00	1,170,400		
G-7ホールディングス	1,700	3,060.00	5,202,000		
たけびし	2,700	1,302.00	3,515,400		
イオン北海道	5,900	724.00	4,271,600	貸付株式数	1,500株
コジマ	10,200	487.00	4,967,400	貸付株式数	4,000株
ヒマラヤ	2,000	862.00	1,724,000		
コーナン商事	7,800	2,257.00	17,604,600	貸付株式数	2,300株
ネットワンシステムズ	21,100	3,125.00	65,937,500	貸付株式数	7,200株
エコス	2,200	1,392.00	3,062,400		

ワタミ	7,800	1,535.00	11,973,000	貸付株式数	3,100株
マルシェ	1,400	781.00	1,093,400	貸付株式数	500株
リックス	1,300	1,416.00	1,840,800		
システムソフト	13,500	92.00	1,242,000	貸付株式数	5,400株
パンパシフィックHD	35,800	6,910.00	247,378,000		
丸文	5,300	549.00	2,909,700		
西松屋チェーン	13,100	877.00	11,488,700	貸付株式数	5,200株
ゼンショーホールディングス	28,200	2,177.00	61,391,400	貸付株式数	11,100株
ハピネット	5,000	1,291.00	6,455,000	貸付株式数	1,900株
幸楽苑ホールディングス	3,800	2,855.00	10,849,000	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,200	1,025.00	1,230,000		
橋本総業HLDS	1,200	1,502.00	1,802,400		
日本ライフライン	18,700	1,763.00	32,968,100	貸付株式数	7,400株
サイゼリヤ	9,900	2,419.00	23,948,100	貸付株式数	3,800株
タカショー	2,800	464.00	1,299,200	貸付株式数	600株
エクセル	2,200	1,576.00	3,467,200		
V Tホールディングス	27,000	443.00	11,961,000		
マルカ	1,900	1,879.00	3,570,100		
アルゴグラフィックス	5,100	2,299.00	11,724,900		
魚力	1,600	1,483.00	2,372,800	貸付株式数	400株
IDOM	20,100	272.00	5,467,200	貸付株式数	8,000株
日本エム・ディ・エム	3,500	1,512.00	5,292,000	貸付株式数	600株
ポプラ	1,500	483.00	724,500	貸付株式数	600株
フジ・コーポレーション	1,500	2,115.00	3,172,500	貸付株式数	600株
ユナイテッドアローズ	6,800	3,645.00	24,786,000	貸付株式数	2,600株 (1,900株)
進和	3,500	2,203.00	7,710,500	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,400	526.00	736,400	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,700	1,184.00	3,196,800	貸付株式数	400株
ハイデイ日高	8,600	1,995.00	17,157,000	貸付株式数	3,400株
シークス	7,600	1,209.00	9,188,400	貸付株式数	2,100株
京都きもの友禅	4,000	360.00	1,440,000		
コロワイド	19,900	2,086.00	41,511,400	貸付株式数	300株
ピーシーデポコーポ	7,900	436.00	3,444,400	貸付株式数	700株 (500株)
田中商事	2,000	583.00	1,166,000	貸付株式数	400株
オーハシテクニカ	3,300	1,421.00	4,689,300	貸付株式数	1,200株
壱番屋	4,200	4,530.00	19,026,000	貸付株式数	1,600株
白銅	1,900	1,333.00	2,532,700		

トップカルチャー	2,200	366.00	805,200	貸付株式数	200株
P L A N T	1,400	807.00	1,129,800		
スギホールディングス	13,100	5,190.00	67,989,000		
島津製作所	78,200	2,806.00	219,429,200	貸付株式数	9,300株
J M S	5,400	680.00	3,672,000	貸付株式数	2,000株
クボテック	1,200	356.00	427,200	貸付株式数	400株
長野計器	4,700	715.00	3,360,500	貸付株式数	200株
ブイ・テクノロジー	2,800	4,460.00	12,488,000	貸付株式数	1,100株
スター精密	10,300	1,357.00	13,977,100		
東京計器	3,900	908.00	3,541,200	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
愛知時計	800	4,130.00	3,304,000	貸付株式数	100株
インターアクション	3,200	1,374.00	4,396,800	貸付株式数	1,200株
オーバル	5,800	235.00	1,363,000	貸付株式数	2,300株
東京精密	11,000	2,492.00	27,412,000	貸付株式数	2,900株
マニー	8,100	6,750.00	54,675,000	貸付株式数	3,200株
ニコン	105,900	1,498.00	158,638,200	貸付株式数	7,100株
トプコン	32,600	1,280.00	41,728,000	貸付株式数	1,400株
オリンパス	362,100	1,233.00	446,469,300	貸付株式数	97,100株
理研計器	5,300	1,962.00	10,398,600	貸付株式数	1,100株
S C R E E Nホールディングス	10,500	3,910.00	41,055,000	貸付株式数	4,200株
キヤノン電子	5,600	1,831.00	10,253,600		
タムロン	5,400	2,162.00	11,674,800	貸付株式数	1,500株
H O Y A	122,300	8,010.00	979,623,000		
シード	2,600	1,057.00	2,748,200		
ノーリツ鋼機	4,800	1,936.00	9,292,800	貸付株式数	1,700株
エー・アンド・デイ	5,500	777.00	4,273,500		
朝日インテック	25,800	5,290.00	136,482,000		
キヤノン	327,200	3,149.00	1,030,352,800		
リコー	182,700	1,070.00	195,489,000	貸付株式数	72,600株
シチズン時計	66,600	525.00	34,965,000	貸付株式数	26,400株
リズム時計	2,000	1,270.00	2,540,000	貸付株式数	600株
大研医器	4,800	645.00	3,096,000	貸付株式数	800株
メニコン	8,300	3,700.00	30,710,000	貸付株式数	400株
シンシア	900	593.00	533,700	貸付株式数	300株
中本パックス	1,700	1,479.00	2,514,300	貸付株式数	300株
スノーピーク	2,300	1,362.00	3,132,600	貸付株式数	900株
パラマウントベッドHD	7,000	4,275.00	29,925,000	貸付株式数	2,300株
トランザクション	3,800	843.00	3,203,400	貸付株式数	1,500株

SHOBI	1,700	370.00	629,000	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	2,600	2,660.00	6,916,000	貸付株式数	900株
前田工織	6,700	1,964.00	13,158,800	貸付株式数	2,600株
永大産業	7,700	333.00	2,564,100	貸付株式数	200株
アートネイチャー	6,400	620.00	3,968,000	貸付株式数	1,300株
バンダイナムコHLDGS	62,800	5,400.00	339,120,000	貸付株式数	20,900株
アイフィスジャパン	1,300	623.00	809,900	貸付株式数	500株
共立印刷	10,200	186.00	1,897,200		
SHOEI	2,900	4,430.00	12,847,000	貸付株式数	1,200株
フランスベッドHLDGS	8,500	981.00	8,338,500		
マーベラス	9,000	830.00	7,470,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
パイロットコーポレーション	10,600	4,170.00	44,202,000		
萩原工業	3,300	1,325.00	4,372,500		
エイベックス	10,200	1,420.00	14,484,000		
トッパン・フォームズ	12,900	874.00	11,274,600	貸付株式数	5,100株
フジシールインターナショナル	13,600	3,290.00	44,744,000	貸付株式数	2,400株
タカラトミー	25,400	1,330.00	33,782,000	貸付株式数	9,300株
廣済堂	5,500	664.00	3,652,000		
エステールホールディングス	1,500	603.00	904,500	貸付株式数	600株
アーク	23,500	103.00	2,420,500	貸付株式数	8,500株
レック	6,500	1,200.00	7,800,000	貸付株式数	2,500株
タカノ	2,400	779.00	1,869,600	貸付株式数	900株
三光合成	6,900	321.00	2,214,900	貸付株式数	1,000株
プロネクサス	5,200	1,149.00	5,974,800	貸付株式数	2,000株
ホクシン	3,700	130.00	481,000		
ウッドワン	2,000	996.00	1,992,000		
大建工業	4,600	2,173.00	9,995,800	貸付株式数	1,800株
きもと	10,100	158.00	1,595,800	貸付株式数	3,800株
凸版印刷	85,800	1,639.00	140,626,200	貸付株式数	34,100株
大日本印刷	85,600	2,406.00	205,953,600	貸付株式数	12,000株
図書印刷	5,700	1,307.00	7,449,900		
共同印刷	1,900	2,770.00	5,263,000	貸付株式数	400株
NISSHA	12,500	1,072.00	13,400,000	貸付株式数	4,900株 (2,700株)
光村印刷	500	2,079.00	1,039,500	貸付株式数	200株
藤森工業	5,400	2,782.00	15,022,800		
ヴィア・ホールディングス	7,200	599.00	4,312,800		
宝印刷	3,100	1,586.00	4,916,600	貸付株式数	200株

前澤化成工業	4,200	1,095.00	4,599,000	貸付株式数	1,600株
未来工業	3,200	2,041.00	6,531,200		
アシックス	57,300	1,214.00	69,562,200	貸付株式数	22,800株
ツ ツ ミ	1,900	2,051.00	3,896,900		
ウェーブロックHLDGS	1,600	662.00	1,059,200		
ジェイ エス ピー	3,600	2,039.00	7,340,400	貸付株式数	100株 (100株)
ニ チ ハ	8,400	2,884.00	24,225,600	貸付株式数	1,200株
エフピコ	6,700	6,730.00	45,091,000	貸付株式数	2,200株
小松ウオール工業	1,800	1,770.00	3,186,000	貸付株式数	300株
ヤマハ	36,100	5,120.00	184,832,000		
河合楽器	1,900	2,994.00	5,688,600		
クリナップ	5,700	534.00	3,043,800	貸付株式数	1,700株
ピジョン	36,700	4,275.00	156,892,500	貸付株式数	14,600株
天馬	4,200	1,765.00	7,413,000	貸付株式数	900株
兼松サステック	400	1,628.00	651,200	貸付株式数	100株
キングジム	4,900	848.00	4,155,200	貸付株式数	1,900株
象印マホービン	15,100	1,162.00	17,546,200	貸付株式数	6,000株
リンテック	14,500	2,213.00	32,088,500		
信越ポリマー	10,900	766.00	8,349,400		
東 リ	14,800	247.00	3,655,600	貸付株式数	2,300株
イトーキ	11,100	426.00	4,728,600	貸付株式数	300株
任 天 堂	34,800	37,450.00	1,303,260,000		
三菱鉛筆	10,000	1,789.00	17,890,000		
松 風	2,900	1,315.00	3,813,500		
タカラスタンダ - ド	12,500	1,671.00	20,887,500	貸付株式数	5,000株
コ ク ヨ	29,100	1,456.00	42,369,600		
ナカバヤシ	5,900	505.00	2,979,500	貸付株式数	1,700株
ニ フ コ	24,400	2,754.00	67,197,600	貸付株式数	9,600株
立川ブラインド	2,600	1,269.00	3,299,400	貸付株式数	1,000株
グロープライド	2,900	3,385.00	9,816,500		
オカムラ	21,200	1,024.00	21,708,800		
バルカー	4,900	2,163.00	10,598,700	貸付株式数	800株
MUTOHホールディングス	800	1,725.00	1,380,000		
伊 藤 忠	418,600	2,022.50	846,618,500	貸付株式数	166,400株
丸 紅	590,200	714.10	421,461,820		
スクロール	9,100	337.00	3,066,700		
高 島	900	1,690.00	1,521,000	貸付株式数	200株
ヨンドシーホールディングス	6,600	2,517.00	16,612,200		
三陽商会	3,600	1,551.00	5,583,600	貸付株式数	1,400株

長瀬産業	33,600	1,592.00	53,491,200		
ナイガイ	2,000	476.00	952,000	貸付株式数	200株
蝶理	3,800	1,668.00	6,338,400	貸付株式数	1,400株
豊田通商	66,800	3,240.00	216,432,000	貸付株式数	13,600株
オンワードホールディングス	35,500	589.00	20,909,500	貸付株式数	1,600株
三共生興	10,200	516.00	5,263,200	貸付株式数	200株
兼松	23,800	1,213.00	28,869,400	貸付株式数	2,700株
美津濃	6,000	2,504.00	15,024,000		
ツカモトコーポレーション	1,000	1,028.00	1,028,000	貸付株式数	400株
ユニー・ファミリーマートHD	66,900	2,665.00	178,288,500	貸付株式数	26,600株
ルックホールディングス	2,100	1,308.00	2,746,800		
三井物産	493,100	1,750.00	862,925,000	貸付株式数	196,000株
日本紙パルプ	3,400	3,580.00	12,172,000	貸付株式数	100株
東京エレクトロン	40,500	14,265.00	577,732,500		
日立ハイテクノロジーズ	18,200	5,530.00	100,646,000		
カメイ	7,800	1,134.00	8,845,200	貸付株式数	3,000株
東都水産	800	2,535.00	2,028,000		
OUGホールディングス	900	2,624.00	2,361,600		
スターゼン	2,200	3,940.00	8,668,000		
セイコーHD	9,400	2,118.00	19,909,200		
山善	23,300	1,036.00	24,138,800		
椿本興業	1,300	3,245.00	4,218,500	貸付株式数	500株
住友商事	353,900	1,601.50	566,770,850	貸付株式数	140,700株
日本ユニシス	18,600	3,645.00	67,797,000	貸付株式数	1,000株
内田洋行	2,700	3,380.00	9,126,000	貸付株式数	1,000株 (1,000株)
三菱商事	420,000	2,877.00	1,208,340,000		
第一実業	2,700	2,925.00	7,897,500	貸付株式数	300株
キヤノンマーケティングJPN	17,100	2,396.00	40,971,600	貸付株式数	6,700株
西華産業	3,400	1,271.00	4,321,400	貸付株式数	1,300株
佐藤商事	5,300	922.00	4,886,600	貸付株式数	2,000株
菱洋エレクトロ	6,000	1,692.00	10,152,000		
東京産業	6,300	470.00	2,961,000	貸付株式数	2,300株
ユアサ商事	6,100	3,050.00	18,605,000		
神鋼商事	1,300	2,323.00	3,019,900		
小林産業	3,300	324.00	1,069,200		
阪和興業	10,400	2,866.00	29,806,400	貸付株式数	4,000株
正栄食品	4,200	3,410.00	14,322,000	貸付株式数	1,200株

カナデン	5,700	1,300.00	7,410,000	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,600	1,586.00	7,295,600		
ニプロ	42,000	1,190.00	49,980,000	貸付株式数	16,200株
フルサト工業	3,300	1,447.00	4,775,100	貸付株式数	1,200株
岩谷産業	13,300	3,715.00	49,409,500	貸付株式数	5,200株
すてきナイスグループ	2,500	587.00	1,467,500	貸付株式数	900株
昭光通商	2,300	620.00	1,426,000	貸付株式数	900株
ニチモウ	1,300	1,733.00	2,252,900	貸付株式数	500株
極東貿易	1,900	1,476.00	2,804,400		
イワキ	7,000	503.00	3,521,000	貸付株式数	2,800株
兼松エレクトロニクス	3,200	2,983.00	9,545,600		
三愛石油	16,000	1,016.00	16,256,000	貸付株式数	2,300株
稲畑産業	14,300	1,357.00	19,405,100	貸付株式数	5,100株
G S Iクレオス	1,600	1,109.00	1,774,400	貸付株式数	100株
明和産業	6,200	359.00	2,225,800	貸付株式数	2,200株
クワザワ	2,000	481.00	962,000		
ゴ-ルドウイン	5,400	13,640.00	73,656,000	貸付株式数	2,100株 (1,400株)
ユニ・チャ-ム	128,900	3,391.00	437,099,900	貸付株式数	4,800株
デサント	14,500	1,902.00	27,579,000	貸付株式数	100株
キング	3,000	610.00	1,830,000	貸付株式数	300株
ワキタ	12,700	1,030.00	13,081,000		
ヤマトインタ-ナショナル	3,700	413.00	1,528,100	貸付株式数	900株
東邦ホールディングス	17,700	2,524.00	44,674,800	貸付株式数	7,000株
サンゲツ	17,700	2,109.00	37,329,300	貸付株式数	7,000株
ミツウロコグループ	8,300	766.00	6,357,800	貸付株式数	1,600株
シナネンホールディングス	2,500	1,788.00	4,470,000	貸付株式数	800株
伊藤忠エネクス	13,200	871.00	11,497,200		
サンリオ	18,500	2,581.00	47,748,500	貸付株式数	4,600株
サンワテクノス	3,600	828.00	2,980,800	貸付株式数	1,200株
リョ-サン	6,600	2,582.00	17,041,200		
新光商事	5,600	1,871.00	10,477,600	貸付株式数	1,600株
トーホ-	2,700	2,023.00	5,462,100	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
三信電気	4,200	1,763.00	7,404,600	貸付株式数	1,600株
東陽テクニカ	6,800	896.00	6,092,800	貸付株式数	700株
モスフードサービス	7,800	2,378.00	18,548,400	貸付株式数	3,000株
加賀電子	5,900	1,537.00	9,068,300	貸付株式数	1,200株
三益半導体	5,300	1,552.00	8,225,600		

ソーダニツカ	6,600	571.00	3,768,600	貸付株式数	1,900株 (900株)
立花エレテック	4,400	1,670.00	7,348,000	貸付株式数	500株
木曽路	7,300	2,530.00	18,469,000	貸付株式数	1,200株
S R S ホールディングス	6,900	1,005.00	6,934,500	貸付株式数	1,700株
千 趣 会	11,100	278.00	3,085,800	貸付株式数	4,300株
タカキュー	4,800	172.00	825,600	貸付株式数	1,700株 (1,600株)
ケーヨー	10,800	486.00	5,248,800	貸付株式数	2,700株
上新電機	7,000	2,123.00	14,861,000		
日本瓦斯	9,700	2,679.00	25,986,300		
ロイヤルホールディングス	10,400	2,773.00	28,839,200	貸付株式数	4,100株
東 天 紅	500	1,200.00	600,000		
いなげや	6,600	1,368.00	9,028,800	貸付株式数	300株
島 忠	12,600	2,350.00	29,610,000	貸付株式数	5,300株
チヨダ	6,300	1,619.00	10,199,700	貸付株式数	100株
ライフコーポレーション	4,500	2,108.00	9,486,000	貸付株式数	1,000株
リンガーハット	7,300	2,219.00	16,198,700	貸付株式数	1,200株
M r M a x H D	8,100	447.00	3,620,700		
テナアライド	5,300	417.00	2,210,100	貸付株式数	600株
A O K I ホールディングス	12,000	1,046.00	12,552,000	貸付株式数	4,400株
オークワ	8,500	1,160.00	9,860,000	貸付株式数	1,200株
コメリ	9,200	2,202.00	20,258,400		
青山商事	10,600	2,072.00	21,963,200	貸付株式数	3,300株
しまむら	7,000	7,810.00	54,670,000	貸付株式数	2,700株
はせがわ	2,900	403.00	1,168,700	貸付株式数	300株
高 島 屋	47,000	1,108.00	52,076,000	貸付株式数	18,600株
松 屋	12,100	886.00	10,720,600	貸付株式数	4,700株
エイチ・ツー・オーリテイリ ング	30,800	1,181.00	36,374,800	貸付株式数	10,500株
近鉄百貨店	2,300	3,310.00	7,613,000	貸付株式数	900株
パ ル コ	5,700	1,051.00	5,990,700	貸付株式数	2,200株
丸井グループ	50,600	2,327.00	117,746,200	貸付株式数	600株
クレディセゾン	42,000	1,242.00	52,164,000	貸付株式数	16,600株
アクシアル リテイリング	5,000	3,615.00	18,075,000	貸付株式数	1,900株
井 筒 屋	3,300	266.00	877,800		
イオン	230,400	1,857.50	427,968,000	貸付株式数	91,600株
イ ズ ミ	12,200	4,500.00	54,900,000		
フォーバル	2,600	948.00	2,464,800		
平 和 堂	12,200	1,935.00	23,607,000	貸付株式数	4,600株

フジ	7,200	1,802.00	12,974,400		
ヤオコー	6,800	4,950.00	33,660,000	貸付株式数	2,700株
ゼビオホールディングス	7,200	1,249.00	8,992,800	貸付株式数	2,400株
ケースホールディングス	62,200	1,036.00	64,439,200	貸付株式数	15,000株 (13,000株)
PALTA C	10,800	5,800.00	62,640,000	貸付株式数	3,600株
三谷産業	7,900	276.00	2,180,400	貸付株式数	3,100株 (3,100株)
OLYMPICグループ	3,500	694.00	2,429,000		
日産東京販売HD	8,500	271.00	2,303,500		
新生銀行	44,000	1,655.00	72,820,000	貸付株式数	17,400株
あおぞら銀行	33,500	2,555.00	85,592,500		
三菱UFJフィナンシャルG	4,126,100	503.70	2,078,316,570		
りそなホールディングス	657,700	440.00	289,388,000		
三井住友トラストHD	117,800	3,880.00	457,064,000		
三井住友フィナンシャルG	422,400	3,766.00	1,590,758,400		
千葉銀行	206,100	531.00	109,439,100	貸付株式数	18,100株
群馬銀行	119,900	389.00	46,641,100	貸付株式数	1,700株
武蔵野銀行	8,900	2,073.00	18,449,700		
千葉興業銀行	16,300	279.00	4,547,700	貸付株式数	6,500株
筑波銀行	24,700	171.00	4,223,700		
七十七銀行	18,800	1,614.00	30,343,200		
青森銀行	4,600	2,759.00	12,691,400	貸付株式数	400株
秋田銀行	3,800	2,041.00	7,755,800	貸付株式数	1,400株
山形銀行	6,700	1,681.00	11,262,700	貸付株式数	1,700株 (1,600株)
岩手銀行	4,200	2,990.00	12,558,000	貸付株式数	800株
東邦銀行	53,500	247.00	13,214,500	貸付株式数	21,200株
東北銀行	3,000	1,085.00	3,255,000	貸付株式数	1,100株
みちのく銀行	4,000	1,648.00	6,592,000	貸付株式数	1,100株
ふくおかフィナンシャルG	52,800	1,921.00	101,428,800		
静岡銀行	150,100	802.00	120,380,200	貸付株式数	59,100株
十六銀行	8,000	2,338.00	18,704,000		
スルガ銀行	60,500	414.00	25,047,000	貸付株式数	23,700株 (7,000株)
八十二銀行	144,500	460.00	66,470,000	貸付株式数	6,300株
山梨中央銀行	7,300	1,206.00	8,803,800	貸付株式数	2,600株
大垣共立銀行	12,600	2,477.00	31,210,200	貸付株式数	5,000株

福井銀行	5,100	1,538.00	7,843,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北國銀行	6,200	3,115.00	19,313,000	
清水銀行	2,500	1,801.00	4,502,500	貸付株式数 900株 (300株)
富山銀行	1,100	2,598.00	2,857,800	貸付株式数 100株
滋賀銀行	12,000	2,544.00	30,528,000	貸付株式数 4,200株
南都銀行	9,300	2,300.00	21,390,000	貸付株式数 3,700株
百五銀行	53,700	341.00	18,311,700	貸付株式数 1,700株
京都銀行	21,500	4,170.00	89,655,000	
紀陽銀行	21,200	1,467.00	31,100,400	貸付株式数 8,400株
ほくほくフィナンシャルG	39,800	1,173.00	46,685,400	
広島銀行	88,400	549.00	48,531,600	
山陰合同銀行	35,500	690.00	24,495,000	
中国銀行	51,600	1,009.00	52,064,400	貸付株式数 20,500株
鳥取銀行	2,000	1,407.00	2,814,000	貸付株式数 400株
伊予銀行	79,300	563.00	44,645,900	貸付株式数 8,800株
百十四銀行	6,300	2,338.00	14,729,400	貸付株式数 100株
四国銀行	8,400	938.00	7,879,200	貸付株式数 1,800株
阿波銀行	9,100	2,680.00	24,388,000	貸付株式数 3,700株
大分銀行	3,700	3,130.00	11,581,000	
宮崎銀行	4,000	2,653.00	10,612,000	
佐賀銀行	3,600	1,563.00	5,626,800	貸付株式数 1,400株
沖縄銀行	5,500	3,515.00	19,332,500	貸付株式数 1,900株
琉球銀行	13,800	1,111.00	15,331,800	貸付株式数 2,500株
セブン銀行	202,400	280.00	56,672,000	貸付株式数 80,500株
みずほフィナンシャルG	8,144,300	151.40	1,233,047,020	貸付株式数 2,800,000株
高知銀行	2,100	762.00	1,600,200	貸付株式数 300株
山口フィナンシャルG	74,800	745.00	55,726,000	貸付株式数 19,000株
芙蓉総合リース	6,800	5,700.00	38,760,000	
興銀リース	11,300	2,639.00	29,820,700	貸付株式数 4,400株
東京センチュリー	12,100	4,530.00	54,813,000	貸付株式数 4,500株
SBIホールディングス	71,400	2,602.00	185,782,800	貸付株式数 28,400株
日本証券金融	26,200	543.00	14,226,600	貸付株式数 10,400株
アイフル	91,200	212.00	19,334,400	貸付株式数 300株 (300株)
日本アジア投資	5,000	179.00	895,000	貸付株式数 1,900株
長野銀行	2,000	1,689.00	3,378,000	
名古屋銀行	4,800	3,390.00	16,272,000	貸付株式数 400株
北洋銀行	90,200	256.00	23,091,200	

愛知銀行	2,200	3,775.00	8,305,000	貸付株式数	600株
中京銀行	2,400	2,186.00	5,246,400		
大光銀行	2,000	1,602.00	3,204,000		
愛媛銀行	8,300	1,102.00	9,146,600	貸付株式数	3,100株
トマト銀行	2,300	1,025.00	2,357,500		
京葉銀行	26,400	636.00	16,790,400	貸付株式数	4,500株
栃木銀行	30,700	182.00	5,587,400	貸付株式数	4,200株
北日本銀行	1,800	1,726.00	3,106,800	貸付株式数	300株
東和銀行	10,400	708.00	7,363,200		
福島銀行	5,100	258.00	1,315,800	貸付株式数	2,200株
大東銀行	2,900	565.00	1,638,500	貸付株式数	500株
リコーリース	4,700	3,330.00	15,651,000	貸付株式数	1,400株
イオンフィナンシャルサービス	38,300	1,698.00	65,033,400	貸付株式数	4,600株
アコム	120,400	378.00	45,511,200	貸付株式数	47,900株
ジャックス	6,500	2,020.00	13,130,000		
オリコ	161,500	108.00	17,442,000	貸付株式数	36,800株
日立キャピタル	14,100	2,432.00	34,291,200		
アプラスフィナンシャル	31,700	70.00	2,219,000	貸付株式数	11,300株
オリックス	399,800	1,560.00	623,688,000		
三菱UFJリース	135,200	542.00	73,278,400	貸付株式数	53,700株
ジャフコ	9,800	3,825.00	37,485,000		
九州リースサービス	3,000	614.00	1,842,000		
トモニホールディングス	46,400	367.00	17,028,800		
大和証券G本社	481,300	469.50	225,970,350		
野村ホールディングス	1,054,800	348.70	367,808,760		
岡三証券グループ	50,900	404.00	20,563,600	貸付株式数	20,200株
丸三証券	17,800	579.00	10,306,200	貸付株式数	7,000株
東洋証券	21,300	116.00	2,470,800	貸付株式数	3,700株
東海東京HD	71,300	330.00	23,529,000	貸付株式数	23,000株
光世証券	1,400	657.00	919,800	貸付株式数	500株
水戸証券	17,100	198.00	3,385,800	貸付株式数	6,800株
いちよし証券	12,500	743.00	9,287,500	貸付株式数	4,500株
松井証券	29,300	1,026.00	30,061,800	貸付株式数	6,800株
SOMPOホールディングス	105,600	4,237.00	447,427,200		
だいこう証券ビジ	2,400	452.00	1,084,800	貸付株式数	600株
日本取引所グループ	161,900	1,726.00	279,439,400		
マネックスG	55,400	350.00	19,390,000	貸付株式数	16,600株
極東証券	7,900	902.00	7,125,800		
岩井コスモホールディング	6,000	1,136.00	6,816,000	貸付株式数	1,300株

藍澤證券	11,000	678.00	7,458,000	貸付株式数	4,200株
フィデアホール	57,900	116.00	6,716,400		
池田泉州HD	63,200	215.00	13,588,000	貸付株式数	1,000株
アニコムホールディングス	4,900	3,805.00	18,644,500	貸付株式数	1,900株
MS&AD	156,600	3,496.00	547,473,600		
SONY FH	49,100	2,606.00	127,954,600	貸付株式数	12,800株
マネーパートナーズGP	6,800	288.00	1,958,400	貸付株式数	400株
スパークス・グループ	23,700	227.00	5,379,900		
小林洋行	2,000	252.00	504,000		
第一生命HLDGS	338,900	1,623.00	550,034,700		
東京海上HD	214,300	5,538.00	1,186,793,400	貸付株式数	25,100株
アドバンテッジリスクマネ	2,200	691.00	1,520,200	貸付株式数	800株
イー・ギャランティ	5,600	1,369.00	7,666,400	貸付株式数	400株
アサックス	2,600	558.00	1,450,800	貸付株式数	300株
NECキャピタルソリューション	2,500	1,765.00	4,412,500		
T&Dホールディングス	185,200	1,136.00	210,387,200		
アドバンスクリエイト	1,300	1,750.00	2,275,000	貸付株式数	500株
三井不動産	317,700	2,650.00	841,905,000	貸付株式数	126,300株
三菱地所	419,500	2,046.00	858,297,000		
平和不動産	11,200	2,290.00	25,648,000		
東京建物	65,100	1,178.00	76,687,800		
ダイビル	17,300	986.00	17,057,800	貸付株式数	6,800株
京阪神ビルディング	10,800	1,050.00	11,340,000	貸付株式数	1,000株
住友不動産	134,500	4,054.00	545,263,000	貸付株式数	20,700株
太平洋興発	2,300	747.00	1,718,100	貸付株式数	800株
テーオーシー	13,300	600.00	7,980,000	貸付株式数	5,400株
東京楽天地	900	5,160.00	4,644,000	貸付株式数	300株
スターツコーポレーション	8,000	2,566.00	20,528,000		
フジ住宅	8,100	730.00	5,913,000	貸付株式数	1,300株
空港施設	6,500	508.00	3,302,000		
明和地所	4,200	544.00	2,284,800	貸付株式数	1,200株
ゴールドクレスト	4,500	1,964.00	8,838,000		
リログループ	31,700	2,880.00	91,296,000	貸付株式数	12,600株
日本エスリード	2,400	1,602.00	3,844,800		
日神不動産	8,800	442.00	3,889,600	貸付株式数	1,900株
日本エスコン	10,900	679.00	7,401,100	貸付株式数	4,600株
タカラレーベン	27,100	380.00	10,298,000	貸付株式数	9,900株
サンヨーハウジ名古屋	4,000	895.00	3,580,000	貸付株式数	1,300株
イオンモール	29,800	1,659.00	49,438,200	貸付株式数	1,200株

毎日コムネット	1,000	721.00	721,000	
ファースト住建	2,300	1,120.00	2,576,000	貸付株式数 800株
ランド	258,500	8.00	2,068,000	貸付株式数 96,400株 (24,800株)
カチタス	6,700	4,080.00	27,336,000	貸付株式数 2,600株 (400株)
東祥	3,600	2,771.00	9,975,600	貸付株式数 1,400株
トーセイ	8,400	909.00	7,635,600	
穴吹興産	900	2,952.00	2,656,800	貸付株式数 200株
サンフロンティア不動産	8,400	1,026.00	8,618,400	貸付株式数 3,200株
インテリックス	2,000	664.00	1,328,000	貸付株式数 600株
ランドビジネス	3,700	783.00	2,897,100	貸付株式数 500株
グランディハウス	6,100	450.00	2,745,000	
東武鉄道	64,100	3,145.00	201,594,500	貸付株式数 10,600株
相鉄ホールディングス	20,800	3,015.00	62,712,000	
東京急行	165,000	1,952.00	322,080,000	
京浜急行	83,200	1,876.00	156,083,200	貸付株式数 33,100株
小田急電鉄	97,300	2,688.00	261,542,400	貸付株式数 13,100株
京王電鉄	34,000	7,330.00	249,220,000	貸付株式数 4,800株
京成電鉄	45,600	4,035.00	183,996,000	貸付株式数 8,000株
富士急行	8,300	4,010.00	33,283,000	貸付株式数 3,200株 (900株)
新京成電鉄	1,500	2,021.00	3,031,500	
東日本旅客鉄道	108,100	10,265.00	1,109,646,500	
西日本旅客鉄道	54,500	8,780.00	478,510,000	
東海旅客鉄道	54,400	22,740.00	1,237,056,000	
西武ホールディングス	75,200	1,817.00	136,638,400	貸付株式数 10,900株
鴻池運輸	9,700	1,699.00	16,480,300	貸付株式数 3,800株
西日本鉄道	16,800	2,352.00	39,513,600	貸付株式数 6,000株
ハマキョウレックス	4,700	3,805.00	17,883,500	
サカイ引越センター	3,200	6,490.00	20,768,000	
近鉄グループHLDGS	57,500	5,210.00	299,575,000	
阪急阪神HLDGS	76,700	3,830.00	293,761,000	貸付株式数 12,800株
南海電鉄	25,600	2,731.00	69,913,600	
京阪ホールディングス	25,600	4,790.00	122,624,000	貸付株式数 10,100株
神戸電鉄	1,400	3,955.00	5,537,000	貸付株式数 500株
名古屋鉄道	47,300	3,030.00	143,319,000	貸付株式数 15,600株
山陽電鉄	4,400	2,171.00	9,552,400	
トランコム	1,600	6,130.00	9,808,000	貸付株式数 600株
日本通運	22,200	5,500.00	122,100,000	貸付株式数 1,000株

ヤマトホールディングス	100,900	2,221.00	224,098,900	貸付株式数	18,000株
山 九	16,000	5,530.00	88,480,000	貸付株式数	6,300株
日 新	5,000	1,778.00	8,890,000	貸付株式数	1,600株
丸 運	3,200	277.00	886,400	貸付株式数	200株
丸全昭和運輸	4,700	3,410.00	16,027,000	貸付株式数	1,300株
センコーグループHLDGS	31,700	870.00	27,579,000	貸付株式数	4,200株
トナミホールディングス	1,400	5,430.00	7,602,000	貸付株式数	100株
ニッコンホールディングス	21,900	2,551.00	55,866,900	貸付株式数	2,800株
日石輸送	700	2,819.00	1,973,300	貸付株式数	100株
福山通運	7,400	3,945.00	29,193,000	貸付株式数	2,500株
セイノーホールディングス	43,100	1,437.00	61,934,700	貸付株式数	1,500株
エスライン	1,700	961.00	1,633,700	貸付株式数	600株
神奈川中央交通	1,400	3,825.00	5,355,000		
日立物流	12,700	3,415.00	43,370,500	貸付株式数	1,000株
丸和運輸機関	3,000	4,950.00	14,850,000	貸付株式数	1,200株 (1,100株)
C & F ロジホールディングス	5,800	1,314.00	7,621,200		
日本郵船	48,100	1,598.00	76,863,800	貸付株式数	19,100株
商船三井	34,100	2,365.00	80,646,500	貸付株式数	13,600株
川崎汽船	17,800	1,149.00	20,452,200	貸付株式数	7,000株
NSユニテッド海運	3,200	2,196.00	7,027,200	貸付株式数	1,200株
明治海運	5,900	305.00	1,799,500	貸付株式数	1,100株
飯野海運	27,000	360.00	9,720,000		
共栄タンカー	500	1,456.00	728,000		
九州旅客鉄道	48,300	3,515.00	169,774,500		
SGホールディングス	54,400	3,145.00	171,088,000	貸付株式数	21,600株
日本航空	105,400	3,517.00	370,691,800		
ANAホールディングス	105,200	3,641.00	383,033,200		
パスコ	1,100	821.00	903,100	貸付株式数	400株
西本WISMETTACH D	1,300	3,750.00	4,875,000		
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400	1,215.00	486,000	貸付株式数	100株
GENKY DRUGSTO RES	2,900	2,521.00	7,310,900	貸付株式数	400株
国際紙パルプ商事	13,700	266.00	3,644,200	貸付株式数	2,000株
総合メディカルHD	5,200	1,671.00	8,689,200	貸付株式数	1,300株
ブックオフGHD	3,000	1,014.00	3,042,000	貸付株式数	1,200株
三菱倉庫	19,900	3,110.00	61,889,000	貸付株式数	5,400株
三井倉庫HOLD	7,000	1,566.00	10,962,000		

住友倉庫	21,100	1,387.00	29,265,700	貸付株式数	8,500株
渋沢倉庫	3,100	1,734.00	5,375,400	貸付株式数	1,200株
ヤマタネ	2,900	1,353.00	3,923,700	貸付株式数	1,000株
東陽倉庫	10,100	319.00	3,221,900	貸付株式数	3,600株
乾汽船	5,200	831.00	4,321,200	貸付株式数	2,000株
日本トランスシティ	12,600	446.00	5,619,600		
ケイヒン	1,000	1,182.00	1,182,000	貸付株式数	400株
中央倉庫	3,500	1,038.00	3,633,000	貸付株式数	1,000株
川西倉庫	1,100	1,057.00	1,162,700	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,600	871.00	4,006,600	貸付株式数	1,300株
ファイズ	1,000	691.00	691,000	貸付株式数	300株
東洋埠頭	1,700	1,363.00	2,317,100		
宇徳	4,900	500.00	2,450,000	貸付株式数	1,000株
上組	35,500	2,515.00	89,282,500		
サンリツ	1,400	634.00	887,600	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,068.00	1,602,000	貸付株式数	100株
キューソー流通システム	1,400	2,080.00	2,912,000	貸付株式数	200株 (200株)
近鉄エクスプレス	10,900	1,390.00	15,151,000	貸付株式数	4,200株
東海運	3,300	247.00	815,100	貸付株式数	1,200株
エーアイティー	3,700	914.00	3,381,800	貸付株式数	300株
内外トランスライン	1,800	1,177.00	2,118,600	貸付株式数	500株
ショーエイコーポ	400	751.00	300,400	貸付株式数	100株
日本コンセプト	2,100	1,220.00	2,562,000	貸付株式数	600株
東京放送HD	39,300	1,835.00	72,115,500	貸付株式数	3,000株
日本テレビHLD S	54,500	1,550.00	84,475,000		
朝日放送グループHD	6,100	719.00	4,385,900	貸付株式数	2,100株
テレビ朝日HD	16,300	1,707.00	27,824,100	貸付株式数	4,300株
スカパーJ S A T H D	45,200	416.00	18,803,200	貸付株式数	15,600株
テレビ東京HD	4,900	2,391.00	11,715,900	貸付株式数	1,900株 (1,500株)
日本BS放送	2,000	1,064.00	2,128,000	貸付株式数	100株
ビジョン	1,800	4,930.00	8,874,000	貸付株式数	700株
スマートバリュー	1,700	711.00	1,208,700	貸付株式数	600株
USEN - NEXT HLD GS	2,300	765.00	1,759,500	貸付株式数	800株
ワイヤレスゲート	2,500	459.00	1,147,500	貸付株式数	1,000株
コネクシオ	4,200	1,334.00	5,602,800	貸付株式数	1,300株
日本通信	51,400	182.00	9,354,800	貸付株式数	22,900株 (1,000株)

クロップス	1,000	620.00	620,000		
日本電信電話	407,900	5,040.00	2,055,816,000		
KDDI	518,300	2,731.50	1,415,736,450		
ソフトバンク	632,200	1,406.00	888,873,200	貸付株式数	206,000株
光通信	7,000	23,210.00	162,470,000	貸付株式数	2,800株
NTTドコモ	377,600	2,486.00	938,713,600		
エムティーアイ	6,900	732.00	5,050,800	貸付株式数	1,000株
GMOインターネット	21,700	1,873.00	40,644,100	貸付株式数	8,600株
アイドママーケティングコ ミュ	1,300	596.00	774,800	貸付株式数	100株
カドカワ	17,300	1,415.00	24,479,500	貸付株式数	6,800株
学研ホールディングス	2,000	5,160.00	10,320,000		
ゼンリン	11,800	1,989.00	23,470,200	貸付株式数	4,700株
昭文社	2,700	350.00	945,000	貸付株式数	300株
インプレスホールディングス	4,900	139.00	681,100	貸付株式数	1,900株
東京電力HD	485,100	569.00	276,021,900	貸付株式数	192,900株
中部電力	185,900	1,531.50	284,705,850	貸付株式数	73,900株
関西電力	248,000	1,245.00	308,760,000	貸付株式数	45,800株
中国電力	84,000	1,367.00	114,828,000	貸付株式数	33,400株
北陸電力	59,500	797.00	47,421,500	貸付株式数	1,500株
東北電力	142,300	1,110.00	157,953,000	貸付株式数	48,100株
四国電力	54,700	989.00	54,098,300	貸付株式数	21,700株
九州電力	125,300	1,066.00	133,569,800	貸付株式数	18,400株
北海道電力	56,800	607.00	34,477,600		
沖縄電力	11,200	1,693.00	18,961,600	貸付株式数	4,400株
電源開発	48,400	2,460.00	119,064,000		
エフオン	3,600	755.00	2,718,000		
イーレックス	10,500	1,157.00	12,148,500	貸付株式数	4,100株
レノバ	10,000	815.00	8,150,000	貸付株式数	3,900株
東京瓦斯	119,200	2,638.50	314,509,200		
大阪瓦斯	117,900	1,901.00	224,127,900		
東邦瓦斯	30,100	4,150.00	124,915,000	貸付株式数	11,900株
北海道瓦斯	3,100	1,497.00	4,640,700		
広島ガス	12,400	332.00	4,116,800		
西部瓦斯	6,800	2,181.00	14,830,800	貸付株式数	1,100株
静岡ガス	18,700	815.00	15,240,500	貸付株式数	2,200株
メタウォーター	2,900	3,280.00	9,512,000	貸付株式数	1,000株
アイネット	3,300	1,183.00	3,903,900		
松竹	3,900	13,080.00	51,012,000	貸付株式数	1,500株
東宝	39,200	4,875.00	191,100,000		

エイチ・アイ・エス	10,300	2,745.00	28,273,500	貸付株式数 4,100株 (3,200株)
東映	2,500	14,980.00	37,450,000	貸付株式数 1,000株
ラックランド	1,100	2,441.00	2,685,100	貸付株式数 400株
NTTデータ	158,800	1,347.00	213,903,600	貸付株式数 50,500株
共立メンテナンス	8,900	5,260.00	46,814,000	貸付株式数 3,400株 (1,300株)
イチネンホールディングス	6,000	1,091.00	6,546,000	貸付株式数 2,000株
建設技術研究所	4,000	1,505.00	6,020,000	貸付株式数 100株
スペース	3,700	1,230.00	4,551,000	貸付株式数 1,400株
長大	2,200	724.00	1,592,800	貸付株式数 800株
アインホールディングス	8,000	6,610.00	52,880,000	貸付株式数 3,200株
燦ホールディングス	1,200	2,362.00	2,834,400	
ピー・シー・エー	800	3,375.00	2,700,000	
スバル興業	400	6,020.00	2,408,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,400	1,319.00	3,165,600	
タナベ経営	1,100	1,190.00	1,309,000	
ビジネスB太田昭和	1,000	2,064.00	2,064,000	
ナガワ	1,600	5,640.00	9,024,000	貸付株式数 400株
よみうりランド	1,200	5,430.00	6,516,000	
東京都競馬	3,800	3,525.00	13,395,000	
常磐興産	2,200	1,664.00	3,660,800	貸付株式数 600株
カナモト	8,700	2,702.00	23,507,400	貸付株式数 3,400株
東京ドーム	21,700	1,079.00	23,414,300	貸付株式数 8,500株
DTS	6,600	4,520.00	29,832,000	
スクウェア・エニックス・HD	27,700	3,445.00	95,426,500	
シーイーシー	6,400	2,377.00	15,212,800	貸付株式数 2,500株
カプコン	25,600	2,172.00	55,603,200	
西尾レントオール	5,900	2,951.00	17,410,900	貸付株式数 100株
アイ・エス・ビー	1,100	1,672.00	1,839,200	貸付株式数 400株
アゴーラ・ホスピタリティーG	33,400	34.00	1,135,600	貸付株式数 8,900株 (800株)
日本空港ビルデング	19,100	4,440.00	84,804,000	貸付株式数 7,600株
トランス・コスモス	6,400	2,363.00	15,123,200	貸付株式数 800株
乃村工藝社	27,100	1,355.00	36,720,500	貸付株式数 10,600株
ジャステック	3,400	960.00	3,264,000	貸付株式数 1,300株
SCSK	15,700	5,340.00	83,838,000	貸付株式数 6,200株
藤田観光	2,300	2,791.00	6,419,300	貸付株式数 900株

KNT - CTホールディングス	3,100	1,409.00	4,367,900	貸付株式数	100株
日本管財	6,200	1,860.00	11,532,000	貸付株式数	1,000株
トーカイ	5,600	2,321.00	12,997,600	貸付株式数	700株
白洋舎	700	2,985.00	2,089,500	貸付株式数	200株
セコム	61,600	9,413.00	579,840,800		
日本システムウエア	2,000	2,763.00	5,526,000		
セントラル警備保障	2,800	5,410.00	15,148,000		
アイネス	7,500	1,110.00	8,325,000	貸付株式数	2,600株
丹青社	10,900	1,231.00	13,417,900	貸付株式数	3,000株
メイテック	7,200	5,630.00	40,536,000	貸付株式数	1,800株
TKC	5,000	4,705.00	23,525,000	貸付株式数	1,900株
富士ソフト	8,900	4,715.00	41,963,500	貸付株式数	3,500株
応用地質	6,200	1,068.00	6,621,600	貸付株式数	2,000株
船井総研ホールディング	12,000	2,656.00	31,872,000	貸付株式数	4,700株
NSD	9,800	3,195.00	31,311,000	貸付株式数	3,800株
進学会ホールディングス	2,800	606.00	1,696,800	貸付株式数	700株
丸紅建材リース	500	1,682.00	841,000	貸付株式数	200株
オオバ	4,400	637.00	2,802,800		
コナミホールディングス	24,400	5,130.00	125,172,000	貸付株式数	9,400株
いであ	1,100	1,167.00	1,283,700	貸付株式数	400株
学究社	1,900	1,296.00	2,462,400		
ベネッセホールディングス	21,300	2,489.00	53,015,700	貸付株式数	3,900株
イオンディライト	7,100	3,170.00	22,507,000		
ナック	3,800	934.00	3,549,200	貸付株式数	1,000株
福井コンピュータHLD S	1,900	2,551.00	4,846,900	貸付株式数	700株
ニチイ学館	8,200	1,554.00	12,742,800	貸付株式数	3,200株
ダイセキ	9,700	2,740.00	26,578,000	貸付株式数	3,800株
ステップ	2,100	1,485.00	3,118,500	貸付株式数	600株
日鉄物産	4,300	4,245.00	18,253,500		
泉州電業	2,000	2,799.00	5,598,000	貸付株式数	100株
元気寿司	1,700	3,775.00	6,417,500		
トラスコ中山	12,400	2,302.00	28,544,800		
ヤマダ電機	182,300	490.00	89,327,000	貸付株式数	63,900株 (400株)
オートバックスセブン	23,800	1,821.00	43,339,800		
モリト	4,200	803.00	3,372,600	貸付株式数	100株
アークランドサカモト	10,100	1,339.00	13,523,900	貸付株式数	1,600株
ニトリホールディングス	25,900	13,250.00	343,175,000	貸付株式数	1,000株
グルメ杵屋	4,100	1,139.00	4,669,900		

愛 眼	4,700	239.00	1,123,300	
ケーユーホールディングス	3,000	857.00	2,571,000	
吉野家ホールディングス	20,800	1,869.00	38,875,200	貸付株式数 8,300株
加藤産業	9,400	3,385.00	31,819,000	
北恵	1,100	833.00	916,300	
イノテック	4,000	806.00	3,224,000	
イエローハット	11,200	1,475.00	16,520,000	
松屋フーズHLDGS	2,900	3,330.00	9,657,000	貸付株式数 700株
JBC Cホールディングス	4,700	1,371.00	6,443,700	
J Kホールディングス	5,500	559.00	3,074,500	貸付株式数 600株
サガミホールディングス	7,900	1,335.00	10,546,500	貸付株式数 3,100株
日 伝	4,900	1,743.00	8,540,700	貸付株式数 500株
関西スーパーマーケット	4,500	1,096.00	4,932,000	貸付株式数 1,400株
ミロク情報サービス	5,900	3,415.00	20,148,500	貸付株式数 2,300株
北沢産業	4,400	277.00	1,218,800	貸付株式数 100株
杉本商事	3,200	2,082.00	6,662,400	貸付株式数 1,200株
因幡電機産業	8,400	4,345.00	36,498,000	貸付株式数 3,200株
王将フードサービス	4,400	6,700.00	29,480,000	貸付株式数 1,700株
ブレナス	6,700	1,868.00	12,515,600	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
ミニストップ	4,400	1,594.00	7,013,600	貸付株式数 1,700株
アークス	11,200	2,212.00	24,774,400	貸付株式数 600株
バローホールディングス	12,900	2,238.00	28,870,200	
東 テ ク	2,000	2,253.00	4,506,000	貸付株式数 500株
ミスミグループ本社	75,000	2,618.00	196,350,000	貸付株式数 29,800株 (26,500株)
藤 久	500	719.00	359,500	貸付株式数 100株
アルテック	4,400	211.00	928,400	
ベ ル ク	3,000	5,350.00	16,050,000	
大 庄	3,100	1,577.00	4,888,700	
タキヒヨー	1,700	1,866.00	3,172,200	
ファーストリテイリング	8,000	66,930.00	535,440,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)
ソフトバンクグループ	247,800	10,190.00	2,525,082,000	
蔵王産業	900	1,344.00	1,209,600	
スズケン	27,300	6,550.00	178,815,000	貸付株式数 10,800株
サンドラッグ	22,500	2,789.00	62,752,500	貸付株式数 8,900株
サクスパーホールディング	5,000	967.00	4,835,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
ジェコス	4,100	953.00	3,907,300	

ヤマザワ	1,200	1,625.00	1,950,000	貸付株式数	400株
やまや	1,000	2,050.00	2,050,000		
ルネサスイーストン	5,500	454.00	2,497,000	貸付株式数	200株
ベルーナ	14,600	739.00	10,789,400	貸付株式数	1,200株
合計			134,161,291,380		

(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 日経225インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	27,395,062	-
コール・ローン	-	23,471,509
親投資信託受益証券	6,622,436,669	8,150,957,344
未収入金	65,230,000	4,080,000
流動資産合計	6,715,061,731	8,178,508,853
資産合計	6,715,061,731	8,178,508,853
負債の部		
流動負債		
未払解約金	81,703,992	14,077,007
未払受託者報酬	622,279	767,469
未払委託者報酬	9,023,568	11,128,790
その他未払費用	156,099	193,744
流動負債合計	91,505,938	26,167,010
負債合計	91,505,938	26,167,010
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,712,067,908	1 6,163,193,495
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,911,487,885	1,989,148,348
（分配準備積立金）	787,561,755	608,929,059
元本等合計	6,623,555,793	8,152,341,843
純資産合計	6,623,555,793	8,152,341,843
負債純資産合計	6,715,061,731	8,178,508,853

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		7		-
有価証券売買等損益		791,841,477		359,039,325
営業収益合計		791,841,484		359,039,325
営業費用				
支払利息		5,625		7,391
受託者報酬		1,061,317		1,489,948
委託者報酬		15,390,187		21,605,307
その他費用		267,176		378,368
営業費用合計		16,724,305		23,481,014
営業利益又は営業損失()		775,117,179		382,520,339
経常利益又は経常損失()		775,117,179		382,520,339
当期純利益又は当期純損失()		775,117,179		382,520,339
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()		116,417,186		28,349,437
期首剰余金又は期首欠損金()		552,144,137		1,911,487,885
剰余金増加額又は欠損金減少額		932,557,007		942,530,739
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		932,557,007		942,530,739
剰余金減少額又は欠損金増加額		231,913,252		510,699,374
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		231,913,252		510,699,374
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		1,911,487,885		1,989,148,348

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	2,751,053,801円	4,712,067,908円
期中追加設定元本額	2,980,382,583円	2,731,635,338円
期中一部解約元本額	1,019,368,476円	1,280,509,751円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,712,067,908口	6,163,193,495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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

<p>1 分配金の計算過程</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(658,704,212円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,123,931,086円)及び分配準備積立金(128,857,543円)より分配対象額は1,911,492,841円(1万口当たり4,056.59円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,380,229,956円)及び分配準備積立金(608,929,059円)より分配対象額は1,989,159,015円(1万口当たり3,227.48円)であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	733,355,795	351,802,133
合計	733,355,795	351,802,133

(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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4057円 (14,057円)	1.3227円 (13,227円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス225・マザーファンド	3,089,941,751	8,150,957,344	
親投資信託受益証券 合計			8,150,957,344	
合計			8,150,957,344	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,389,088,942	-
コール・ローン	-	2,801,951,624
株式	152,731,980,480	168,003,484,800
派生商品評価勘定	32,827,900	38,920
未収入金	1,228,693,438	-
未収配当金	837,754,912	1,161,828,720
前払金	-	19,270,000
流動資産合計	156,220,345,672	171,986,574,064
資産合計	156,220,345,672	171,986,574,064
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,080	12,019,360
前受金	19,860,000	-
未払解約金	802,354,200	54,253,700
その他未払費用	103,114	-
流動負債合計	822,338,394	66,273,060
負債合計	822,338,394	66,273,060
純資産の部		
元本等		
元本	55,624,307,757	65,172,307,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	99,773,699,521	106,747,993,126
元本等合計	155,398,007,278	171,920,301,004
純資産合計	155,398,007,278	171,920,301,004
負債純資産合計	156,220,345,672	171,986,574,064

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6月16日 至 2019年6月17日
-----	------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	57,587,549,837円	55,624,307,757円
期中追加設定元本額	13,183,390,233円	21,184,807,596円
期中一部解約元本額	15,146,632,313円	11,636,807,475円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファ ンド 2 2 5	27,352,858,903円	32,941,137,853円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド 2 2 5 V A	787,917,674円	668,369,882円
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファンド	9,794,942,172円	11,548,166,311円
D - I ' s 日経 2 2 5 イン デックス	113,296,479円	196,978,371円
i F r e e 日経 2 2 5 イン デックス	649,547,457円	1,909,011,874円

	DC・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド)	5,265,561,412円	5,572,832,122円
	ダイワ・ノーロード日経225ファンド	243,350,081円	348,677,753円
	ダイワファンドラップ日経225インデックス	2,370,489,555円	3,089,941,751円
	ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)	9,823,184円	13,075,654円
	ダイワ・インデックスセレクト日経225	9,036,520,840円	8,884,116,307円
	計	55,624,307,757円	65,172,307,878円
2.	期末日における受益権の総数	55,624,307,757口	65,172,307,878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せん。	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せん。
		株式 2,437,650,000円	株式 2,771,150,000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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	15,683,580,916	16,247,051,021
合計	15,683,580,916	16,247,051,021

(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9月20日から2018年6月15日まで、及び2018年9月20日から2019年6月17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6月15日 現在			2019年6月17日 現在		
	契約額等	時価	評価損益	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000	3,930,900,000	-	3,919,020,000	11,880,000
合計	2,638,240,000	-	2,671,110,000	32,870,000	3,930,900,000	-	3,919,020,000	11,880,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.7937円	2.6379円
(1万口当たり純資産額)	(27,937円)	(26,379円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額(円)		備考
		単 価	金 額	
日本水産	292,000	667.00	194,764,000	
マルハニチロ	29,200	3,165.00	92,418,000	
国際石油開発帝石	116,800	923.50	107,864,800	
コムシスホールディングス	292,000	2,710.00	791,320,000	
大成建設	58,400	4,050.00	236,520,000	
大 林 組	292,000	1,037.00	302,804,000	
清水建設	292,000	915.00	267,180,000	
長谷工コーポレーション	58,400	1,096.00	64,006,400	
鹿島建設	146,000	1,507.00	220,022,000	

大和ハウス	292,000	3,352.00	978,784,000	
積水ハウス	292,000	1,797.00	524,724,000	
日 揮	292,000	1,423.00	415,516,000	
日清製粉G本社	292,000	2,521.00	736,132,000	
明治ホールディングス	58,400	7,680.00	448,512,000	
日本ハム	146,000	4,700.00	686,200,000	
ディー・エヌ・エー	87,600	2,191.00	191,931,600	
サッポロホールディングス	58,400	2,276.00	132,918,400	
アサヒグループホールディン	292,000	4,917.00	1,435,764,000	
キリンHD	292,000	2,292.50	669,410,000	
宝ホールディングス	292,000	1,135.00	331,420,000	
双日	29,200	347.00	10,132,400	
キッコーマン	292,000	4,640.00	1,354,880,000	
味の素	292,000	1,892.50	552,610,000	
ニチレイ	146,000	2,754.00	402,084,000	
日本たばこ産業	292,000	2,499.00	729,708,000	
J. フロント リテイリング	146,000	1,143.00	166,878,000	
三越伊勢丹HD	292,000	891.00	260,172,000	
東洋紡	29,200	1,221.00	35,653,200	
ユニチカ	29,200	364.00	10,628,800	
日清紡ホールディングス	292,000	807.00	235,644,000	
東急不動産HD	292,000	601.00	175,492,000	
セブン&アイ・HLDGS	292,000	3,703.00	1,081,276,000	
帝 人	58,400	1,795.00	104,828,000	
東 レ	292,000	808.70	236,140,400	
ク ラ レ	292,000	1,273.00	371,716,000	
旭 化 成	292,000	1,126.00	328,792,000	
SUMCO	29,200	1,201.00	35,069,200	
王子ホールディングス	292,000	601.00	175,492,000	
日本製紙	29,200	1,866.00	54,487,200	
昭和電工	29,200	3,060.00	89,352,000	
住友化学	292,000	480.00	140,160,000	
日産化学	292,000	4,775.00	1,394,300,000	
東ソー	146,000	1,431.00	208,926,000	
トクヤマ	58,400	2,483.00	145,007,200	
デンカ	58,400	3,145.00	183,668,000	
信越化学	292,000	9,217.00	2,691,364,000	
協和発酵キリン	292,000	2,027.00	591,884,000	
三井化学	58,400	2,578.00	150,555,200	
三菱ケミカルHLDGS	146,000	731.70	106,828,200	

宇部興産	29,200	2,103.00	61,407,600	
日本化薬	292,000	1,287.00	375,804,000	
電通	292,000	3,775.00	1,102,300,000	
花王	292,000	8,475.00	2,474,700,000	
武田薬品	292,000	3,697.00	1,079,524,000	
アステラス製薬	1,460,000	1,460.50	2,132,330,000	
大日本住友製薬	292,000	2,060.00	601,520,000	
塩野義製薬	292,000	6,110.00	1,784,120,000	
中外製薬	292,000	7,010.00	2,046,920,000	
エーザイ	292,000	6,263.00	1,828,796,000	
テルモ	1,168,000	3,237.00	3,780,816,000	
第一三共	292,000	6,093.00	1,779,156,000	
大塚ホールディングス	292,000	3,589.00	1,047,988,000	
D I C	29,200	2,783.00	81,263,600	
ヤフー	116,800	306.00	35,740,800	
トレンドマイクロ	292,000	4,945.00	1,443,940,000	
サイバーエージェント	58,400	4,110.00	240,024,000	
楽天	292,000	1,276.00	372,592,000	
富士フイルムHLDGS	292,000	5,384.00	1,572,128,000	
コニカミノルタ	292,000	1,014.00	296,088,000	
資生堂	292,000	8,553.00	2,497,476,000	
出光興産	116,800	3,020.00	352,736,000	
JXTGホールディングス	292,000	510.90	149,182,800	
横浜ゴム	146,000	1,958.00	285,868,000	
ブリヂストン	292,000	4,224.00	1,233,408,000	
A G C	58,400	3,590.00	209,656,000	
日本板硝子	29,200	711.00	20,761,200	
日本電気硝子	87,600	2,633.00	230,650,800	
住友大阪セメント	29,200	4,380.00	127,896,000	
太平洋セメント	29,200	3,245.00	94,754,000	
東海カーボン	292,000	1,118.00	326,456,000	
T O T O	146,000	4,175.00	609,550,000	
日本碍子	292,000	1,492.00	435,664,000	
日本製鉄	29,200	1,828.50	53,392,200	
神戸製鋼所	29,200	679.00	19,826,800	
J F E ホールディングス	29,200	1,510.00	44,092,000	
大平洋金属	29,200	2,101.00	61,349,200	
日本製鋼所	58,400	1,801.00	105,178,400	
日本軽金属HD	292,000	234.00	68,328,000	
三井金属	29,200	2,432.00	71,014,400	

東邦亜鉛	29,200	2,378.00	69,437,600	
三菱マテリアル	29,200	2,961.00	86,461,200	
住友鉱山	146,000	2,900.00	423,400,000	
DOWAホールディングス	58,400	3,465.00	202,356,000	
古河電工	29,200	3,025.00	88,330,000	
住友電工	292,000	1,357.00	396,244,000	
フジクラ	292,000	368.00	107,456,000	
東洋製罐グループHD	292,000	2,237.00	653,204,000	
リクルートホールディングス	876,000	3,486.00	3,053,736,000	
オクマ	58,400	5,270.00	307,768,000	
アマダホールディングス	292,000	1,160.00	338,720,000	
日本郵政	292,000	1,191.00	347,772,000	
小松製作所	292,000	2,430.00	709,560,000	
住友重機械	58,400	3,515.00	205,276,000	
日立建機	292,000	2,818.00	822,856,000	
クボタ	292,000	1,757.50	513,190,000	
荏原製作所	58,400	2,869.00	167,549,600	
千代田化工建	292,000	322.00	94,024,000	
ダイキン工業	292,000	13,855.00	4,045,660,000	
日本精工	292,000	897.00	261,924,000	
N T N	292,000	301.00	87,892,000	
ジェイテクト	292,000	1,217.00	355,364,000	
ミネベアミツミ	292,000	1,659.00	484,428,000	
日立	58,400	3,967.00	231,672,800	
三菱電機	292,000	1,363.00	397,996,000	
富士電機	58,400	3,675.00	214,620,000	
安川電機	292,000	3,275.00	956,300,000	
オムロン	292,000	5,310.00	1,550,520,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	58,400	2,004.00	117,033,600	
日本電気	29,200	4,040.00	117,968,000	
富士通	29,200	7,555.00	220,606,000	
沖電気	29,200	1,297.00	37,872,400	
セイコーエプソン	584,000	1,649.00	963,016,000	
パナソニック	292,000	857.60	250,419,200	
ソニー	292,000	5,635.00	1,645,420,000	
T D K	292,000	7,570.00	2,210,440,000	
アルプスアルパイン	292,000	1,796.00	524,432,000	
横河電機	292,000	2,040.00	595,680,000	
アドバンテスト	584,000	2,529.00	1,476,936,000	
デンソー	292,000	4,460.00	1,302,320,000	

カ シ オ	292,000	1,324.00	386,608,000	
ファナック	292,000	19,280.00	5,629,760,000	
京 セ ラ	584,000	6,898.00	4,028,432,000	
太陽誘電	292,000	1,795.00	524,140,000	
日東電工	292,000	5,043.00	1,472,556,000	
三井E & S H D	29,200	929.00	27,126,800	
日立造船	58,400	357.00	20,848,800	
三菱重工業	29,200	4,646.00	135,663,200	
川崎重工業	29,200	2,485.00	72,562,000	
I H I	29,200	2,578.00	75,277,600	
コンコルディア・フィナンシャル	292,000	395.00	115,340,000	
日産自動車	292,000	757.90	221,306,800	
いすゞ自動車	146,000	1,225.00	178,850,000	
トヨタ自動車	292,000	6,727.00	1,964,284,000	
日野自動車	292,000	883.00	257,836,000	
三菱自動車工業	29,200	500.00	14,600,000	
マ ツ ダ	58,400	1,104.00	64,473,600	
本田技研	584,000	2,775.00	1,620,600,000	
スズキ	292,000	5,177.00	1,511,684,000	
S U B A R U	292,000	2,568.50	750,002,000	
ヤマハ発動機	292,000	1,882.00	549,544,000	
ニコン	292,000	1,498.00	437,416,000	
オリンパス	1,168,000	1,233.00	1,440,144,000	
S C R E E Nホールディングス	58,400	3,910.00	228,344,000	
キヤノン	438,000	3,149.00	1,379,262,000	
リ コ ー	292,000	1,070.00	312,440,000	
シチズン時計	292,000	525.00	153,300,000	
凸版印刷	146,000	1,639.00	239,294,000	
大日本印刷	146,000	2,406.00	351,276,000	
ヤマハ	292,000	5,120.00	1,495,040,000	
伊 藤 忠	292,000	2,022.50	590,570,000	
丸 紅	292,000	714.10	208,517,200	
豊田通商	292,000	3,240.00	946,080,000	
ユニー・ファミリーマートH D	1,168,000	2,665.00	3,112,720,000	
三井物産	292,000	1,750.00	511,000,000	
東京エレクトロン	292,000	14,265.00	4,165,380,000	
住友商事	292,000	1,601.50	467,638,000	
三菱商事	292,000	2,877.00	840,084,000	
高 島 屋	146,000	1,108.00	161,768,000	
丸井グループ	292,000	2,327.00	679,484,000	

クレディセゾン	292,000	1,242.00	362,664,000	
イオン	292,000	1,857.50	542,390,000	
新生銀行	29,200	1,655.00	48,326,000	
あおぞら銀行	29,200	2,555.00	74,606,000	
三菱UFJフィナンシャルG	292,000	503.70	147,080,400	
りそなホールディングス	29,200	440.00	12,848,000	
三井住友トラストHD	29,200	3,880.00	113,296,000	
三井住友フィナンシャルG	29,200	3,766.00	109,967,200	
千葉銀行	292,000	531.00	155,052,000	
ふくおかフィナンシャルG	58,400	1,921.00	112,186,400	
静岡銀行	292,000	802.00	234,184,000	
みずほフィナンシャルG	292,000	151.40	44,208,800	
大和証券G本社	292,000	469.50	137,094,000	
野村ホールディングス	292,000	348.70	101,820,400	
松井証券	292,000	1,026.00	299,592,000	
SOMPOホールディングス	73,000	4,237.00	309,301,000	
MS&AD	87,600	3,496.00	306,249,600	
SONY FH	58,400	2,606.00	152,190,400	
第一生命HLDGS	29,200	1,623.00	47,391,600	
東京海上HD	146,000	5,538.00	808,548,000	
T&Dホールディングス	58,400	1,136.00	66,342,400	
三井不動産	292,000	2,650.00	773,800,000	
三菱地所	292,000	2,046.00	597,432,000	
東京建物	146,000	1,178.00	171,988,000	
住友不動産	292,000	4,054.00	1,183,768,000	
東武鉄道	58,400	3,145.00	183,668,000	
東京急行	146,000	1,952.00	284,992,000	
小田急電鉄	146,000	2,688.00	392,448,000	
京王電鉄	58,400	7,330.00	428,072,000	
京成電鉄	146,000	4,035.00	589,110,000	
東日本旅客鉄道	29,200	10,265.00	299,738,000	
西日本旅客鉄道	29,200	8,780.00	256,376,000	
東海旅客鉄道	29,200	22,740.00	664,008,000	
日本通運	29,200	5,500.00	160,600,000	
ヤマトホールディングス	292,000	2,221.00	648,532,000	
日本郵船	29,200	1,598.00	46,661,600	
商船三井	29,200	2,365.00	69,058,000	
川崎汽船	29,200	1,149.00	33,550,800	
ANAホールディングス	29,200	3,641.00	106,317,200	
三菱倉庫	146,000	3,110.00	454,060,000	

スカパーJ S A T H D	29,200	416.00	12,147,200	
日本電信電話	58,400	5,040.00	294,336,000	
K D D I	1,752,000	2,731.50	4,785,588,000	
N T T ドコモ	29,200	2,486.00	72,591,200	
東京電力H D	29,200	569.00	16,614,800	
中部電力	29,200	1,531.50	44,719,800	
関西電力	29,200	1,245.00	36,354,000	
東京瓦斯	58,400	2,638.50	154,088,400	
大阪瓦斯	58,400	1,901.00	111,018,400	
東 宝	29,200	4,875.00	142,350,000	
N T T データ	1,460,000	1,347.00	1,966,620,000	
東京ドーム	146,000	1,079.00	157,534,000	
セコム	292,000	9,413.00	2,748,596,000	
コナミホールディングス	292,000	5,130.00	1,497,960,000	
ファーストリテイリング	292,000	66,930.00	19,543,560,000	
ソフトバンクグループ	876,000	10,190.00	8,926,440,000	
合計			168,003,484,800	

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年6月16日から2019年6月17日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,091,585	-
コール・ローン	99,392,169	155,405,158
親投資信託受益証券	31,815,061,868	36,061,336,569
未収入金	-	22,100,000
流動資産合計	31,915,545,622	36,238,841,727
資産合計	31,915,545,622	36,238,841,727
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,524,952	97,961,037
未払受託者報酬	3,048,135	3,678,676
未払委託者報酬	58,677,590	70,815,327
その他未払費用	763,415	929,204
流動負債合計	95,014,092	173,384,244
負債合計	95,014,092	173,384,244
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,661,230,421	1 28,513,883,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,159,301,109	7,551,573,778
（分配準備積立金）	3,133,565,006	3,262,261,400
元本等合計	31,820,531,530	36,065,457,483
純資産合計	31,820,531,530	36,065,457,483
負債純資産合計	31,915,545,622	36,238,841,727

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年6月16日 至 2018年6月15日	自	2018年6月16日 至 2019年6月17日
営業収益				
受取利息		-		11
有価証券売買等損益		2,568,684,006		859,924,701
営業収益合計		2,568,684,006		859,924,712
営業費用				
支払利息		39,398		66,496
受託者報酬		5,194,436		7,302,906
委託者報酬		99,994,758		140,582,536
その他費用		1,301,885		1,832,049
営業費用合計		106,530,477		149,783,987
営業利益		2,462,153,529		710,140,725
経常利益		2,462,153,529		710,140,725
当期純利益		2,462,153,529		710,140,725
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（ ）		211,364,293		128,066,493
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,786,148,437		6,159,301,109
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,729,825,045		2,235,370,830
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,729,825,045		2,235,370,830
剰余金減少額又は欠損金増加額		607,461,609		1,681,305,379
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		607,461,609		1,681,305,379
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,159,301,109		7,551,573,778

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	14,953,852,748円	25,661,230,421円
期中追加設定元本額	15,243,885,793円	9,938,067,643円
期中一部解約元本額	4,536,508,120円	7,085,414,359円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,661,230,421口	28,513,883,705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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

<p>1 分配金の計算過程</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(2,250,820,186円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,025,772,365円)及び分配準備積立金(882,744,820円)より分配対象額は6,159,337,371円(1万口当たり2,400.25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(838,238,043円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,289,371,259円)及び分配準備積立金(2,424,023,357円)より分配対象額は7,551,632,659円(1万口当たり2,648.41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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,530,600,242	918,547,228
合計	2,530,600,242	918,547,228

(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6月15日現在	第3期 2019年6月17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6月16日 至 2019年6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,240円 (12,400円)	1,2648円 (12,648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	18,587,359,708	36,061,336,569	
親投資信託受益証券 合計			36,061,336,569	
合計			36,061,336,569	

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6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	170,771,012	240,579,815
金銭信託	6,720,404	-
コール・ローン	611,913,328	1,793,690,309
株式	34,565,920,178	38,411,435,543
投資証券	839,789,867	1,158,437,168
派生商品評価勘定	7,182,208	77,540,850
未収入金	146,133	1,291,588
未収配当金	65,077,036	69,406,559
差入委託証拠金	340,786,487	486,011,851
流動資産合計	36,608,306,653	42,238,393,683
資産合計	36,608,306,653	42,238,393,683
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	470,094,721	163,149,270
未払金	-	74,328,925
未払解約金	47,051,000	49,780,000
その他未払費用	284,825	-
流動負債合計	517,430,546	287,258,195
負債合計	517,430,546	287,258,195
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,059,528,948	21,623,237,931
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,031,347,159	20,327,897,557
元本等合計	36,090,876,107	41,951,135,488
純資産合計	36,090,876,107	41,951,135,488
負債純資産合計	36,608,306,653	42,238,393,683

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6月16日 至 2019年6月17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	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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>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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	12,815,862,979円	19,059,528,948円
期中追加設定元本額	9,283,343,285円	5,457,024,519円
期中一部解約元本額	3,039,677,316円	2,893,315,536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)	16,801,363,471円	18,587,359,708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)	1,101,496,652円	1,137,083,572円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	155,311,204円	315,080,260円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	119,630,315円	- 円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	171,395,487円	10,016,873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)	710,331,819円	1,573,697,518円
計	19,059,528,948円	21,623,237,931円

2. 期末日における受益権の総数	19,059,528,948口	21,623,237,931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6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、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6月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	<p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2018年6月15日現在	2019年6月17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	272,567,228	3,547,525,858
投資証券	11,180,521	161,117,811
合計	261,386,707	3,708,643,669

（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6月15日まで、及び2019年1月11日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174	2,462,016,448	-	2,529,638,838	67,622,390
合計	1,222,292,941	-	1,229,236,115	6,943,174	2,462,016,448	-	2,529,638,838	67,622,390

（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6月15日 現在				2019年6月17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	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687	38,413,104,193	-	38,566,335,003	153,230,810
アメリカ・ドル	23,050,591,704	-	23,440,320,304	389,728,600	26,146,330,414	-	26,254,580,450	108,250,036
イギリス・ポンド	2,469,653,005	-	2,501,812,782	32,159,777	2,425,285,401	-	2,421,696,731	3,588,670
イスラエル・シケル	44,994,753	-	44,907,931	86,822	45,546,318	-	46,010,860	464,542
オーストラリア・ドル	899,183,431	-	901,270,942	2,087,511	1,032,789,165	-	1,026,589,932	6,199,233
カナダ・ドル	1,269,558,170	-	1,272,319,419	2,761,249	1,430,885,296	-	1,446,209,613	15,324,317
シンガポール・ドル	193,378,996	-	195,332,320	1,953,324	188,155,555	-	189,200,160	1,044,605
スイス・フラン	1,053,725,552	-	1,057,009,555	3,284,003	1,311,901,005	-	1,315,477,801	3,576,796
スウェーデン・クローナ	378,456,128	-	387,562,624	9,106,496	393,029,169	-	394,147,930	1,118,761
デンマーク・クローネ	254,151,958	-	254,941,877	789,919	254,942,021	-	256,481,856	1,539,835
ニュージーランド・ドル	33,350,565	-	33,565,970	215,405	35,515,898	-	35,396,972	118,926
ノルウェー・クローネ	100,547,790	-	102,626,776	2,078,986	104,338,301	-	105,152,028	813,727

ユーロ	4,439,687,813	-	4,458,056,820	18,369,007	4,481,391,277	-	4,509,864,700	28,473,423
香港・ドル	485,773,336	-	493,181,568	7,408,232	562,994,373	-	565,525,970	2,531,597
合計	34,673,053,201	-	35,142,908,888	469,855,687	38,413,104,193	-	38,566,335,003	153,230,810

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	1.8936円	1.9401円
(1万口当たり純資産額)	(18,936円)	(19,401円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	株 1,100	アメリカ・ドル 130.150	アメリカ・ドル 143,165.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,003	203.290	203,899.870	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,659	83.830	139,073.970	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	130.430	71,736.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,200	33.950	210,490.000	

ABBOTT LABORATORIES	16,844	82.220	1,384,913.680	
ARCONIC INC	3,950	22.980	90,771.000	
VERISK ANALYTICS INC	1,596	145.830	232,744.680	
LAS VEGAS SANDS CORP	3,229	57.280	184,957.120	
AMPHENOL CORP-CL A	3,188	94.300	300,628.400	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	3,353	121.400	407,054.200	
QORVO INC	1,179	61.500	72,508.500	
AFLAC INC	7,068	55.040	389,022.720	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,248	119.680	149,360.640	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	63.990	117,421.650	
ADOBE INC	4,806	274.280	1,318,189.680	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,750	46.000	80,500.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,008	176.710	178,123.680	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,409	16.340	72,043.060	
GARMIN LTD	1,318	79.790	105,163.220	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,204	219.250	483,227.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,031	172.810	1,215,027.110	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,710	127.270	217,631.700	
WR BERKLEY CORP	1,771	65.620	116,213.020	
AUTOZONE INC	240	1,119.870	268,768.800	
DOLLAR TREE INC	2,399	110.310	264,633.690	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,683	8.240	79,787.920	
PINNACLE WEST CAPITAL	900	97.480	87,732.000	
CELANESE CORP	1,297	104.190	135,134.430	
DR HORTON INC	3,306	45.960	151,943.760	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,249	36.720	45,863.280	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	56.770	139,086.500	
AUTODESK INC	2,203	158.160	348,426.480	
MOODY'S CORP	1,782	192.300	342,678.600	
DEVON ENERGY CORP	4,868	25.770	125,448.360	
ALBEMARLE CORP	800	70.880	56,704.000	
ATMOS ENERGY CORP	1,050	104.990	110,239.500	
ALLIANT ENERGY CORP	2,200	50.000	110,000.000	
CITIGROUP INC	23,176	67.480	1,563,916.480	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,363	165.540	722,251.020	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,453	90.580	403,352.740	

ALLEGHANY CORP	138	690.850	95,337.300	
DOMINO'S PIZZA INC	300	280.650	84,195.000	
HESS CORP	2,896	57.250	165,796.000	
DAVITA INC	1,000	48.880	48,880.000	
DANAHER CORP	6,131	139.630	856,071.530	
FORTIVE CORP	3,044	77.330	235,392.520	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,314	84.930	451,318.020	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,200	27.070	32,484.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,701	23.850	40,568.850	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,074	40.790	247,758.460	
BUNGE LTD	1,838	57.860	106,346.680	
TE CONNECTIVITY LTD	3,246	90.660	294,282.360	
APPLE INC	46,135	192.740	8,892,059.900	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,359	77.450	260,154.550	
BOEING CO/THE	5,273	347.160	1,830,574.680	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,450	103.540	150,133.000	
BECTON DICKINSON AND CO	2,493	234.160	583,760.880	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,500	20.040	30,060.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	78.840	110,376.000	
CDK GLOBAL INC	1,100	48.590	53,449.000	
NISOURCE INC	4,026	28.750	115,747.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,050	83.700	87,885.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,381	44.490	372,870.690	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	40,197	58.280	2,342,681.160	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	12,579	205.160	2,580,707.640	
ANSYS INC	720	197.130	141,933.600	
H&R BLOCK INC	1,600	28.690	45,904.000	
BB&T CORP	6,955	50.060	348,167.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	16,067	47.560	764,146.520	
JPMORGAN CHASE & CO	31,962	109.820	3,510,066.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,275	105.940	241,013.500	
LKQ CORP	3,300	26.240	86,592.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	178.670	97,732.490	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,652	56.260	149,201.520	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,650	67.720	179,458.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,235	153.530	189,609.550	
DOLLAR GENERAL CORP	2,672	135.690	362,563.680	

SERVICENOW INC	1,884	272.250	512,919.000	
CATERPILLAR INC	5,483	127.230	697,602.090	
CMS ENERGY CORP	2,500	58.750	146,875.000	
MOSAIC CO/THE	3,000	22.360	67,080.000	
DELTA AIR LINES INC	1,650	55.990	92,383.500	
CORNING INC	8,399	30.910	259,613.090	
CISCO SYSTEMS INC	43,266	54.750	2,368,813.500	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,265	62.090	78,543.850	
MORGAN STANLEY	12,559	42.820	537,776.380	
WABCO HOLDINGS INC	459	130.790	60,032.610	
MSCI INC	730	235.780	172,119.400	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	275.840	124,128.000	
MIDDLEBY CORP	400	131.100	52,440.000	
COTY INC-CL A	4,757	13.580	64,600.060	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,507	56.580	141,846.060	
BROADCOM INC	3,890	265.930	1,034,467.700	
ACUITY BRANDS INC	350	133.500	46,725.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	700	70.030	49,021.000	
ARAMARK	3,173	34.470	109,373.310	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,612	26.080	42,040.960	
DTE ENERGY COMPANY	1,933	129.540	250,400.820	
CENTENE CORP	3,908	53.550	209,273.400	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	900	107.740	96,966.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	4,050	34.970	141,628.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,797	87.700	157,596.900	
GARTNER INC	800	158.580	126,864.000	
SPLUNK INC	1,304	118.240	154,184.960	
DOMINION ENERGY INC	7,639	76.660	585,605.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,436	61.330	272,059.880	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	45.530	63,742.000	
DEERE & CO	3,008	151.510	455,742.080	
GLOBAL PAYMENTS INC	1,610	158.810	255,684.100	
VMWARE INC-CLASS A	833	168.290	140,185.570	
CHEMOURS CO/THE	1,400	23.840	33,376.000	
BURLINGTON STORES INC	700	168.690	118,083.000	
NASDAQ INC	850	95.710	81,353.500	
VAIL RESORTS INC	390	235.980	92,032.200	
EAST WEST BANCORP INC	1,461	44.250	64,649.250	
TARGA RESOURCES CORP	2,029	36.590	74,241.110	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA	501	153.450	76,878.450	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	104.430	91,271.820	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	405	63.760	25,822.800	
CONSOLIDATED EDISON INC	2,994	88.540	265,088.760	
COGNEX CORP	1,400	43.690	61,166.000	
TELEFLEX INC	485	320.240	155,316.400	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	806	90.850	73,225.100	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	500	287.100	143,550.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,225	164.630	201,671.750	
IDEX CORP	700	159.680	111,776.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,633	73.350	559,880.550	
ROLLINS INC	1,050	37.650	39,532.500	
AMETEK INC	1,982	84.990	168,450.180	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,155	77.160	166,279.800	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,000	32.220	32,220.000	
HEICO CORP	535	126.170	67,500.950	
XPO LOGISTICS INC	1,060	56.740	60,144.400	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	720	163.250	117,540.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	398	296.330	117,939.340	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,356	86.500	290,294.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,302	260.150	1,119,165.300	
GRUBHUB INC	1,000	70.160	70,160.000	
EPAM SYSTEMS INC	549	174.500	95,800.500	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	878	88.360	77,580.080	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	240	740.590	177,741.600	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,800	17.980	50,344.000	
UGI CORP	2,085	53.050	110,609.250	
CUMMINS INC	1,604	163.860	262,831.440	
ACTIVISION BLIZZARD INC	7,859	45.620	358,527.580	
SABRE CORP	4,326	22.290	96,426.540	
CDW CORP/DE	1,300	104.240	135,512.000	
SIGNATURE BANK	769	116.300	89,434.700	
COSTAR GROUP INC	382	549.660	209,970.120	
SVB FINANCIAL GROUP	448	218.180	97,744.640	
AMERCO	70	389.060	27,234.200	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	826	142.040	117,325.040	
MERCADOLIBRE INC	480	616.000	295,680.000	
HANESBRANDS INC	2,900	16.590	48,111.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	137.810	115,346.970	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,881	93.420	269,143.020	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	2,245	15.900	35,695.500	
IPG PHOTONICS CORP	250	131.940	32,985.000	
DEXCOM INC	900	148.040	133,236.000	
COPART INC	1,778	73.810	131,234.180	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,591	98.950	157,429.450	
SEATTLE GENETICS INC	1,000	68.500	68,500.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	688	305.700	210,321.600	
TRANSDIGM GROUP INC	500	472.860	236,430.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	4,347	23.060	100,241.820	
KINDER MORGAN INC	19,898	20.530	408,505.940	
HCA HEALTHCARE INC	2,689	126.630	340,508.070	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	382	320.050	122,259.100	
CABOT OIL & GAS CORP	4,608	23.770	109,532.160	
T-MOBILE US INC	3,449	74.900	258,330.100	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	45.390	81,066.540	
COCA-COLA CO/THE	39,438	51.310	2,023,563.780	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,575	56.740	146,105.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,946	73.970	143,945.620	
EATON VANCE CORP	1,250	41.340	51,675.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	33.360	128,469.360	
CSX CORP	7,356	77.170	567,662.520	
FLUOR CORP	1,290	29.310	37,809.900	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	166.390	174,709.500	
EXPEDIA GROUP INC	1,150	126.810	145,831.500	
AUTOLIV INC	800	65.980	52,784.000	
AMAZON.COM INC	4,088	1,869.670	7,643,210.960	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,600	17.050	27,280.000	
FLOWSERVE CORP	900	48.760	43,884.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,945	183.930	357,743.850	
EXXON MOBIL CORP	41,125	74.350	3,057,643.750	
FLIR SYSTEMS INC	1,613	51.120	82,456.560	
AES CORP	5,088	17.090	86,953.920	

L3 TECHNOLOGIES INC	875	246.760	215,915.000
EVEREST RE GROUP LTD	350	251.050	87,867.500
EOG RESOURCES INC	5,749	85.170	489,642.330
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,250	78.620	98,275.000
ABIOMED INC	355	250.960	89,090.800
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,360	85.050	115,668.000
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,458	69.970	241,956.260
FORD MOTOR CO	37,540	9.980	374,649.200
MACY'S INC	2,200	21.560	47,432.000
DISCOVERY INC - A	1,100	29.020	31,922.000
EXACT SCIENCES CORP	1,255	109.780	137,773.900
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	26.710	64,531.360
DISCOVERY INC-C	4,554	26.840	122,229.360
AERCAP HOLDINGS NV	1,824	48.780	88,974.720
FORTINET INC	1,595	75.710	120,757.450
MARKEL CORP	158	1,087.720	171,859.760
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	800	24.230	19,384.000
NEXTERA ENERGY INC	4,674	206.960	967,331.040
FREEPORT-MCMORAN INC	15,025	10.650	160,016.250
US BANCORP	15,200	52.620	799,824.000
UNITED RENTALS INC	661	122.870	81,217.070
F5 NETWORKS INC	550	136.930	75,311.500
FASTENAL CO	5,814	31.650	184,013.100
FISERV INC	3,500	89.200	312,200.000
GENERAL ELECTRIC CO	85,682	10.230	876,526.860
NEKTAR THERAPEUTICS	1,401	33.400	46,793.400
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,149	54.280	116,647.720
GENERAL MOTORS CO	12,263	35.660	437,298.580
TRIPADVISOR INC	700	45.550	31,885.000
GENERAL DYNAMICS CORP	2,316	171.250	396,615.000
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,329	191.660	638,036.140
ALPHABET INC-CL A	2,864	1,086.300	3,111,163.200
ALPHABET INC-CL C	3,119	1,085.350	3,385,206.650
OWENS CORNING	800	50.220	40,176.000
GENERAL MILLS INC	5,556	53.410	296,745.960
FIRSTENERGY CORP	5,661	43.970	248,914.170
GENUINE PARTS CO	1,200	102.930	123,516.000
IHS MARKIT LTD	3,355	59.320	199,018.600

FIFTH THIRD BANCORP	8,100	27.390	221,859.000	
HARRIS CORP	1,272	190.600	242,443.200	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	950	32.680	31,046.000	
HALLIBURTON CO	7,826	21.380	167,319.880	
HOME DEPOT INC	11,036	205.770	2,270,877.720	
ASSURANT INC	840	106.120	89,140.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	10,745	13.360	143,553.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	350	214.790	75,176.500	
HERSHEY CO/THE	1,358	138.320	187,838.560	
HARLEY-DAVIDSON INC	1,400	34.640	48,496.000	
HUMANA INC	1,288	251.830	324,357.040	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,826	90.890	256,855.140	
HELMERICH & PAYNE	1,336	48.400	64,662.400	
HENRY SCHEIN INC	1,060	71.280	75,556.800	
HP INC	16,133	19.910	321,208.030	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	13,250	14.150	187,487.500	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,100	36.720	40,392.000	
HOLLYFRONTIER CORP	1,783	40.300	71,854.900	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	1,350	36.540	49,329.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	36.490	74,001.720	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,600	35.560	128,016.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	5,973	30.310	181,041.630	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,804	135.150	1,189,860.600	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	42.990	173,980.530	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	54.010	81,015.000	
ZOETIS INC	4,663	110.790	516,613.770	
INGERSOLL-RAND PLC	2,548	124.680	317,684.640	
CHENIERE ENERGY INC	2,484	65.410	162,478.440	
ALLEGION PLC	1,110	106.020	117,682.200	
LEGGETT & PLATT INC	1,572	37.390	58,777.080	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	25.920	132,399.360	
WASTE CONNECTIONS INC	2,665	94.460	251,735.900	
JUNIPER NETWORKS INC	2,850	26.640	75,924.000	
JM SMUCKER CO/THE	900	123.310	110,979.000	

JOHNSON & JOHNSON	26,136	140.090	3,661,392.240	
ABBVIE INC	14,710	78.690	1,157,529.900	
HOLOGIC INC	3,042	47.840	145,529.280	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,544	137.650	487,831.600	
KROGER CO	7,160	24.260	173,701.600	
KLA-TENCOR CORP	1,520	109.700	166,744.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,515	350.140	880,602.100	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	936	272.660	255,209.760	
L BRANDS INC	1,950	22.510	43,894.500	
LOWE'S COS INC	8,058	99.630	802,818.540	
ELI LILLY & CO	8,718	111.740	974,149.320	
LAM RESEARCH CORP	1,477	176.800	261,133.600	
JONES LANG LASALLE INC	587	133.130	78,147.310	
LOEWS CORP	2,550	53.540	136,527.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	1,800	63.480	114,264.000	
MCDONALD'S CORP	7,503	205.290	1,540,290.870	
3M CO	5,739	166.690	956,633.910	
FACEBOOK INC-CLASS A	23,434	181.330	4,249,287.220	
MANPOWERGROUP INC	650	90.800	59,020.000	
S&P GLOBAL INC	2,387	224.900	536,836.300	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	540	223.980	120,949.200	
CONCHO RESOURCES INC	1,800	98.360	177,048.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	5,832	26.570	154,956.240	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,900	32.600	61,940.000	
PHILLIPS 66	4,521	85.590	386,952.390	
TECHNIPFMC PLC	4,561	22.740	103,717.140	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,659	27.660	156,527.940	
DXC TECHNOLOGY CO	2,429	51.720	125,627.880	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,029	156.600	161,141.400	
MYLAN NV	4,888	17.020	83,193.760	
METLIFE INC	7,519	48.810	367,002.390	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	6,124	23.830	145,934.920	
ARISTA NETWORKS INC	593	236.080	139,995.440	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,349	43.580	58,789.420	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,435	160.350	230,102.250	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	210	791.060	166,122.600	
BAKER HUGHES A GE CO	5,556	22.150	123,065.400	

ROCKWELL AUTOMATION INC	1,100	156.530	172,183.000
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	512	38.450	19,686.400
MERCK & CO. INC.	25,393	82.780	2,102,032.540
DUPONT DE NEMOURS INC	7,509	75.080	563,775.720
MASCO CORP	3,543	38.290	135,661.470
M & T BANK CORP	1,323	167.900	222,131.700
MARSH & MCLENNAN COS	5,016	98.180	492,470.880
HEICO CORP-CLASS A	707	100.670	71,173.690
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,783	133.680	372,031.440
WORKDAY INC-CLASS A	1,562	208.000	324,896.000
WAYFAIR INC- CLASS A	600	158.210	94,926.000
SQUARE INC - A	3,626	71.590	259,585.340
TRANSUNION	2,029	70.920	143,896.680
VISTRA ENERGY CORP	4,285	23.770	101,854.450
CAPRI HOLDINGS LTD	1,100	33.510	36,861.000
WORLDPAY INC-CLASS A	2,876	123.160	354,208.160
BEIGENE LTD-ADR	350	117.620	41,167.000
NETAPP INC	2,300	60.980	140,254.000
NIKE INC -CL B	12,489	83.440	1,042,082.160
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,553	194.740	497,171.220
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,050	83.190	170,539.500
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,050	82.560	86,688.000
ALLY FINANCIAL INC	5,094	29.210	148,795.740
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,606	309.430	496,944.580
APTIV PLC	2,680	75.330	201,884.400
NEWMONT GOLDCORP CORP	7,747	35.930	278,349.710
MCKESSON CORP	1,769	133.130	235,506.970
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,387	56.050	133,791.350
XYLEM INC	1,972	81.080	159,889.760
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	15,157	77.200	1,170,120.400
NUCOR CORP	2,700	51.700	139,590.000
WESTERN UNION CO	3,600	20.090	72,324.000
GODADDY INC - CLASS A	1,930	70.040	135,177.200
NEWELL BRANDS INC	4,058	14.500	58,841.000
EVERGY INC	2,400	60.670	145,608.000
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	7,513	49.310	370,466.030
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	247.230	66,504.870
OKTA INC	1,010	128.950	130,239.500

LIBERTY BROADBAND-C	800	100.590	80,472.000
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	2,847	31.950	90,961.650
LINDE PLC	5,189	202.710	1,051,862.190
WIX.COM LTD	500	142.940	71,470.000
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	3,452	21.270	73,424.040
KKR & CO INC -A	4,996	23.790	118,854.840
PAYCHEX INC	3,300	86.680	286,044.000
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	827	387.960	320,842.920
ALTRIA GROUP INC	18,361	50.860	933,840.460
PFIZER INC	54,454	42.760	2,328,453.040
ALKERMES PLC	1,050	21.890	22,984.500
CIGNA CORP	3,726	158.410	590,235.660
DELL TECHNOLOGIES -C	1,917	51.320	98,380.440
ALTICE USA INC- A	1,038	23.800	24,704.400
XCEL ENERGY INC	5,381	60.030	323,021.430
STERIS PLC	897	140.430	125,965.710
FOX CORP - CLASS B	1,530	34.960	53,488.800
FOX CORP - CLASS A	3,450	35.240	121,578.000
STRYKER CORP	3,379	195.470	660,493.130
DOW INC	7,509	51.150	384,085.350
PARKER HANNIFIN CORP	1,239	164.210	203,456.190
UBER TECHNOLOGIES INC	1,648	43.230	71,243.040
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,650	141.580	233,607.000
POLARIS INDUSTRIES INC	400	89.600	35,840.000
PROCTER & GAMBLE CO/THE	24,114	111.200	2,681,476.800
EXELON CORP	9,042	50.800	459,333.600
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,207	117.930	260,271.510
NVR INC	30	3,459.620	103,788.600
CONOCOPHILLIPS	11,290	58.820	664,077.800
TWILIO INC - A	932	140.170	130,638.440
DOCUSIGN INC	1,027	50.780	52,151.060
PAYCOM SOFTWARE INC	491	214.340	105,240.940
PEPSICO INC	13,802	132.730	1,831,939.460
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	130.300	53,292.700
DROPBOX INC-CLASS A	2,392	23.460	56,116.320
MONGODB INC	390	165.680	64,615.200
SNAP INC - A	6,889	13.960	96,170.440

CORTEVA INC	7,509	25.190	189,151.710	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,288	99.230	425,498.240	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	118.270	247,420.840	
ACCENTURE PLC-CL A	6,213	184.970	1,149,218.610	
PENTAIR PLC	1,575	35.620	56,101.500	
QUALCOMM INC	11,870	68.720	815,706.400	
INVESCO LTD	3,700	20.640	76,368.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	819	151.800	124,324.200	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	55.910	178,520.630	
RAYTHEON COMPANY	2,822	177.350	500,481.700	
RED HAT INC	1,790	185.200	331,508.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	745	305.240	227,403.800	
REPUBLIC SERVICES INC	2,050	86.990	178,329.500	
BOOKING HOLDINGS INC	450	1,775.500	798,975.000	
ROSS STORES INC	3,618	100.970	365,309.460	
PACKAGING CORP OF AMERICA	844	95.320	80,450.080	
RESMED INC	1,383	118.090	163,318.470	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,200	101.030	121,236.000	
ROBERT HALF INTL INC	1,499	56.250	84,318.750	
RALPH LAUREN CORP	400	112.130	44,852.000	
PERKINELMER INC	1,163	92.940	108,089.220	
REGIONS FINANCIAL CORP	9,250	14.590	134,957.500	
CHEVRON CORP	18,541	120.810	2,239,938.210	
EDISON INTERNATIONAL	3,103	59.440	184,442.320	
TESLA INC	1,405	214.920	301,962.600	
SYMANTEC CORP	5,400	19.360	104,544.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,581	141.510	223,727.310	
SYNOPSYS INC	1,582	124.800	197,433.600	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,605	392.080	629,288.400	
CBRE GROUP INC - A	2,800	49.560	138,768.000	
TWITTER INC	7,182	36.150	259,629.300	
SOUTHERN CO/THE	9,884	55.650	550,044.600	
SYSCO CORP	5,097	72.250	368,258.250	
TRAVELERS COS INC/THE	2,482	150.110	372,573.020	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,000	53.930	53,930.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	26.430	60,789.000	
SCHLUMBERGER LTD	13,588	35.930	488,216.840	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	45.840	92,871.840	
AT&T INC	70,903	32.350	2,293,712.050	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,758	51.820	91,099.560	
ON SEMICONDUCTOR CORP	3,627	19.050	69,094.350	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	761	473.650	360,447.650	
SEMPRA ENERGY	2,768	137.760	381,319.680	
TIFFANY & CO	1,086	91.020	98,847.720	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,349	44.260	103,966.740	
TEXAS INSTRUMENTS INC	9,023	107.310	968,258.130	
SALESFORCE.COM INC	7,392	150.010	1,108,873.920	
WESTROCK CO	2,321	36.050	83,672.050	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	8,388	39.950	335,100.600	
UNION PACIFIC CORP	6,947	166.990	1,160,079.530	
MARATHON OIL CORP	10,244	12.980	132,967.120	
MARATHON PETROLEUM CORP	7,061	47.960	338,645.560	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	7,879	125.300	987,238.700	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	6,876	101.620	698,739.120	
UNUM GROUP	1,900	33.050	62,795.000	
SPRINT CORP	11,474	7.010	80,432.740	
IQVIA HOLDINGS INC	1,432	141.300	202,341.600	
VOYA FINANCIAL INC	1,800	54.180	97,524.000	
AMEREN CORPORATION	2,861	76.710	219,467.310	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,354	245.370	2,295,190.980	
VERISIGN INC	1,085	205.200	222,642.000	
VALERO ENERGY CORP	3,882	76.760	297,982.320	
ULTA BEAUTY INC	475	354.620	168,444.500	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	39.860	119,898.880	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	992	122.750	121,768.000	
ANTHEM INC	2,521	285.320	719,291.720	
WALT DISNEY CO/THE	17,572	141.650	2,489,073.800	
WELLS FARGO & CO	42,071	45.590	1,918,016.890	
WASTE MANAGEMENT INC	4,225	114.580	484,100.500	
WILLIAMS COS INC	12,523	26.990	337,995.770	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,050	106.140	111,447.000	
WHIRLPOOL CORP	500	135.680	67,840.000	
WALMART INC	14,109	109.070	1,538,868.630	

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	900	78.530	70,677.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,956	117.450	229,732.200	
WYNN RESORTS LTD	1,145	115.610	132,373.450	
XEROX CORP	1,988	34.420	68,426.960	
WABTEC CORP	1,898	68.000	129,064.000	
TJX COMPANIES INC	12,166	53.340	648,934.440	
WATERS CORP	650	203.200	132,080.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	350	87.120	30,492.000	
ALLERGAN PLC	3,129	115.920	362,713.680	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	555	190.810	105,899.550	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,064	52.570	423,924.480	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,228	190.330	233,725.240	
WESTERN DIGITAL CORP	2,545	36.330	92,459.850	
WEC ENERGY GROUP INC	2,869	84.310	241,885.390	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,077	60.960	309,493.920	
VISA INC-CLASS A SHARES	17,152	169.660	2,910,008.320	
PPL CORP	7,394	31.450	232,541.300	
PULTEGROUP INC	1,900	32.850	62,415.000	
PPG INDUSTRIES INC	2,434	116.550	283,682.700	
NORTHERN TRUST CORP	2,062	87.170	179,744.540	
NVIDIA CORP	5,571	144.640	805,789.440	
IAC/INTERACTIVECORP	859	228.420	196,212.780	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,559	135.210	616,422.390	
QURATE RETAIL INC	4,288	12.830	55,015.040	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	2,482	39.510	98,063.820	
TYSON FOODS INC-CL A	3,211	81.910	263,013.010	
NETFLIX INC	4,303	339.730	1,461,858.190	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,851	285.260	1,098,536.260	
NRG ENERGY INC	3,000	34.780	104,340.000	
TORCHMARK CORP	1,215	89.170	108,341.550	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,856	96.350	178,825.600	
TEXTRON INC	2,210	49.450	109,284.500	
NEWS CORP - CLASS A	2,900	11.830	34,307.000	
OGE ENERGY CORP	1,200	43.400	52,080.000	

OMNICOM GROUP	2,546	79.360	202,050.560	
ORACLE CORP	24,568	53.280	1,308,983.040	
MASTERCARD INC - A	8,884	260.100	2,310,728.400	
ONEOK INC	3,736	64.460	240,822.560	
CENTURYLINK INC	9,747	11.100	108,191.700	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,056	364.620	385,038.720	
YUM! BRANDS INC	3,271	109.790	359,123.090	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,191	110.360	131,438.760	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	400	139.800	55,920.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	1,775	54.000	95,850.000	
NOBLE ENERGY INC	3,750	19.730	73,987.500	
BANK OF AMERICA CORP	89,256	28.040	2,502,738.240	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,383	80.840	111,801.720	
NORDSTROM INC	800	32.610	26,088.000	
AMERICAN EXPRESS CO	7,028	122.000	857,416.000	
ANALOG DEVICES INC	3,336	104.020	347,010.720	
ADVANCED MICRO DEVICES	9,545	30.360	289,786.200	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,394	50.520	120,944.880	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,469	53.310	451,482.390	
ANADARKO PETROLEUM CORP	5,105	69.830	356,482.150	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,569	71.800	112,654.200	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,784	124.130	221,447.920	
AVERY DENNISON CORP	650	110.390	71,753.500	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,353	61.640	329,958.920	
EMERSON ELECTRIC CO	6,346	62.770	398,338.420	
AON PLC	2,296	190.760	437,984.960	
AMGEN INC	6,083	176.080	1,071,094.640	
TAPESTRY INC	2,550	29.540	75,327.000	
EATON CORP PLC	4,102	78.370	321,473.740	
CELGENE CORP	7,024	96.510	677,886.240	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,506	187.630	282,570.780	
APPLIED MATERIALS INC	9,164	41.230	377,831.720	
CIT GROUP INC	900	50.190	45,171.000	
CIMAREX ENERGY CO	800	54.600	43,680.000	
CME GROUP INC	3,541	197.100	697,931.100	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,389	20.000	67,780.000	
ECOLAB INC	2,646	198.870	526,210.020	

EQUIFAX INC	1,256	132.040	165,842.240	
GAP INC/THE	2,820	18.180	51,267.600	
GILEAD SCIENCES INC	12,579	66.360	834,742.440	
HORMEL FOODS CORP	3,315	41.430	137,340.450	
STATE STREET CORP	3,948	55.360	218,561.280	
SUNTRUST BANKS INC	4,615	64.570	297,990.550	
SCHWAB (CHARLES) CORP	11,510	41.010	472,025.100	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,175	77.930	403,287.750	
CAMPBELL SOUP CO	1,300	42.260	54,938.000	
CROWN HOLDINGS INC	1,145	57.940	66,341.300	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	44.160	146,567.040	
FEDEX CORP	2,545	164.550	418,779.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,569	90.570	413,814.330	
FMC CORP	1,142	79.910	91,257.220	
FLEX LTD	4,500	9.040	40,680.000	
CERNER CORP	3,200	72.230	231,136.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,163	148.790	173,042.770	
CITRIX SYSTEMS INC	1,350	96.790	130,666.500	
INTEL CORP	44,602	46.190	2,060,166.380	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,800	22.070	61,796.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,814	54.950	209,579.300	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,229	149.050	481,282.450	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	5.560	85,068.000	
ILLUMINA INC	1,463	344.000	503,272.000	
SEALED AIR CORP	1,450	44.320	64,264.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,133	496.540	562,579.820	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,236	113.320	140,063.520	
SNAP-ON INC	500	164.090	82,045.000	
CARMAX INC	1,990	83.540	166,244.600	
COMERICA INC	1,476	70.210	103,629.960	
INGREDION INC	530	81.600	43,248.000	
DUKE ENERGY CORP	6,964	87.870	611,926.680	
TARGET CORP	4,932	87.790	432,980.280	
DOVER CORP	1,713	96.070	164,567.910	
WW GRAINGER INC	400	272.360	108,944.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,116	78.300	87,382.800	
CINTAS CORP	995	236.370	235,188.150	

CONAGRA BRANDS INC	5,567	29.880	166,341.960	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,500	61.710	92,565.000	
CLOROX COMPANY	1,278	156.880	200,492.640	
ENTERGY CORP	2,114	102.040	215,712.560	
MICROSOFT CORP	70,909	132.450	9,391,897.050	
INCYTE CORP	1,993	77.710	154,876.030	
CVS HEALTH CORP	12,896	54.170	698,576.320	
MEDTRONIC PLC	12,889	97.500	1,256,677.500	
MICRON TECHNOLOGY INC	11,372	32.660	371,409.520	
BLACKROCK INC	1,184	446.970	529,212.480	
CENTERPOINT ENERGY INC	5,636	29.620	166,938.320	
HASBRO INC	1,000	107.460	107,460.000	
KELLOGG CO	2,620	56.630	148,370.600	
KEYCORP	8,773	17.150	150,456.950	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,176	116.910	137,486.160	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	14,306	55.050	787,545.300	
KOHL'S CORP	1,650	47.770	78,820.500	
COOPER COS INC/THE	408	323.100	131,824.800	
APACHE CORP	3,673	27.490	100,970.770	
CHUBB LTD	4,288	150.260	644,314.880	
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	67.100	67,100.000	
ALLSTATE CORP	3,410	102.140	348,297.400	
EBAY INC	9,053	38.910	352,252.230	
PAYPAL HOLDINGS INC	10,888	116.170	1,264,858.960	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,283	72.090	92,491.470	
XILINX INC	2,583	105.420	272,299.860	
DISH NETWORK CORP-A	2,984	37.540	112,019.360	
ZIONS BANCORP NA	1,900	44.880	85,272.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,044	176.880	361,542.720	
TRIMBLE INC	2,200	42.720	93,984.000	
LENNAR CORP-A	3,394	53.550	181,748.700	
LEAR CORP	600	133.700	80,220.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	2,300	45.310	104,213.000	
PROGRESSIVE CORP	5,719	81.960	468,729.240	
PACCAR INC	3,525	70.020	246,820.500	
PVH CORP	618	88.050	54,414.900	
BIOGEN INC	1,899	227.670	432,345.330	
IDEXX LABORATORIES INC	742	267.740	198,663.080	

	STARBUCKS CORP	12,484	84.240	1,051,652.160	
	PTC INC	1,200	83.900	100,680.000	
	PERRIGO CO PLC	900	43.180	38,862.000	
	EVERSOURCE ENERGY	3,423	77.410	264,974.430	
	INTUIT INC	2,425	254.130	616,265.250	
	BORGWARNER INC	1,550	40.950	63,472.500	
	BEST BUY CO INC	2,300	66.030	151,869.000	
	BALL CORP	2,892	65.410	189,165.720	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	13,142	40.420	531,199.640	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,024	92.730	280,415.520	
	VULCAN MATERIALS CO	1,223	132.590	162,157.570	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,558	170.220	435,422.760	
	VF CORP	3,204	87.260	279,581.040	
	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	2,841	48.990	139,180.590	
	VIACOM INC-CLASS B	3,071	29.390	90,256.690	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	480	152.290	73,099.200	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,003	130.880	131,272.640	
	CARNIVAL CORP	3,814	53.120	202,599.680	
	COMCAST CORP-CLASS A	43,624	42.310	1,845,731.440	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	37.100	77,910.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	64.800	142,560.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	5,600	7.600	42,560.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	11,000	6.620	72,820.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 241,569,717.020 (26,248,965,451)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	MERLIN ENTERTAINMENT	5,000	3.778	18,890.000	
	TUI AG-DI	4,802	7.502	36,024.600	
	BP PLC	197,527	5.389	1,064,473.000	
	UNILEVER PLC	11,199	49.735	556,982.260	
	BARCLAYS PLC	180,173	1.490	268,457.770	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	17,745	8.918	158,249.910	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	10,500	2.160	22,680.000	
	PRUDENTIAL PLC	25,964	16.015	415,813.460	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	50,836	2.124	107,975.660	
	EVRAZ PLC	7,441	6.960	51,789.360	

JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	30.930	54,374.940	
BAE SYSTEMS PLC	29,337	4.847	142,196.430	
AVIVA PLC	44,349	4.086	181,210.010	
GLAXOSMITHKLINE PLC	48,552	15.844	769,257.880	
INFORMA PLC	11,000	8.000	88,000.000	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	4,204	19.744	83,003.770	
MELROSE INDUSTRIES PLC	40,000	1.695	67,820.000	
AUTO TRADER GROUP PLC	5,971	5.614	33,521.190	
DCC PLC	938	69.440	65,134.720	
OCADO GROUP PLC	4,417	11.595	51,215.110	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	87.000	64,380.000	
HALMA PLC	3,978	19.895	79,142.310	
GVC HOLDINGS PLC	4,161	6.244	25,981.280	
NMC HEALTH PLC	975	22.990	22,415.250	
RELX PLC	20,260	19.085	386,662.100	
DIAGEO PLC	22,895	34.185	782,665.570	
RIO TINTO PLC	11,402	47.700	543,875.400	
STANDARD CHARTERED PLC	29,745	6.764	201,195.180	
TESCO PLC	88,748	2.244	199,150.510	
FRESNILLO PLC	2,400	8.398	20,155.200	
SMITH & NEPHEW PLC	8,329	17.035	141,884.510	
GLENCORE PLC	106,703	2.720	290,285.510	
JOHN WOOD GROUP PLC	5,466	3.978	21,743.740	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	18.700	59,840.000	
SMITHS GROUP PLC	4,080	14.835	60,526.800	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	10,963	3.233	35,443.370	
PEARSON PLC	8,271	7.986	66,052.200	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	1.939	34,186.500	
NEXT PLC	1,159	55.140	63,907.260	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.556	50,159.210	
WHITBREAD PLC	1,785	47.150	84,162.750	
BUNZL PLC	3,159	21.650	68,392.350	
VODAFONE GROUP PLC	273,737	1.280	350,438.100	
CRODA INTERNATIONAL PLC	783	52.400	41,029.200	
KINGFISHER PLC	17,229	2.076	35,767.400	
WPP PLC	13,021	9.604	125,053.680	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	8.242	67,947.040	
SEVERN TRENT PLC	1,300	20.400	26,520.000	

RENTOKIL INITIAL PLC	17,758	3.898	69,220.680
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6,664	65.260	434,892.640
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	10.425	50,905.270
SCHRODERS PLC	1,227	29.290	35,938.830
SSE PLC	8,282	11.220	92,924.040
WEIR GROUP PLC/THE	3,942	14.735	58,085.370
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	5.616	69,458.680
ASTRAZENECA PLC	12,153	62.150	755,308.950
FERGUSON PLC	1,989	55.660	110,707.740
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.667	181,974.740
3I GROUP PLC	8,439	10.250	86,499.750
ASHTED GROUP PLC	3,900	19.490	76,011.000
SAGE GROUP PLC/THE	9,725	7.604	73,948.900
NATIONAL GRID PLC	30,325	8.334	252,728.550
LLOYDS BANKING GROUP PLC	676,372	0.577	390,266.640
RSA INSURANCE GROUP PLC	12,586	5.690	71,614.340
IMPERIAL BRANDS PLC	10,229	19.766	202,186.410
CENTRICA PLC	68,002	0.915	62,235.430
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,963	35.300	69,293.900
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	22,321	28.855	644,072.450
BHP GROUP PLC	21,317	19.100	407,154.700
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,960	24.630	72,904.800
HSBC HOLDINGS PLC	195,667	6.456	1,263,226.150
ANGLO AMERICAN PLC	10,745	21.105	226,773.220
MONDI PLC	3,400	17.265	58,701.000
WM MORRISON SUPERMARKETS	14,500	1.978	28,681.000
CARNIVAL PLC	1,383	40.330	55,776.390
EASYJET PLC	1,644	9.290	15,272.760
COMPASS GROUP PLC	14,239	19.115	272,178.480
PERSIMMON PLC	2,569	19.455	49,979.890
BT GROUP PLC	85,624	2.063	176,642.310
COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	29.060	74,800.440
BURBERRY GROUP PLC	5,136	17.415	89,443.440
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1,303	52.290	68,133.870
INTERTEK GROUP PLC	1,592	55.340	88,101.280
ITV PLC	27,587	1.052	29,035.310

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,735	54.460	148,948.100	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	43,770	25.150	1,100,815.500	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	36,970	25.165	930,350.050	
	MEGGITT PLC	9,925	5.112	50,736.600	
	G4S PLC	11,320	2.116	23,953.120	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	20.780	32,624.600	
	INVESTEC PLC	4,600	4.760	21,896.000	
	ANTOFAGASTA PLC	3,460	8.590	29,721.400	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	17,899	2.719	48,667.380	
	EXPERIAN PLC	9,319	24.080	224,401.520	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 17,563,226.110 (2,401,771,171)	
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	14.230	170,760.000	
	AZRIELI GROUP LTD	530	220.500	116,865.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	11,096	19.120	212,155.520	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	559.000	167,700.000	
	BANK HAPOALIM BM	7,900	25.950	205,005.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	11,400	24.960	284,544.000	
	NICE LTD	800	497.400	397,920.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 1,554,949.520 (46,819,530)	
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	3.380	77,145.120	
	BHP GROUP LTD	29,817	40.300	1,201,625.100	
	SOUTH32 LTD	56,387	3.310	186,640.970	
	ALUMINA LTD	36,217	2.430	88,007.310	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	9,576	35.030	335,447.280	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	10,500	8.800	92,400.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,600	11.480	41,328.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	26,899	26.730	719,010.270	
	WESTPAC BANKING CORP	33,042	27.880	921,210.960	
	SANTOS LTD	18,270	7.000	127,890.000	
	AUSNET SERVICES	28,500	1.945	55,432.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	27,874	28.220	786,604.280	
	RIO TINTO LTD	3,349	105.340	352,783.660	

ORIGIN ENERGY LTD	20,968	7.020	147,195.360	
AURIZON HOLDINGS LTD	15,310	5.340	81,755.400	
COLES GROUP LTD	9,567	13.010	124,466.670	
AMCOR PLC-CDI	10,996	15.650	172,087.400	
OIL SEARCH LTD	15,418	7.000	107,926.000	
SEEK LTD	2,600	21.090	54,834.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	5,592	15.070	84,271.440	
NEWCREST MINING LTD	8,420	30.120	253,610.400	
INCITEC PIVOT LTD	20,400	3.480	70,992.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	17,668	79.770	1,409,376.360	
CALTEX AUSTRALIA LTD	2,000	26.470	52,940.000	
ORICA LTD	2,000	20.450	40,900.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	12.230	187,706.040	
CIMIC GROUP LTD	1,000	45.050	45,050.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	14,056	32.290	453,868.240	
COCA-COLA AMATIL LTD	2,600	10.010	26,026.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	4.590	79,645.680	
CROWN RESORTS LTD	3,000	11.970	35,910.000	
TELSTRA CORP LTD	35,114	3.870	135,891.180	
AMP LTD	24,935	2.110	52,612.850	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,200	18.450	59,040.000	
MACQUARIE GROUP LTD	3,347	122.090	408,635.230	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,163	30.620	188,711.060	
BANK OF QUEENSLAND LTD	3,000	9.540	28,620.000	
CSL LTD	4,463	212.870	950,038.810	
WESFARMERS LTD	11,444	35.660	408,093.040	
COCHLEAR LTD	444	204.230	90,678.120	
BLUESCOPE STEEL LTD	7,092	11.760	83,401.920	
SUNCORP GROUP LTD	14,938	13.370	199,721.060	
BORAL LTD	8,600	5.390	46,354.000	
ASX LTD	2,260	81.000	183,060.000	
COMPUTERSHARE LTD	3,700	16.630	61,531.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	7.790	211,085.630	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	27.500	143,632.500	
CHALLENGER LTD	6,300	6.500	40,950.000	
WORLEYPARSONS LTD	1,321	13.740	18,150.540	
AGL ENERGY LTD	8,466	19.570	165,679.620	
BRAMBLES LTD	18,337	12.970	237,830.890	

	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	800	41.310	33,048.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	900	71.670	64,503.000	
	REA GROUP LTD	608	92.760	56,398.080	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	621	39.280	24,392.880	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 12,306,145.850 (919,638,280)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	36.140	83,122.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	250	1,202.500	300,625.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,438	17.320	42,226.160	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	2,121	90.940	192,883.740	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,200	30.820	129,444.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,100	120.310	132,341.000	
	BCE INC	900	59.880	53,892.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	1,600	104.810	167,696.000	
	SUNCOR ENERGY INC	15,212	41.590	632,667.080	
	METRO INC/CN	3,000	50.520	151,560.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,300	61.730	203,709.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	11,900	70.590	840,021.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,400	103.510	455,444.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	17,900	75.910	1,358,789.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,900	30.000	117,000.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	13,500	103.550	1,397,925.000	
	TOURMALINE OIL CORP	1,300	15.560	20,228.000	
	VERMILION ENERGY INC	1,400	26.780	37,492.000	
	TC ENERGY CORP	8,800	65.660	577,808.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	5,571	48.360	269,413.560	
	BOMBARDIER INC-B	19,200	2.180	41,856.000	
	BARRICK GOLD CORP	17,400	18.660	324,684.000	
	CAE INC	2,300	34.590	79,557.000	
	THOMSON REUTERS CORP	1,833	87.300	160,020.900	
	EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	31.840	57,312.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	600	62.210	37,326.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,000	64.220	64,220.000	
	HYDRO ONE LTD	1,500	22.860	34,290.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	1,489	69.420	103,366.380	

WSP GLOBAL INC	1,200	70.350	84,420.000	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	32.000	73,600.000	
EMERA INC	1,200	53.450	64,140.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	37.950	37,950.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,900	69.050	269,295.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	1,800	62.060	111,708.000	
STARS GROUP INC/THE	3,500	22.020	77,070.000	
KINROSS GOLD CORP	10,534	4.740	49,931.160	
BANK OF MONTREAL	5,800	99.670	578,086.000	
POWER CORP OF CANADA	3,100	27.850	86,335.000	
METHANEX CORP	600	59.960	35,976.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,000	409.150	409,150.000	
NUTRIEN LTD	6,027	71.420	430,448.340	
AURORA CANNABIS INC	7,000	10.130	70,910.000	
CANOPY GROWTH CORP	2,000	55.260	110,520.000	
CRONOS GROUP INC	3,400	20.750	70,550.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,200	51.190	112,618.000	
CAMECO CORP	2,800	13.820	38,696.000	
TELUS CORP	300	48.600	14,580.000	
POWER FINANCIAL CORP	2,000	29.730	59,460.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	29.140	128,216.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	138.050	69,025.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	11,700	35.570	416,169.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	633.330	189,999.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,100	61.730	191,363.000	
WESTON (GEORGE) LTD	901	101.470	91,424.470	
BLACKBERRY LTD	6,400	11.470	73,408.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	5,100	52.710	268,821.000	
ENBRIDGE INC	19,600	46.250	906,500.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	7,800	63.260	493,428.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	20,200	23.320	471,064.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	2,000	28.810	57,620.000	
ENCANA CORP	15,200	6.250	95,000.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,300	311.100	404,430.000	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	52.440	57,684.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,800	52.020	145,656.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,100	122.570	870,247.000	

	CGI INC - CLASS A	2,800	102.270	286,356.000	
	HUSKY ENERGY INC	3,012	12.700	38,252.400	
	ONEX CORPORATION	600	75.330	45,198.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,900	26.670	104,013.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	25.520	48,488.000	
	IGM FINANCIAL INC	300	37.760	11,328.000	
	OPEN TEXT CORP	2,700	55.360	149,472.000	
	CI FINANCIAL CORP	2,000	21.050	42,100.000	
	SAPUTO INC	2,900	39.790	115,391.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	11.150	70,245.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	4,500	85.800	386,100.000	
	FORTIS INC	4,200	52.150	219,030.000	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	6.730	44,418.000	
	CENOVUS ENERGY INC	8,000	11.360	90,880.000	
	DOLLARAMA INC	2,700	46.780	126,306.000	
	ATCO LTD -CLASS I	800	45.120	36,096.000	
	ALTAGAS LTD	4,700	19.180	90,146.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	2,000	22.210	44,420.000	
	KEYERA CORP	2,200	32.250	70,950.000	
	INTER PIPELINE LTD	4,800	19.960	95,808.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 17,897,414.190 (1,449,690,549)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	13,300	24.990	332,367.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	17,100	24.810	424,251.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,100	9.130	64,823.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.300	108,990.000	
	UOL GROUP LTD	5,200	7.260	37,752.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	9.360	48,672.000	
	CAPITALAND LTD	19,000	3.430	65,170.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	27,000	1.470	39,690.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	12,000	2.370	28,440.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	900	36.500	32,850.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,800	10.780	375,144.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.885	39,825.000	

	VENTURE CORP LTD	3,200	16.630	53,216.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	92,400	3.330	307,692.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	4.110	57,951.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	4,000	2.370	9,480.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,000	0.270	2,430.000	
	SATS LTD	7,700	5.140	39,578.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6,900	7.540	52,026.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	10,000	2.580	25,800.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	3.480	54,984.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 2,201,131.000 (174,461,643)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFY AG-REG	189	80.800	15,271.200	
	UBS GROUP AG-REG	37,402	11.520	430,871.040	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	130	628.000	81,640.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	57.520	100,890.080	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	6,828	276.000	1,884,528.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	389	74.150	28,844.350	
	SIKA AG-REG	1,140	159.000	181,260.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	78,100.000	78,100.000	
	ABB LTD-REG	17,676	18.830	332,839.080	
	SWISS RE AG	2,982	98.860	294,800.520	
	NESTLE SA-REG	29,798	101.400	3,021,517.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	163	712.400	116,121.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	531	217.100	115,280.100	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	25,416	11.365	288,852.840	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,198	40.870	89,832.260	
	SGS SA-REG	65	2,582.000	167,830.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	153	211.800	32,405.400	
	VIFOR PHARMA AG	369	138.600	51,143.400	
	TEMENOS AG - REG	793	174.600	138,457.800	
	ALCON INC	4,249	57.980	246,357.020	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	267	258.300	68,966.100	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,492	337.300	503,251.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	611	172.400	105,336.400	
	CLARIANT AG-REG	1,568	18.785	29,454.880	

	NOVARTIS AG-REG	21,246	89.410	1,899,604.860	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	20	1,978.000	39,560.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,428	79.440	431,200.320	
	SWISSCOM AG-REG	276	496.000	136,896.000	
	GEBERIT AG-REG	334	464.100	155,009.400	
	GIVAUDAN-REG	89	2,776.000	247,064.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	841.000	93,351.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	563	230.600	129,827.800	
	LONZA GROUP AG-REG	692	329.100	227,737.200	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	49.240	22,158.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4,770	48.650	232,060.500	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	381	474.600	180,822.600	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	495	134.000	66,330.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	83.700	79,180.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	10	6,885.000	68,850.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 12,413,502.350 (1,350,216,651)	
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	398.200	278,740.000	
	ERICSSON LM-B SHS	32,335	89.280	2,886,868.800	
	VOLVO AB-B SHS	14,568	140.950	2,053,359.600	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	777	506.000	393,162.000	
	SKF AB-B SHARES	4,000	157.650	630,600.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	229.200	595,920.000	
	SWEDISH MATCH AB	2,188	424.900	929,681.200	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	134.100	942,186.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	19,697	87.060	1,714,820.820	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,526	91.880	1,518,408.880	
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,075	140.350	1,273,676.250	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,039	154.040	1,392,367.560	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	167.250	620,330.250	
	SANDVIK AB	13,281	161.600	2,146,209.600	
	INVESTOR AB-B SHS	4,550	439.400	1,999,270.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,668	280.800	2,153,174.400	
	SECURITAS AB-B SHS	2,500	164.600	411,500.000	
	TELIA CO AB	24,107	41.260	994,654.820	

	ALFA LAVAL AB	2,000	200.100	400,200.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,678	255.700	940,464.600	
	ASSA ABLOY AB-B	10,882	202.800	2,206,869.600	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	341.200	323,457.600	
	LUNDIN PETROLEUM AB	1,900	266.500	506,350.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,747	296.000	1,997,112.000	
	BOLIDEN AB	3,171	225.450	714,901.950	
	EPIROC AB-A	6,982	91.020	635,501.640	
	EPIROC AB-B	2,500	88.170	220,425.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,400	86.880	208,512.000	
	NORDEA BANK ABP	33,957	69.290	2,352,880.530	
	KINNEVIK AB - B	1,500	242.100	363,150.000	
	HEXAGON AB-B SHS	2,400	482.100	1,157,040.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	201.300	261,690.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 35,223,485.700 (403,308,911)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	18,461	340.500	6,285,970.500	
	DANSKE BANK A/S	7,236	109.600	793,065.600	
	ISS A/S	1,320	192.850	254,562.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	30	6,885.000	206,550.000	
	H LUNDBECK A/S	500	253.900	126,950.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,857	569.000	1,056,633.000	
	CARLSBERG AS-B	1,232	880.000	1,084,160.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,802	305.000	549,610.000	
	COLOPLAST-B	1,052	751.200	790,262.400	
	DSV A/S	1,650	619.800	1,022,670.000	
	DEMANT A/S	1,314	216.600	284,612.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	7,258.000	479,028.000	
	TRYG A/S	1,700	218.000	370,600.000	
	PANDORA A/S	750	220.700	165,525.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	735.000	927,570.000	
	GENMAB A/S	733	1,179.000	864,207.000	
	ORSTED A/S	2,276	566.800	1,290,036.800	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 16,552,012.700 (270,128,847)	

ニュージーランド 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	4.485	67,275.000	
	A2 MILK CO LTD	7,000	14.850	103,950.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	3.875	65,332.500	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,100	9.020	73,062.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	14,526	5.430	78,876.180	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	3,700	15.070	55,759.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	11.650	51,481.350		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ド ル 495,736.030 (35,008,879)	
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	30.920	403,506.000	
	DNB ASA	8,545	150.550	1,286,449.750	
	ORKLA ASA	7,000	76.140	532,980.000	
	TELENOR ASA	8,746	189.050	1,653,431.300	
	EQUINOR ASA	11,121	169.950	1,890,013.950	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,450	406.500	589,425.000	
	MOWI ASA	4,677	205.300	960,188.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	175.100	350,200.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	225.000	382,500.000	
AKER BP ASA	1,306	226.200	295,417.200		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 8,344,111.300 (104,217,949)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	9,157	52.850	483,947.450	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	24.310	43,758.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,967	6.027	138,422.100	
	COMMERZBANK AG	9,689	6.113	59,228.850	
	VOLKSWAGEN AG	420	144.100	60,522.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	1,774	141.240	250,559.760	
	SIEMENS AG-REG	7,545	104.020	784,830.900	
	E.ON SE	22,270	9.935	221,252.450	
	UNIPER SE	1,380	26.290	36,280.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,921	62.460	182,445.660		

GEA GROUP AG	1,300	25.050	32,565.000
CONTINENTAL AG	1,180	124.400	146,792.000
BASF SE	9,106	60.480	550,730.880
ALLIANZ SE-REG	3,842	207.400	796,830.800
THYSSENKRUPP AG	4,030	11.770	47,433.100
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,857	88.480	164,307.360
RWE AG	5,309	22.850	121,310.650
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	17.690	30,073.000
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	560	76.180	42,660.800
BRENNTAG AG	1,436	42.240	60,656.640
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,709	46.130	171,096.170
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	31.650	30,352.350
HOCHTIEF AG	166	106.600	17,695.600
SAP SE	9,365	113.540	1,063,302.100
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,415	221.600	313,564.000
ZALANDO SE	2,025	37.790	76,524.750
HEIDELBERGCEMENT AG	2,128	68.800	146,406.400
KION GROUP AG	600	52.480	31,488.000
WIRECARD AG	1,027	149.450	153,485.150
COVESTRO AG	1,945	41.760	81,223.200
INNOGY SE	1,500	41.320	61,980.000
SARTORIUS AG-VORZUG	305	177.700	54,198.500
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,265	56.180	71,067.700
DELIVERY HERO SE	1,056	37.590	39,695.040
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	89.550	50,148.000
METRO AG	1,500	15.065	22,597.500
1&1 DRILLISCH AG	500	27.360	13,680.000
AROUNDTOWN SA	8,042	7.684	61,794.720
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,500	36.610	54,915.000
KNORR-BREMSE AG	549	99.100	54,405.900
BEIERSDORF AG	1,275	106.950	136,361.250
FUCHS PETROLUB SE -PREF	700	34.860	24,402.000
MERCK KGAA	1,149	91.800	105,478.200
ADIDAS AG	1,791	260.600	466,734.600
PUMA SE	510	54.450	27,769.500
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	82.600	108,288.600
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	31,856	15.390	490,263.840

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,271	66.700	151,475.700
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	8,792	47.420	416,916.640
QIAGEN N.V.	2,521	35.240	88,840.040
INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,044	14.390	187,703.160
HANNOVER RUECK SE	644	140.200	90,288.800
DEUTSCHE POST AG-REG	8,974	27.380	245,708.120
DEUTSCHE BOERSE AG	1,897	125.700	238,452.900
LANXESS AG	600	45.700	27,420.000
MTU AERO ENGINES AG	444	198.700	88,222.800
AXEL SPRINGER SE	470	62.200	29,234.000
DEUTSCHE WOHNEN SE	3,285	37.000	121,545.000
SYMRISE AG	1,436	88.280	126,770.080
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.475	15,444.000
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	900	53.200	47,880.000
HUGO BOSS AG -ORD	811	54.700	44,361.700
RTL GROUP	350	44.220	15,477.000
VONOVIA SE	4,637	46.050	213,533.850
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,309	36.665	341,314.480
NN GROUP NV	3,100	35.130	108,903.000
ARCELORMITTAL	8,031	14.572	117,027.730
UNILEVER NV-CVA	14,043	54.590	766,607.370
HEINEKEN NV	2,910	96.420	280,582.200
AEGON NV	14,361	4.194	60,230.030
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	10,652	20.575	219,164.900
AKZO NOBEL N.V.	2,504	82.090	205,553.360
KONINKLIJKE DSM NV	1,938	107.250	207,850.500
WOLTERS KLUWER	3,097	64.340	199,260.980
ING GROEP NV	36,440	9.821	357,877.240
KONINKLIJKE KPN NV	36,000	2.837	102,132.000
ASML HOLDING NV	4,223	171.040	722,301.920
ABN AMRO GROUP NV-CVA	3,453	18.815	64,968.190
ADYEN NV	77	700.200	53,915.400
VOPAK	630	39.080	24,620.400
RANDSTAD NV	998	48.210	48,113.580
HEINEKEN HOLDING NV	1,100	89.500	98,450.000

JCDECAUX SA	845	26.280	22,206.600	
TOTAL SA	23,014	47.250	1,087,411.500	
MICHELIN (CGDE)	1,861	109.900	204,523.900	
AIR LIQUIDE SA	3,938	118.750	467,637.500	
KERING	708	486.450	344,406.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,224	75.060	392,113.440	
BOUYGUES SA	1,892	31.440	59,484.480	
BNP PARIBAS	10,986	40.860	448,887.960	
PEUGEOT SA	6,497	20.720	134,617.840	
NATIXIS	7,674	3.857	29,598.610	
THALES SA	918	105.450	96,803.100	
DANONE	5,853	72.520	424,459.560	
CARREFOUR SA	5,156	17.110	88,219.160	
SUEZ	2,950	12.575	37,096.250	
VIVENDI	8,495	24.480	207,957.600	
L'OREAL	2,533	248.000	628,184.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,849	33.265	194,566.980	
LEGRAND SA	2,250	62.540	140,715.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	200	32.600	6,520.000	
PERNOD RICARD SA	2,154	157.850	340,008.900	
SOCIETE BIC SA	150	67.600	10,140.000	
EURAZEO SE	560	61.650	34,524.000	
SOCIETE GENERALE SA	8,065	21.235	171,260.270	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,715	354.000	961,110.000	
ACCOR SA	1,850	34.800	64,380.000	
CAPGEMINI SE	1,645	97.160	159,828.200	
VALEO SA	1,965	24.300	47,749.500	
PUBLICIS GROUPE	1,806	50.000	90,300.000	
BUREAU VERITAS SA	3,227	21.300	68,735.100	
EIFFAGE	750	85.460	64,095.000	
SODEXO SA	763	104.250	79,542.750	
IPSEN	276	114.700	31,657.200	
INGENICO GROUP	499	76.720	38,283.280	
AMUNDI SA	437	59.100	25,826.700	
TELEPERFORMANCE	500	173.900	86,950.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	68.040	66,475.080	
FAURECIA	560	35.340	19,790.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	131	360.000	47,160.000	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	399	129.300	51,590.700	
SEB SA	197	151.100	29,766.700	
ESSILORLUXOTTICA	2,731	106.400	290,578.400	
DASSAULT AVIATION SA	22	1,200.000	26,400.000	
WORLDLINE SA	1,330	61.000	81,130.000	
AXA SA	18,578	22.610	420,048.580	
EDENRED	1,913	42.960	82,182.480	
RENAULT SA	2,554	55.740	142,359.960	
HERMES INTERNATIONAL	268	612.200	164,069.600	
STMICROELECTRONICS NV	7,498	14.140	106,021.720	
REMY COINTREAU	253	115.200	29,145.600	
ATOS SE	946	71.480	67,620.080	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,149	137.000	157,413.000	
WENDEL	201	117.400	23,597.400	
ORANGE	20,492	13.820	283,199.440	
ALSTOM	1,310	41.510	54,378.100	
CNP ASSURANCES	1,349	19.790	26,696.710	
SANOFI	10,967	75.980	833,272.660	
VINCI SA	5,021	89.580	449,781.180	
AIRBUS SE	5,688	122.420	696,324.960	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,973	21.250	148,176.250	
CREDIT AGRICOLE SA	9,904	10.295	101,961.680	
BIOMERIEUX	457	74.800	34,183.600	
ENGIE	17,413	12.955	225,585.410	
IMERYS SA	340	44.600	15,164.000	
EDF	6,760	11.780	79,632.800	
SES	4,402	14.300	62,948.600	
SAFRAN SA	3,133	122.900	385,045.700	
ILIAD SA	219	101.500	22,228.500	
ARKEMA	838	76.280	63,922.640	
ADP	350	153.500	53,725.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,400	16.340	22,876.000	
SCOR SE	1,297	38.810	50,336.570	
GETLINK SE	3,940	13.820	54,450.800	
BOLLORE	7,300	3.912	28,557.600	
UCB SA	1,110	70.400	78,144.000	
KBC GROUP NV	3,011	57.800	174,035.800	
COLRUYT SA	350	62.480	21,868.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	900	85.000	76,500.000	

SOLVAY SA	873	86.760	75,741.480	
UMICORE	1,600	26.910	43,056.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	7,221	75.380	544,318.980	
AGEAS	1,654	44.020	72,809.080	
PROXIMUS	2,269	26.120	59,266.280	
TELENET GROUP HOLDING NV	462	49.140	22,702.680	
PRYSMIAN SPA	1,440	16.930	24,379.200	
ASSICURAZIONI GENERALI	11,733	16.135	189,311.950	
MEDIOBANCA SPA	4,460	8.526	38,025.960	
TENARIS SA	4,700	10.800	50,760.000	
UNICREDIT SPA	21,147	10.130	214,219.110	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.458	49,705.220	
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.442	21,408.590	
INTESA SANPAOLO	135,457	1.837	248,888.690	
ATLANTIA SPA	6,027	23.420	141,152.340	
POSTE ITALIANE SPA	2,900	9.268	26,877.200	
MONCLER SPA	1,522	35.050	53,346.100	
RECORDATI SPA	692	37.050	25,638.600	
ENI SPA	24,898	13.944	347,177.710	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	4,483	8.760	39,271.080	
PIRELLI & C SPA	5,651	5.292	29,905.090	
LEONARDO SPA	2,500	10.780	26,950.000	
ENEL SPA	79,795	6.070	484,355.650	
SNAM SPA	24,300	4.718	114,647.400	
TERNA SPA	19,900	5.766	114,743.400	
EXOR NV	1,088	59.200	64,409.600	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	8.430	98,555.130	
FINECOBANK SPA	5,972	9.046	54,022.710	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	10,787	11.840	127,718.080	
FERRARI NV	1,130	136.000	153,680.000	
TELEFONICA SA	45,990	7.444	342,349.560	
ENDESA SA	2,150	23.790	51,148.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	60,432	4.878	294,817.510	
IBERDROLA SA	56,028	8.958	501,898.820	
BANCO DE SABADELL SA	49,634	0.919	45,653.350	
BANKINTER SA	6,700	6.154	41,231.800	
REPSOL SA	14,200	14.300	203,060.000	

GRIFOLS SA	3,004	24.210	72,726.840	
BANCO SANTANDER SA	159,897	3.954	632,312.680	
AMADEUS IT GROUP SA	4,311	68.100	293,579.100	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,978	25.440	101,200.320	
MAPFRE SA	8,005	2.637	21,109.180	
CAIXABANK SA	46,859	2.577	120,755.640	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,195	37.270	81,807.650	
AENA SME SA	569	173.200	98,550.800	
CELLNEX TELECOM SA	2,096	32.070	67,218.720	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	9,655	25.000	241,375.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	1,793	14.825	26,581.220	
ENAGAS SA	3,675	25.010	91,911.750	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,056	19.375	78,585.000	
FERROVIAL SA	6,346	22.140	140,500.440	
BANKIA SA	15,905	2.146	34,132.130	
UPM-KYMMENE OYJ	4,493	23.220	104,327.460	
NOKIA OYJ	54,437	4.386	238,760.680	
WARTSILA OYJ ABP	4,116	12.855	52,911.180	
STORA ENSO OYJ-R SHS	4,193	9.418	39,489.670	
METSO OYJ	1,108	31.910	35,356.280	
ELISA OYJ	1,300	42.100	54,730.000	
SAMPO OYJ-A SHS	3,832	40.590	155,540.880	
FORTUM OYJ	4,400	19.145	84,238.000	
KONE OYJ-B	3,860	50.100	193,386.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,770	26.570	47,028.900	
NESTE OYJ	4,849	30.870	149,688.630	
ORION OYJ-CLASS B	1,763	31.430	55,411.090	
VERBUND AG	240	45.860	11,006.400	
OMV AG	1,209	42.090	50,886.810	
ERSTE GROUP BANK AG	2,750	32.070	88,192.500	
VOESTALPINE AG	1,800	24.160	43,488.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	21.450	23,595.000	
ANDRITZ AG	550	31.320	17,226.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,995	26.600	53,067.000	
AIB GROUP PLC	9,000	3.584	32,256.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,234	4.630	47,383.420	

	KINGSPAN GROUP PLC	1,600	46.540	74,464.000	
	JERONIMO MARTINS	2,900	14.385	41,716.500	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	27,576	3.442	94,916.590	
	GALP ENERGIA SGPS SA	3,609	13.150	47,458.350	
	KERRY GROUP PLC-A	1,712	106.200	181,814.400	
	CRH PLC	8,012	28.360	227,220.320	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	889	65.920	58,602.880	
ユーロ 小計				ユーロ 36,893,531.680 (4,496,214,706)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	56.200	814,900.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	22,000	48.500	1,067,000.000	
	MTR CORP	16,500	49.350	814,275.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16,000	125.900	2,014,400.000	
	SINO LAND CO	34,000	12.500	425,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	27,052	75.100	2,031,605.200	
	WHARF HOLDINGS LTD	8,000	20.200	161,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	3,500	93.800	328,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	19,000	89.050	1,691,950.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	40.300	828,769.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	118,035	17.180	2,027,841.300	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	194.200	1,747,800.000	
	WHEELOCK & CO LTD	6,000	52.700	316,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	58,000	11.500	667,000.000	
	WH GROUP LTD	91,500	7.350	672,525.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	11,900	260.400	3,098,760.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	12,000	17.220	206,640.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	2,000	73.050	146,100.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	8,000	21.400	171,200.000	
	NWS HOLDINGS LTD	15,000	15.560	233,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	7,500	30.900	231,750.000	
	BANK OF EAST ASIA LTD	8,600	21.950	188,770.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	6,000	39.600	237,600.000	
	SJM HOLDINGS LTD	10,000	8.200	82,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	31.600	252,800.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	30,552	58.900	1,799,512.800	

CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	63.000	346,500.000	
PCCW LTD	60,000	4.560	273,600.000	
AIA GROUP LTD	129,200	73.800	9,534,960.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14,000	51.900	726,600.000	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	12,000	46.450	557,400.000	
SANDS CHINA LTD	23,000	36.000	828,000.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	4,000	9.450	37,800.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,000	55.300	663,600.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	14,000	12.060	168,840.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	39,000	30.200	1,177,800.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	16.000	268,800.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 36,841,598.800 (510,992,976)	
合計			38,411,435,543 [38,411,435,543]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,372	285,499.480	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,053	497,394.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,556	210,371.200	
		VORNADO REALTY TRUST	2,128	140,873.600	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,055	238,957.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,248	332,448.480	
		EQUINIX INC	817	416,604.640	
		AMERICAN TOWER CORP	4,318	912,091.140	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,228	114,034.680	
		KIMCO REALTY CORP	3,300	61,809.000	
		INVITATION HOMES INC	2,200	60,082.000	
		VENTAS INC	3,702	247,145.520	
		WEYERHAEUSER CO	7,435	191,153.850	
		AGNC INVESTMENT CORP	4,334	73,157.920	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,153	553,636.430	
IRON MOUNTAIN INC	3,474	110,230.020			
VEREIT INC	13,632	129,912.960			

	SUN COMMUNITIES INC	843	108,848.160	
	PROLOGIS INC	6,353	507,985.880	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,200	181,560.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	650	69,004.000	
	DUKE REALTY CORP	3,100	98,425.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	600	179,514.000	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	974	129,678.360	
	WELLTOWER INC	3,797	312,417.160	
	HCP INC	4,550	146,146.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,000	50,240.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,100	129,569.000	
	MACERICH CO/THE	700	24,171.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	975	120,929.250	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	142,563.840	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	85,794.560	
	REALTY INCOME CORP	2,550	186,838.500	
	PUBLIC STORAGE	1,540	374,697.400	
	REGENCY CENTERS CORP	1,150	79,200.500	
	SL GREEN REALTY CORP	650	56,901.000	
	UDR INC	2,965	137,694.600	
	WP CAREY INC	1,600	136,800.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,269	271,735.440	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,285	138,857.100	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 8,244,973.930 (895,898,867)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	86,642.720	
	SEGRO PLC	13,286	95,526.340	
	BRITISH LAND CO PLC	14,580	78,615.360	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 260,784.420 (35,662,269)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	4,303	55,939.000	
	TRANSURBAN GROUP	26,027	377,651.770	
	SYDNEY AIRPORT	9,129	70,658.460	
	APA GROUP	14,243	159,094.310	

	SCENTRE GROUP	43,529	163,669.040	
	DEXUS	13,949	190,264.360	
	GPT GROUP	14,648	90,378.160	
	MIRVAC GROUP	31,638	101,557.980	
	STOCKLAND	18,729	81,658.440	
	GOODMAN GROUP	14,731	215,809.150	
	VICINITY CENTRES	19,523	50,369.340	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,557,050.010 (116,358,347)	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,000	45,460.000	カナダ・ドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	37,576.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 83,036.000 (6,725,916)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28,000	57,680.000	シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	90,890.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	9,000	23,400.000	
	SUNTEC REIT	26,000	49,140.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 221,110.000 (17,525,178)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,249	169,676.650	ユーロ
	ICADE	406	32,480.000	
	GECINA SA	334	44,756.000	
	KLEPIERRE	2,394	70,934.220	
	COVIVIO	353	33,517.350	
ユーロ 小計			ユーロ 351,364.220 (42,820,758)	
香港・ドル	LINK REIT	24,000	2,300,400.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000	405,600.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000	426,360.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 3,132,360.000	

			(43,445,833)	
投資証券	合計		1,158,437,168	[1,158,437,168]
合計			1,158,437,168	[1,158,437,168]

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 615銘柄 投資証券 40銘柄	96.7%	3.3%	68.5%
イギリス・ポンド	株式 94銘柄 投資証券 3銘柄	98.5%	1.5%	6.2%
イスラエル・シケル	株式 7銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 55銘柄 投資証券 11銘柄	88.8%	11.2%	2.6%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.5%	0.5%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資証券 4銘柄	90.9%	9.1%	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 7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式 239銘柄 投資証券 5銘柄	99.1%	0.9%	11.5%
香港・ドル	株式 37銘柄 投資証券 3銘柄	92.2%	7.8%	1.4%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	319,981	-
コール・ローン	29,135,210	12,043,433
親投資信託受益証券	3,307,217,683	4,523,081,433
未収入金	33,874,800	1,310,000
流動資産合計	3,370,547,674	4,536,434,866
資産合計	3,370,547,674	4,536,434,866
負債の部		
流動負債		
未払解約金	56,883,038	4,273,865
未払受託者報酬	303,548	427,926
未払委託者報酬	5,844,193	8,238,530
その他未払費用	75,927	107,967
流動負債合計	63,106,706	13,048,288
負債合計	63,106,706	13,048,288
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,374,174,372	1 3,228,404,217
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	933,266,596	1,294,982,361
（分配準備積立金）	323,805,814	299,344,530
元本等合計	3,307,440,968	4,523,386,578
純資産合計	3,307,440,968	4,523,386,578
負債純資産合計	3,370,547,674	4,536,434,866

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年6月16日 至 2018年6月15日	自	2018年6月16日 至 2019年6月17日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		313,058,979		68,766,650
営業収益合計		313,058,979		68,766,651
営業費用				
支払利息		2,326		5,617
受託者報酬		519,493		808,608
委託者報酬		10,002,070		15,567,469
その他費用		129,908		202,482
営業費用合計		10,653,797		16,584,176
営業利益		302,405,182		52,182,475
経常利益		302,405,182		52,182,475
当期純利益		302,405,182		52,182,475
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		37,341,724		5,385,900
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		313,857,571		933,266,596
剰余金増加額又は欠損金減少額		455,818,368		575,430,718
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		455,818,368		575,430,718
剰余金減少額又は欠損金増加額		101,472,801		260,511,528
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		101,472,801		260,511,528
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		933,266,596		1,294,982,361

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第3期	
	自 2018年6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	1,405,993,525円	2,374,174,372円
期中追加設定元本額	1,380,206,909円	1,523,438,524円
期中一部解約元本額	412,026,062円	669,208,679円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,374,174,372口	3,228,404,217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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(265,065,250円)、投資信託約款に規定される収益調整金(609,462,931円)及び分配準備積立金(58,740,564円)より分配対象額は933,268,745円(1万口当たり3,930.92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(46,799,914円)、投資信託約款に規定される収益調整金(995,642,847円)及び分配準備積立金(252,544,616円)より分配対象額は1,294,987,377円(1万口当たり4,011.23円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	288,341,601	64,783,772
合計	288,341,601	64,783,772

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3931円 (13,931円)	1.4011円 (14,011円)
---------------------------	----------------------	----------------------

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	1,805,981,806	4,523,081,433	
親投資信託受益証券 合計			4,523,081,433	
合計			4,523,081,433	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金	541,972,936	1,178,453,239
金銭信託	1,966,937	-
コール・ローン	179,095,653	278,740,028
株式	99,506,241,962	107,829,712,844
投資証券	2,485,300,663	3,214,011,606
派生商品評価勘定	2,128,170	13,899,411
未収入金	434,216	3,677,222
未収配当金	190,403,446	193,387,984
差入委託証拠金	796,508,844	523,224,081
流動資産合計	103,704,052,827	113,235,106,415
資産合計	103,704,052,827	113,235,106,415
負債の部		
流動負債		
未払金	39,376,579	676,538,686
未払解約金	96,396,300	9,373,300
その他未払費用	4,294	-
流動負債合計	135,777,173	685,911,986
負債合計	135,777,173	685,911,986
純資産の部		
元本等		
元本	1	44,938,531,796
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	61,792,328,516	67,610,662,633
元本等合計	103,568,275,654	112,549,194,429
純資産合計	103,568,275,654	112,549,194,429
負債純資産合計	103,704,052,827	113,235,106,415

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6月16日 至 2019年6月17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>

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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	39,756,964,781円	41,775,947,138円
期中追加設定元本額	6,670,399,883円	6,764,304,685円
期中一部解約元本額	4,651,417,526円	3,601,720,027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	516,700,593円	464,023,812円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	16,429,883円	12,197,180円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	229,429,617円	165,854,025円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	27,312,346円	19,605,630円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	734,645,896円	536,545,354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)	- 円	3,097,423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)	548,554,400円	555,335,842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)	1,334,039,645円	1,805,981,806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)	488,855,095円	537,785,213円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	1,010,873円	6,557,900円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	195,844円	493,277円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	534,842,007円	905,383,641円
i F r e e 8資産バランス	401,816,816円	683,566,181円
i F r e e 年金バランス	- 円	18,023,500円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	25,684,078,835円	28,406,470,539円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	542,582,707円	566,909,665円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	767,007,247円	846,970,888円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	622,100,357円	648,553,039円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,470,100,006円	1,486,105,064円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2020	4,277,573円	3,399,663円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,987,127円	13,174,854円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,783,334円	4,250,389円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	- 円	64,183,977円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	- 円	39,782円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	- 円	79,563円

ダイワつみたてインデックス バランス70	- 円	99,454円
ダイワ世界分散バランスファ ンド15VA	76,716円	73,565円
ダイワ世界分散バランスファ ンド20VA	157,568円	151,649円
ダイワ世界分散バランスファ ンド25VA	668,959円	1,162,691円
ダイワ世界分散バランスファ ンド30VA	2,223,951円	1,725,194円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	323,855,425円	205,401,310円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	378,861,282円	345,545,113円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	3,419,943,699円	2,865,699,348円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	169,136,819円	147,509,273円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	591,527,140円	663,098,757円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	62,177,536円	108,076,802円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	463,548円	6,619,723円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,735,785,564円	2,695,843,941円
ダイワライフスタイル25	19,963,541円	19,225,455円
ダイワライフスタイル50	70,913,871円	67,902,980円
ダイワライフスタイル75	59,441,318円	55,808,334円
計	41,775,947,138円	44,938,531,796円
2. 期末日における受益権の総数	41,775,947,138口	44,938,531,796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6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	4,300,033,310	5,887,925,688
投資証券	97,623,755	336,561,445
合計	4,202,409,555	6,224,487,133

(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6月15日まで、及び2018年12月1日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110	1,478,267,686	-	1,491,888,217	13,620,531
合計	1,542,242,790	-	1,543,155,900	913,110	1,478,267,686	-	1,491,888,217	13,620,531

(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

	2018年6月15日 現在	2019年6月17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								
買建	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060	260,121,120	-	260,400,000	278,880
アメリカ・ドル	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060	260,121,120	-	260,400,000	278,880
合計	98,243,940	-	99,459,000	1,215,060	260,121,120	-	260,400,000	278,880

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.4791円	2.5045円
(1万口当たり純資産額)	(24,791円)	(25,045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	3,050	130.150	396,957.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	2,500	203.290	508,225.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5,150	83.830	431,724.500	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,600	130.430	208,688.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,600	33.950	597,520.000	
	ABBOTT LABORATORIES	48,116	82.220	3,956,097.520	
	ARCONIC INC	11,333	22.980	260,432.340	
	VERISK ANALYTICS INC	4,150	145.830	605,194.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	10,500	57.280	601,440.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	8,200	94.300	773,260.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,829	121.400	1,071,840.600	
	QORVO INC	3,400	61.500	209,100.000	
	AFLAC INC	20,250	55.040	1,114,560.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	3,400	119.680	406,912.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3,900	63.990	249,561.000	
	ADOBE INC	13,400	274.280	3,675,352.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,450	46.000	296,700.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	3,050	176.710	538,965.500	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	10,000	16.340	163,400.000	
	GARMIN LTD	3,650	79.790	291,233.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,980	219.250	1,311,115.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	20,050	172.810	3,464,840.500	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	4,471	127.270	569,024.170	
	WR BERKLEY CORP	3,825	65.620	250,996.500	
	AUTOZONE INC	670	1,119.870	750,312.900	
	DOLLAR TREE INC	6,321	110.310	697,269.510	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	30,900	8.240	254,616.000	
	PINNACLE WEST CAPITAL	2,950	97.480	287,566.000	
	CELANESE CORP	3,550	104.190	369,874.500	
	DR HORTON INC	9,416	45.960	432,759.360	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	2,450	36.720	89,964.000	
	DENTSPLY SIRONA INC	5,900	56.770	334,943.000	
	AUTODESK INC	5,950	158.160	941,052.000	

MOODY'S CORP	4,650	192.300	894,195.000	
DEVON ENERGY CORP	12,850	25.770	331,144.500	
ALBEMARLE CORP	2,800	70.880	198,464.000	
ATMOS ENERGY CORP	3,050	104.990	320,219.500	
ALLIANT ENERGY CORP	6,250	50.000	312,500.000	
CITIGROUP INC	65,573	67.480	4,424,866.040	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	11,800	165.540	1,953,372.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	13,350	90.580	1,209,243.000	
ALLEGHANY CORP	410	690.850	283,248.500	
DOMINO'S PIZZA INC	1,100	280.650	308,715.000	
HESS CORP	7,200	57.250	412,200.000	
DAVITA INC	3,500	48.880	171,080.000	
DANAHER CORP	17,200	139.630	2,401,636.000	
FORTIVE CORP	8,200	77.330	634,106.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	15,550	84.930	1,320,661.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4,900	27.070	132,643.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4,728	23.850	112,762.800	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	15,100	40.790	615,929.000	
BUNGE LTD	4,000	57.860	231,440.000	
TE CONNECTIVITY LTD	9,425	90.660	854,470.500	
APPLE INC	129,000	192.740	24,863,460.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	8,900	77.450	689,305.000	
BOEING CO/THE	14,740	347.160	5,117,138.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	4,215	103.540	436,421.100	
BECTON DICKINSON AND CO	7,449	234.160	1,744,257.840	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	20.040	134,268.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	3,850	78.840	303,534.000	
CDK GLOBAL INC	3,200	48.590	155,488.000	
NISOURCE INC	10,150	28.750	291,812.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3,850	83.700	322,245.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,421	44.490	1,175,470.290	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	112,204	58.280	6,539,249.120	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	35,500	205.160	7,283,180.000	
ANSYS INC	2,250	197.130	443,542.500	
H&R BLOCK INC	5,800	28.690	166,402.000	
BB&T CORP	20,750	50.060	1,038,745.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	44,750	47.560	2,128,310.000	

JPMORGAN CHASE & CO	89,270	109.820	9,803,631.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	6,650	105.940	704,501.000	
LKQ CORP	8,500	26.240	223,040.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,150	178.670	205,470.500	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,562	56.260	481,698.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	7,850	67.720	531,602.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3,810	153.530	584,949.300	
DOLLAR GENERAL CORP	7,200	135.690	976,968.000	
SERVICENOW INC	5,010	272.250	1,363,972.500	
CATERPILLAR INC	16,000	127.230	2,035,680.000	
CMS ENERGY CORP	7,700	58.750	452,375.000	
MOSAIC CO/THE	9,750	22.360	218,010.000	
DELTA AIR LINES INC	4,750	55.990	265,952.500	
CORNING INC	22,000	30.910	680,020.000	
CISCO SYSTEMS INC	121,050	54.750	6,627,487.500	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3,700	62.090	229,733.000	
MORGAN STANLEY	35,450	42.820	1,517,969.000	
WABCO HOLDINGS INC	1,400	130.790	183,106.000	
MSCI INC	2,450	235.780	577,661.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,000	275.840	275,840.000	
MIDDLEBY CORP	1,450	131.100	190,095.000	
COTY INC-CL A	13,539	13.580	183,859.620	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6,050	56.580	342,309.000	
BROADCOM INC	11,072	265.930	2,944,376.960	
ACUITY BRANDS INC	1,150	133.500	153,525.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,430	70.030	170,172.900	
ARAMARK	6,450	34.470	222,331.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,050	26.080	157,784.000	
DTE ENERGY COMPANY	4,950	129.540	641,223.000	
CENTENE CORP	11,550	53.550	618,502.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,000	107.740	323,220.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	12,900	34.970	451,113.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	5,000	87.700	438,500.000	
GARTNER INC	2,500	158.580	396,450.000	
SPLUNK INC	4,000	118.240	472,960.000	
DOMINION ENERGY INC	21,841	76.660	1,674,331.060	
MONSTER BEVERAGE CORP	11,100	61.330	680,763.000	
SMITH (A.O.) CORP	4,150	45.530	188,949.500	
DEERE & CO	8,250	151.510	1,249,957.500	

GLOBAL PAYMENTS INC	4,250	158.810	674,942.500	
VMWARE INC-CLASS A	2,300	168.290	387,067.000	
CHEMOURS CO/THE	4,550	23.840	108,472.000	
BURLINGTON STORES INC	1,900	168.690	320,511.000	
NASDAQ INC	3,150	95.710	301,486.500	
VAIL RESORTS INC	1,120	235.980	264,297.600	
EAST WEST BANCORP INC	4,100	44.250	181,425.000	
TARGA RESOURCES CORP	5,850	36.590	214,051.500	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,800	153.450	276,210.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,980	104.430	206,771.400	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1,050	63.760	66,948.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	8,950	88.540	792,433.000	
COGNEX CORP	4,550	43.690	198,789.500	
TELEFLEX INC	1,230	320.240	393,895.200	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,300	90.850	208,955.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	1,400	287.100	401,940.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	3,350	164.630	551,510.500	
IDEX CORP	2,100	159.680	335,328.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	22,300	73.350	1,635,705.000	
ROLLINS INC	3,825	37.650	144,011.250	
AMETEK INC	6,175	84.990	524,813.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,500	77.160	501,540.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	3,650	32.220	117,603.000	
HEICO CORP	1,200	126.170	151,404.000	
XPO LOGISTICS INC	3,450	56.740	195,753.000	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,000	163.250	326,500.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,050	296.330	311,146.500	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,900	86.500	769,850.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	12,000	260.150	3,121,800.000	
GRUBHUB INC	2,600	70.160	182,416.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,500	174.500	261,750.000	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	1,500	88.360	132,540.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	740	740.590	548,036.600	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	8,350	17.980	150,133.000	
UGI CORP	4,600	53.050	244,030.000	

CUMMINS INC	4,050	163.860	663,633.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	21,050	45.620	960,301.000	
SABRE CORP	7,650	22.290	170,518.500	
CDW CORP/DE	4,050	104.240	422,172.000	
SIGNATURE BANK	1,500	116.300	174,450.000	
COSTAR GROUP INC	970	549.660	533,170.200	
SVB FINANCIAL GROUP	1,490	218.180	325,088.200	
AMERCO	220	389.060	85,593.200	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,650	142.040	234,366.000	
MERCADOLIBRE INC	1,170	616.000	720,720.000	
HANESBRANDS INC	9,500	16.590	157,605.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,100	137.810	289,401.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	7,416	93.420	692,802.720	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	5,350	15.900	85,065.000	
IPG PHOTONICS CORP	1,020	131.940	134,578.800	
DEXCOM INC	2,450	148.040	362,698.000	
COPART INC	5,850	73.810	431,788.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	4,250	98.950	420,537.500	
SEATTLE GENETICS INC	2,900	68.500	198,650.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,070	305.700	632,799.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,280	472.860	605,260.800	
NIELSEN HOLDINGS PLC	9,900	23.060	228,294.000	
KINDER MORGAN INC	56,081	20.530	1,151,342.930	
HCA HEALTHCARE INC	7,350	126.630	930,730.500	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,050	320.050	336,052.500	
CABOT OIL & GAS CORP	12,050	23.770	286,428.500	
T-MOBILE US INC	9,500	74.900	711,550.000	
ZILLOW GROUP INC - C	3,450	45.390	156,595.500	
COCA-COLA CO/THE	110,600	51.310	5,674,886.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	5,750	56.740	326,255.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	4,850	73.970	358,754.500	
EATON VANCE CORP	3,050	41.340	126,087.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	8,650	33.360	288,564.000	
CSX CORP	21,450	77.170	1,655,296.500	
FLUOR CORP	3,650	29.310	106,981.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	2,780	166.390	462,564.200	
EXPEDIA GROUP INC	3,425	126.810	434,324.250	

AUTOLIV INC	2,400	65.980	158,352.000	
AMAZON.COM INC	11,430	1,869.670	21,370,328.100	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6,650	17.050	113,382.500	
FLOWSERVE CORP	3,550	48.760	173,098.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,650	183.930	1,039,204.500	
EXXON MOBIL CORP	116,055	74.350	8,628,689.250	
FLIR SYSTEMS INC	3,750	51.120	191,700.000	
AES CORP	18,400	17.090	314,456.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	2,200	246.760	542,872.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,120	251.050	281,176.000	
EOG RESOURCES INC	15,650	85.170	1,332,910.500	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	4,450	78.620	349,859.000	
ABIOMED INC	1,170	250.960	293,623.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,250	85.050	361,462.500	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	8,740	69.970	611,537.800	
FORD MOTOR CO	107,123	9.980	1,069,087.540	
MACY'S INC	8,098	21.560	174,592.880	
DISCOVERY INC - A	3,990	29.020	115,789.800	
EXACT SCIENCES CORP	3,500	109.780	384,230.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	26.710	130,531.770	
DISCOVERY INC-C	10,089	26.840	270,788.760	
AERCAP HOLDINGS NV	3,400	48.780	165,852.000	
FORTINET INC	3,800	75.710	287,698.000	
MARKEL CORP	380	1,087.720	413,333.600	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	4,400	24.230	106,612.000	
NEXTERA ENERGY INC	13,000	206.960	2,690,480.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	40,608	10.650	432,475.200	
US BANCORP	41,650	52.620	2,191,623.000	
UNITED RENTALS INC	2,300	122.870	282,601.000	
F5 NETWORKS INC	1,600	136.930	219,088.000	
FASTENAL CO	15,400	31.650	487,410.000	
FISERV INC	10,600	89.200	945,520.000	
GENERAL ELECTRIC CO	238,950	10.230	2,444,458.500	
NEKTAR THERAPEUTICS	4,450	33.400	148,630.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	6,100	54.280	331,108.000	
GENERAL MOTORS CO	34,200	35.660	1,219,572.000	
TRIPADVISOR INC	2,750	45.550	125,262.500	
GENERAL DYNAMICS CORP	6,800	171.250	1,164,500.000	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,090	191.660	1,742,189.400	
ALPHABET INC-CL A	8,200	1,086.300	8,907,660.000	
ALPHABET INC-CL C	8,557	1,085.350	9,287,339.950	
OWENS CORNING	3,150	50.220	158,193.000	
GENERAL MILLS INC	16,350	53.410	873,253.500	
FIRSTENERGY CORP	14,668	43.970	644,951.960	
GENUINE PARTS CO	4,000	102.930	411,720.000	
IHS MARKIT LTD	10,734	59.320	636,740.880	
FIFTH THIRD BANCORP	22,600	27.390	619,014.000	
HARRIS CORP	3,250	190.600	619,450.000	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	3,000	32.680	98,040.000	
HALLIBURTON CO	23,400	21.380	500,292.000	
HOME DEPOT INC	30,950	205.770	6,368,581.500	
ASSURANT INC	1,750	106.120	185,710.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	29,400	13.360	392,784.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,190	214.790	255,600.100	
HERSHEY CO/THE	4,150	138.320	574,028.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	4,450	34.640	154,148.000	
HUMANA INC	3,730	251.830	939,325.900	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,400	90.890	854,366.000	
HELMERICH & PAYNE	2,900	48.400	140,360.000	
HENRY SCHEIN INC	4,050	71.280	288,684.000	
HP INC	43,300	19.910	862,103.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	39,400	14.150	557,510.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	4,800	36.720	176,256.000	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	40.300	189,410.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	5,450	36.540	199,143.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,500	36.490	91,225.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	11,150	35.560	396,494.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	18,653	30.310	565,372.430	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	24,450	135.150	3,304,417.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	10,700	42.990	459,993.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,000	54.010	216,040.000	
ZOETIS INC	13,050	110.790	1,445,809.500	

INGERSOLL-RAND PLC	6,579	124.680	820,269.720	
CHENIERE ENERGY INC	6,550	65.410	428,435.500	
ALLEGION PLC	2,450	106.020	259,749.000	
LEGGETT & PLATT INC	3,500	37.390	130,865.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	13,573	25.920	351,812.160	
WASTE CONNECTIONS INC	7,207	94.460	680,773.220	
JUNIPER NETWORKS INC	9,650	26.640	257,076.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,170	123.310	390,892.700	
JOHNSON & JOHNSON	73,000	140.090	10,226,570.000	
ABBVIE INC	40,329	78.690	3,173,489.010	
HOLOGIC INC	7,550	47.840	361,192.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	9,300	137.650	1,280,145.000	
KROGER CO	21,850	24.260	530,081.000	
KLA-TENCOR CORP	4,350	109.700	477,195.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	6,920	350.140	2,422,968.800	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,440	272.660	665,290.400	
L BRANDS INC	6,500	22.510	146,315.000	
LOWE'S COS INC	21,850	99.630	2,176,915.500	
ELI LILLY & CO	24,505	111.740	2,738,188.700	
LAM RESEARCH CORP	4,230	176.800	747,864.000	
JONES LANG LASALLE INC	1,250	133.130	166,412.500	
LOEWS CORP	7,900	53.540	422,966.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	5,799	63.480	368,120.520	
MCDONALD'S CORP	21,000	205.290	4,311,090.000	
3M CO	15,600	166.690	2,600,364.000	
FACEBOOK INC-CLASS A	65,150	181.330	11,813,649.500	
MANPOWERGROUP INC	1,780	90.800	161,624.000	
S&P GLOBAL INC	6,730	224.900	1,513,577.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,720	223.980	385,245.600	
CONCHO RESOURCES INC	5,450	98.360	536,062.000	
FIRST DATA CORP- CLASS A	16,050	26.570	426,448.500	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	5,850	32.600	190,710.000	
PHILLIPS 66	12,600	85.590	1,078,434.000	
TECHNIPFMC PLC	12,100	22.740	275,154.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	13,250	27.660	366,495.000	
DXC TECHNOLOGY CO	7,788	51.720	402,795.360	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,450	156.600	540,270.000	
MYLAN NV	13,750	17.020	234,025.000	
METLIFE INC	22,700	48.810	1,107,987.000	

MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	16,900	23.830	402,727.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,390	236.080	328,151.200	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,200	43.580	183,036.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	4,478	160.350	718,047.300	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	690	791.060	545,831.400	
BAKER HUGHES A GE CO	13,273	22.150	293,996.950	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,180	156.530	497,765.400	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	2,940	38.450	113,043.000	
MERCK & CO. INC.	70,771	82.780	5,858,423.380	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,718	75.080	1,555,507.440	
MASCO CORP	8,600	38.290	329,294.000	
M & T BANK CORP	3,569	167.900	599,235.100	
MARSH & MCLENNAN COS	13,700	98.180	1,345,066.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,100	100.670	211,407.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CLASS A	8,072	133.680	1,079,064.960	
WORKDAY INC-CLASS A	4,200	208.000	873,600.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,650	158.210	261,046.500	
SQUARE INC - A	9,050	71.590	647,889.500	
TRANSUNION	5,100	70.920	361,692.000	
VISTRA ENERGY CORP	10,050	23.770	238,888.500	
CAPRI HOLDINGS LTD	3,850	33.510	129,013.500	
WORLDPAY INC-CLASS A	8,250	123.160	1,016,070.000	
BEIGENE LTD-ADR	950	117.620	111,739.000	
NETAPP INC	6,850	60.980	417,713.000	
NIKE INC -CL B	34,300	83.440	2,861,992.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	7,320	194.740	1,425,496.800	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,400	83.190	532,416.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3,450	82.560	284,832.000	
ALLY FINANCIAL INC	11,450	29.210	334,454.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4,450	309.430	1,376,963.500	
APTIV PLC	7,300	75.330	549,909.000	
NEWMONT GOLDCORP CORP	22,461	35.930	807,023.730	
MCKESSON CORP	5,300	133.130	705,589.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	7,600	56.050	425,980.000	
XYLEM INC	4,800	81.080	389,184.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	42,650	77.200	3,292,580.000	

NUCOR CORP	8,700	51.700	449,790.000	
WESTERN UNION CO	11,746	20.090	235,977.140	
GODADDY INC - CLASS A	4,500	70.040	315,180.000	
NEWELL BRANDS INC	12,292	14.500	178,234.000	
EVERGY INC	6,900	60.670	418,623.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20,500	49.310	1,010,855.000	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	700	247.230	173,061.000	
OKTA INC	2,800	128.950	361,060.000	
LIBERTY BROADBAND-C	2,850	100.590	286,681.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,305	31.950	233,394.750	
LINDE PLC	15,146	202.710	3,070,245.660	
WIX.COM LTD	1,300	142.940	185,822.000	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	8,300	21.270	176,541.000	
KKR & CO INC -A	13,500	23.790	321,165.000	
PAYCHEX INC	8,800	86.680	762,784.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,200	387.960	853,512.000	
ALTRIA GROUP INC	51,350	50.860	2,611,661.000	
PFIZER INC	155,313	42.760	6,641,183.880	
ALKERMES PLC	4,000	21.890	87,560.000	
CIGNA CORP	10,530	158.410	1,668,057.300	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,101	51.320	210,463.320	
ALTICE USA INC- A	9,200	23.800	218,960.000	
XCEL ENERGY INC	13,700	60.030	822,411.000	
STERIS PLC	2,300	140.430	322,989.000	
FOX CORP - CLASS B	4,833	34.960	168,961.680	
FOX CORP - CLASS A	9,399	35.240	331,220.760	
STRYKER CORP	9,300	195.470	1,817,871.000	
DOW INC	20,718	51.150	1,059,725.700	
PARKER HANNIFIN CORP	3,500	164.210	574,735.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	5,200	43.230	224,796.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,700	141.580	665,426.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	1,550	89.600	138,880.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	68,067	111.200	7,569,050.400	
EXELON CORP	26,072	50.800	1,324,457.600	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	6,000	117.930	707,580.000	
NVR INC	90	3,459.620	311,365.800	
CONOCOPHILLIPS	31,300	58.820	1,841,066.000	
TWILIO INC - A	3,150	140.170	441,535.500	

DOCUSIGN INC	2,900	50.780	147,262.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,400	214.340	300,076.000	
PEPSICO INC	38,150	132.730	5,063,649.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,100	130.300	143,330.000	
DROPBOX INC-CLASS A	5,200	23.460	121,992.000	
MONGODB INC	900	165.680	149,112.000	
SNAP INC - A	19,000	13.960	265,240.000	
CORTEVA INC	20,718	25.190	521,886.420	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	11,000	99.230	1,091,530.000	
AMCOR PLC	13,500	10.930	147,555.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	4,850	118.270	573,609.500	
ACCENTURE PLC-CL A	17,450	184.970	3,227,726.500	
PENTAIR PLC	4,705	35.620	167,592.100	
QUALCOMM INC	33,150	68.720	2,278,068.000	
INVESCO LTD	10,950	20.640	226,008.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,050	151.800	311,190.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7,800	55.910	436,098.000	
RAYTHEON COMPANY	7,720	177.350	1,369,142.000	
RED HAT INC	4,750	185.200	879,700.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2,160	305.240	659,318.400	
REPUBLIC SERVICES INC	6,000	86.990	521,940.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,240	1,775.500	2,201,620.000	
ROSS STORES INC	10,300	100.970	1,039,991.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	2,650	95.320	252,598.000	
RESMED INC	3,900	118.090	460,551.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	3,800	101.030	383,914.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,350	56.250	188,437.500	
RALPH LAUREN CORP	1,450	112.130	162,588.500	
PERKINELMER INC	3,100	92.940	288,114.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	28,035	14.590	409,030.650	
CHEVRON CORP	52,068	120.810	6,290,335.080	
EDISON INTERNATIONAL	8,800	59.440	523,072.000	
TESLA INC	3,620	214.920	778,010.400	
SYMANTEC CORP	17,250	19.360	333,960.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	4,122	141.510	583,304.220	
SYNOPSYS INC	4,100	124.800	511,680.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,305	392.080	1,687,904.400	

CBRE GROUP INC - A	8,700	49.560	431,172.000	
TWITTER INC	20,150	36.150	728,422.500	
SOUTHERN CO/THE	28,450	55.650	1,583,242.500	
SYSCO CORP	13,300	72.250	960,925.000	
TRAVELERS COS INC/THE	7,123	150.110	1,069,233.530	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,550	53.930	191,451.500	
STEEL DYNAMICS INC	6,200	26.430	163,866.000	
SCHLUMBERGER LTD	37,652	35.930	1,352,836.360	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	4,600	45.840	210,864.000	
AT&T INC	198,291	32.350	6,414,713.850	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,050	51.820	209,871.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	11,000	19.050	209,550.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,280	473.650	1,079,922.000	
SEMPRA ENERGY	7,350	137.760	1,012,536.000	
TIFFANY & CO	2,950	91.020	268,509.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,600	44.260	336,376.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	25,750	107.310	2,763,232.500	
SALESFORCE.COM INC	20,850	150.010	3,127,708.500	
WESTROCK CO	7,130	36.050	257,036.500	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	24,884	39.950	994,115.800	
UNION PACIFIC CORP	19,750	166.990	3,298,052.500	
MARATHON OIL CORP	22,600	12.980	293,348.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	18,488	47.960	886,684.480	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	22,437	125.300	2,811,356.100	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19,250	101.620	1,956,185.000	
UNUM GROUP	5,900	33.050	194,995.000	
SPRINT CORP	20,765	7.010	145,562.650	
IQVIA HOLDINGS INC	4,644	141.300	656,197.200	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	54.180	235,683.000	
AMEREN CORPORATION	6,700	76.710	513,957.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	26,326	245.370	6,459,610.620	
VERISIGN INC	2,900	205.200	595,080.000	
VALERO ENERGY CORP	11,292	76.760	866,773.920	
ULTA BEAUTY INC	1,510	354.620	535,476.200	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	7,488	39.860	298,471.680	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,300	122.750	282,325.000	
ANTHEM INC	7,030	285.320	2,005,799.600	

WALT DISNEY CO/THE	48,912	141.650	6,928,384.800	
WELLS FARGO & CO	120,222	45.590	5,480,920.980	
WASTE MANAGEMENT INC	11,500	114.580	1,317,670.000	
WILLIAMS COS INC	33,100	26.990	893,369.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,200	106.140	339,648.000	
WHIRLPOOL CORP	1,700	135.680	230,656.000	
WALMART INC	39,800	109.070	4,340,986.000	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	2,900	78.530	227,737.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5,550	117.450	651,847.500	
WYNN RESORTS LTD	2,600	115.610	300,586.000	
XEROX CORP	5,911	34.420	203,456.620	
WABTEC CORP	4,411	68.000	299,948.000	
TJX COMPANIES INC	33,450	53.340	1,784,223.000	
WATERS CORP	2,050	203.200	416,560.000	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,800	87.120	156,816.000	
ALLERGAN PLC	9,107	115.920	1,055,683.440	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,500	190.810	286,215.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	21,900	52.570	1,151,283.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3,523	190.330	670,532.590	
WESTERN DIGITAL CORP	7,800	36.330	283,374.000	
WEC ENERGY GROUP INC	8,680	84.310	731,810.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	14,100	60.960	859,536.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	47,550	169.660	8,067,333.000	
PPL CORP	20,100	31.450	632,145.000	
PULTEGROUP INC	7,500	32.850	246,375.000	
PPG INDUSTRIES INC	6,450	116.550	751,747.500	
NORTHERN TRUST CORP	5,650	87.170	492,510.500	
NVIDIA CORP	15,550	144.640	2,249,152.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,050	228.420	468,261.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12,543	135.210	1,695,939.030	
QURATE RETAIL INC	11,450	12.830	146,903.500	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4,700	39.510	185,697.000	
TYSON FOODS INC-CL A	7,900	81.910	647,089.000	
NETFLIX INC	11,890	339.730	4,039,389.700	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	10,800	285.260	3,080,808.000	
NRG ENERGY INC	7,950	34.780	276,501.000	
TORCHMARK CORP	2,925	89.170	260,822.250	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4,500	96.350	433,575.000	
TEXTRON INC	6,850	49.450	338,732.500	
NEWS CORP - CLASS A	10,237	11.830	121,103.710	
OGE ENERGY CORP	5,300	43.400	230,020.000	
OMNICOM GROUP	6,050	79.360	480,128.000	
ORACLE CORP	71,283	53.280	3,797,958.240	
MASTERCARD INC - A	24,850	260.100	6,463,485.000	
ONEOK INC	11,250	64.460	725,175.000	
CENTURYLINK INC	27,052	11.100	300,277.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,820	364.620	1,028,228.400	
YUM! BRANDS INC	8,300	109.790	911,257.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,050	110.360	336,598.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,330	139.800	185,934.000	
MOLSON COORS BREWING CO -B	5,050	54.000	272,700.000	
NOBLE ENERGY INC	13,350	19.730	263,395.500	
BANK OF AMERICA CORP	251,101	28.040	7,040,872.040	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,900	80.840	396,116.000	
NORDSTROM INC	3,000	32.610	97,830.000	
AMERICAN EXPRESS CO	19,700	122.000	2,403,400.000	
ANALOG DEVICES INC	9,999	104.020	1,040,095.980	
ADVANCED MICRO DEVICES	26,600	30.360	807,576.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	7,700	50.520	389,004.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	23,822	53.310	1,269,950.820	
ANADARKO PETROLEUM CORP	13,900	69.830	970,637.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	4,800	71.800	344,640.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,950	124.130	614,443.500	
AVERY DENNISON CORP	2,300	110.390	253,897.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	15,800	61.640	973,912.000	
EMERSON ELECTRIC CO	17,000	62.770	1,067,090.000	
AON PLC	6,500	190.760	1,239,940.000	
AMGEN INC	17,200	176.080	3,028,576.000	
TAPESTRY INC	7,650	29.540	225,981.000	
EATON CORP PLC	11,536	78.370	904,076.320	

CELGENE CORP	19,500	96.510	1,881,945.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4,530	187.630	849,963.900	
APPLIED MATERIALS INC	26,300	41.230	1,084,349.000	
CIT GROUP INC	2,800	50.190	140,532.000	
CIMAREX ENERGY CO	2,500	54.600	136,500.000	
CME GROUP INC	9,900	197.100	1,951,290.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	10,594	20.000	211,880.000	
ECOLAB INC	7,050	198.870	1,402,033.500	
EQUIFAX INC	3,150	132.040	415,926.000	
GAP INC/THE	5,950	18.180	108,171.000	
GILEAD SCIENCES INC	34,900	66.360	2,315,964.000	
HORMEL FOODS CORP	7,750	41.430	321,082.500	
STATE STREET CORP	10,243	55.360	567,052.480	
SUNTRUST BANKS INC	11,948	64.570	771,482.360	
SCHWAB (CHARLES) CORP	32,900	41.010	1,349,229.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	13,700	77.930	1,067,641.000	
CAMPBELL SOUP CO	4,850	42.260	204,961.000	
CROWN HOLDINGS INC	3,450	57.940	199,893.000	
CARDINAL HEALTH INC	8,300	44.160	366,528.000	
FEDEX CORP	6,800	164.550	1,118,940.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	12,604	90.570	1,141,544.280	
FMC CORP	3,600	79.910	287,676.000	
FLEX LTD	14,750	9.040	133,340.000	
CERNER CORP	9,000	72.230	650,070.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,774	148.790	412,743.460	
CITRIX SYSTEMS INC	3,700	96.790	358,123.000	
INTEL CORP	122,600	46.190	5,662,894.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	10,200	22.070	225,114.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9,750	54.950	535,762.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	8,950	149.050	1,333,997.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	46,100	5.560	256,316.000	
ILLUMINA INC	3,970	344.000	1,365,680.000	
SEALED AIR CORP	4,400	44.320	195,008.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,160	496.540	1,569,066.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,450	113.320	390,954.000	
SNAP-ON INC	1,550	164.090	254,339.500	
CARMAX INC	4,600	83.540	384,284.000	
COMERICA INC	4,500	70.210	315,945.000	

INGREDION INC	1,900	81.600	155,040.000	
DUKE ENERGY CORP	19,878	87.870	1,746,679.860	
TARGET CORP	14,300	87.790	1,255,397.000	
DOVER CORP	3,900	96.070	374,673.000	
VW GRAINGER INC	1,300	272.360	354,068.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3,950	78.300	309,285.000	
CINTAS CORP	2,500	236.370	590,925.000	
CONAGRA BRANDS INC	12,700	29.880	379,476.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,100	61.710	253,011.000	
CLOROX COMPANY	3,500	156.880	549,080.000	
ENTERGY CORP	5,050	102.040	515,302.000	
MICROSOFT CORP	199,600	132.450	26,437,020.000	
INCYTE CORP	5,000	77.710	388,550.000	
CVS HEALTH CORP	35,869	54.170	1,943,023.730	
MEDTRONIC PLC	36,538	97.500	3,562,455.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	30,350	32.660	991,231.000	
BLACKROCK INC	3,300	446.970	1,475,001.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	13,700	29.620	405,794.000	
HASBRO INC	3,350	107.460	359,991.000	
KELLOGG CO	6,850	56.630	387,915.500	
KEYCORP	28,200	17.150	483,630.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	2,750	116.910	321,502.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	39,461	55.050	2,172,328.050	
KOHL'S CORP	4,450	47.770	212,576.500	
COOPER COS INC/THE	1,300	323.100	420,030.000	
APACHE CORP	10,610	27.490	291,668.900	
CHUBB LTD	12,699	150.260	1,908,151.740	
ARROW ELECTRONICS INC	2,400	67.100	161,040.000	
ALLSTATE CORP	9,200	102.140	939,688.000	
EBAY INC	24,500	38.910	953,295.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	30,600	116.170	3,554,802.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	3,750	72.090	270,337.500	
XILINX INC	6,900	105.420	727,398.000	
DISH NETWORK CORP-A	6,450	37.540	242,133.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	44.880	233,376.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	5,850	176.880	1,034,748.000	
TRIMBLE INC	7,050	42.720	301,176.000	

LENNAR CORP-A	8,100	53.550	433,755.000	
LEAR CORP	1,800	133.700	240,660.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	7,000	45.310	317,170.000	
PROGRESSIVE CORP	15,900	81.960	1,303,164.000	
PACCAR INC	9,537	70.020	667,780.740	
PVH CORP	2,000	88.050	176,100.000	
BIOGEN INC	5,460	227.670	1,243,078.200	
IDEXX LABORATORIES INC	2,370	267.740	634,543.800	
STARBUCKS CORP	34,000	84.240	2,864,160.000	
PTC INC	3,150	83.900	264,285.000	
PERRIGO CO PLC	3,400	43.180	146,812.000	
EVERSOURCE ENERGY	8,530	77.410	660,307.300	
INTUIT INC	7,070	254.130	1,796,699.100	
BORGWARNER INC	5,600	40.950	229,320.000	
BEST BUY CO INC	6,500	66.030	429,195.000	
BALL CORP	8,734	65.410	571,290.940	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	38,347	40.420	1,549,985.740	
ELECTRONIC ARTS INC	8,200	92.730	760,386.000	
VULCAN MATERIALS CO	3,700	132.590	490,583.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	7,100	170.220	1,208,562.000	
VF CORP	9,100	87.260	794,066.000	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	9,371	48.990	459,085.290	
VIACOM INC-CLASS B	9,271	29.390	272,474.690	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,720	152.290	261,938.800	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2,400	130.880	314,112.000	
CARNIVAL CORP	11,150	53.120	592,288.000	
COMCAST CORP-CLASS A	123,590	42.310	5,229,092.900	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	6,100	37.100	226,310.000	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,200	64.800	401,760.000	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	7.600	68,400.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	31,300	6.620	207,206.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 676,313,847.550 (73,488,262,675)	
イギリス・ポンド	株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
MERLIN ENTERTAINMENT	19,300	3.778	72,915.400	
TUI AG-DI	11,897	7.502	89,251.290	
BP PLC	566,200	5.389	3,051,251.800	

UNILEVER PLC	30,760	49.735	1,529,848.600	
BARCLAYS PLC	485,000	1.490	722,650.000	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	46,800	8.918	417,362.400	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	56,100	2.160	121,176.000	
PRUDENTIAL PLC	73,000	16.015	1,169,095.000	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	134,791	2.124	286,296.080	
EVRAZ PLC	15,000	6.960	104,400.000	
JOHNSON MATTHEY PLC	5,464	30.930	169,001.520	
BAE SYSTEMS PLC	89,800	4.847	435,260.600	
AVIVA PLC	107,566	4.086	439,514.670	
GLAXOSMITHKLINE PLC	138,352	15.844	2,192,049.080	
INFORMA PLC	34,200	8.000	273,600.000	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	9,540	19.744	188,357.760	
MELROSE INDUSTRIES PLC	134,500	1.695	228,044.750	
AUTO TRADER GROUP PLC	25,300	5.614	142,034.200	
DCC PLC	2,800	69.440	194,432.000	
OCADO GROUP PLC	13,500	11.595	156,532.500	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,100	87.000	182,700.000	
HALMA PLC	11,000	19.895	218,845.000	
GVC HOLDINGS PLC	16,700	6.244	104,274.800	
NMC HEALTH PLC	2,700	22.990	62,073.000	
RELX PLC	55,346	19.085	1,056,278.410	
DIAGEO PLC	67,350	34.185	2,302,359.750	
RIO TINTO PLC	31,450	47.700	1,500,165.000	
STANDARD CHARTERED PLC	78,300	6.764	529,621.200	
TESCO PLC	275,300	2.244	617,773.200	
FRESNILLO PLC	5,600	8.398	47,028.800	
SMITH & NEPHEW PLC	25,050	17.035	426,726.750	
GLENCORE PLC	311,325	2.720	846,959.660	
JOHN WOOD GROUP PLC	18,000	3.978	71,604.000	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	8,150	18.700	152,405.000	
SMITHS GROUP PLC	11,383	14.835	168,866.800	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	36,883	3.233	119,242.730	
PEARSON PLC	21,663	7.986	173,000.710	
SAINSBURY (J) PLC	45,225	1.939	87,691.270	
NEXT PLC	3,850	55.140	212,289.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	93,200	1.556	145,019.200	

WHITBREAD PLC	4,961	47.150	233,911.150	
BUNZL PLC	9,605	21.650	207,948.250	
VODAFONE GROUP PLC	741,183	1.280	948,862.470	
CRODA INTERNATIONAL PLC	3,661	52.400	191,836.400	
KINGFISHER PLC	55,411	2.076	115,033.230	
WPP PLC	35,400	9.604	339,981.600	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	18,727	8.242	154,347.930	
SEVERN TRENT PLC	6,333	20.400	129,193.200	
RENTOKIL INITIAL PLC	54,000	3.898	210,492.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	19,650	65.260	1,282,359.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	15,150	10.425	157,938.750	
SCHRODERS PLC	3,450	29.290	101,050.500	
SSE PLC	28,000	11.220	314,160.000	
WEIR GROUP PLC/THE	6,850	14.735	100,934.750	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	28,500	5.616	160,056.000	
ASTRAZENECA PLC	35,300	62.150	2,193,895.000	
FERGUSON PLC	6,687	55.660	372,198.420	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	163,100	2.667	434,987.700	
3I GROUP PLC	27,391	10.250	280,757.750	
ASHTED GROUP PLC	13,650	19.490	266,038.500	
SAGE GROUP PLC/THE	29,714	7.604	225,945.250	
NATIONAL GRID PLC	93,534	8.334	779,512.350	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,970,965	0.577	1,137,246.800	
RSA INSURANCE GROUP PLC	28,760	5.690	163,644.400	
IMPERIAL BRANDS PLC	26,300	19.766	519,845.800	
CENTRICA PLC	152,660	0.915	139,714.430	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3,200	35.300	112,960.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	64,310	28.855	1,855,665.050	
BHP GROUP PLC	58,327	19.100	1,114,045.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	9,800	24.630	241,374.000	
HSBC HOLDINGS PLC	557,250	6.456	3,597,606.000	
ANGLO AMERICAN PLC	29,883	21.105	630,680.710	
MONDI PLC	10,150	17.265	175,239.750	
WM MORRISON SUPERMARKETS	66,300	1.978	131,141.400	
CARNIVAL PLC	4,861	40.330	196,044.130	
EASYJET PLC	4,000	9.290	37,160.000	
COMPASS GROUP PLC	43,839	19.115	837,982.480	

	PERSIMMON PLC	8,500	19.455	165,367.500	
	BT GROUP PLC	233,200	2.063	481,091.600	
	COCA-COLA HBC AG-DI	5,800	29.060	168,548.000	
	BURBERRY GROUP PLC	11,339	17.415	197,468.680	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	4,736	52.290	247,645.440	
	INTERTEK GROUP PLC	4,400	55.340	243,496.000	
	ITV PLC	93,100	1.052	97,987.750	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	8,799	54.460	479,193.540	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	123,900	25.150	3,116,085.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	104,268	25.165	2,623,904.220	
	MEGGITT PLC	21,500	5.112	109,908.000	
	G4S PLC	43,500	2.116	92,046.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	5,550	20.780	115,329.000	
	INVESTEC PLC	18,300	4.760	87,108.000	
	ANTOFAGASTA PLC	11,400	8.590	97,926.000	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.719	192,673.770	
	EXPERIAN PLC	25,354	24.080	610,524.320	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 50,226,091.600 (6,868,418,026)	
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	14.230	490,935.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,000	220.500	220,500.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	17,600	19.120	336,512.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	600	559.000	335,400.000	
	BANK HAPOALIM BM	30,700	25.950	796,665.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	41,000	24.960	1,023,360.000	
	NICE LTD	1,650	497.400	820,710.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,000	79.830	239,490.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 4,263,572.000 (128,376,153)	
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	72,800	3.380	246,064.000	
	BHP GROUP LTD	82,150	40.300	3,310,645.000	
	SOUTH32 LTD	141,100	3.310	467,041.000	
	ALUMINA LTD	69,300	2.430	168,399.000	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	25,700	35.030	900,271.000	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	42,500	8.800	374,000.000	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	13,300	11.480	152,684.000	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	77,250	26.730	2,064,892.500	
WESTPAC BANKING CORP	96,848	27.880	2,700,122.240	
SANTOS LTD	48,700	7.000	340,900.000	
AUSNET SERVICES	50,000	1.945	97,250.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	78,950	28.220	2,227,969.000	
RIO TINTO LTD	10,300	105.340	1,085,002.000	
ORIGIN ENERGY LTD	49,500	7.020	347,490.000	
AURIZON HOLDINGS LTD	54,300	5.340	289,962.000	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	22.950	78,030.000	
COLES GROUP LTD	31,545	13.010	410,400.450	
AMCOR PLC-CDI	31,400	15.650	491,410.000	
OIL SEARCH LTD	38,400	7.000	268,800.000	
SEEK LTD	9,600	21.090	202,464.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	20,500	15.070	308,935.000	
NEWCREST MINING LTD	20,950	30.120	631,014.000	
INCITEC PIVOT LTD	42,300	3.480	147,204.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	49,300	79.770	3,932,661.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	7,150	26.470	189,260.500	
ORICA LTD	10,100	20.450	206,545.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	36,050	12.230	440,891.500	
CIMIC GROUP LTD	2,800	45.050	126,140.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	36,400	32.290	1,175,356.000	
COCA-COLA AMATIL LTD	13,700	10.010	137,137.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	57,700	4.590	264,843.000	
CROWN RESORTS LTD	9,600	11.970	114,912.000	
TELSTRA CORP LTD	120,200	3.870	465,174.000	
AMP LTD	84,000	2.110	177,240.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	12,050	18.450	222,322.500	
MACQUARIE GROUP LTD	8,934	122.090	1,090,752.060	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	16,350	30.620	500,637.000	
BANK OF QUEENSLAND LTD	10,800	9.540	103,032.000	
CSL LTD	12,550	212.870	2,671,518.500	
WESFARMERS LTD	31,945	35.660	1,139,158.700	
COCHLEAR LTD	1,650	204.230	336,979.500	

	BLUESCOPE STEEL LTD	14,400	11.760	169,344.000	
	SUNCORP GROUP LTD	36,200	13.370	483,994.000	
	BORAL LTD	30,500	5.390	164,395.000	
	ASX LTD	5,400	81.000	437,400.000	
	COMPUTERSHARE LTD	13,900	16.630	231,157.000	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,000	4.040	56,560.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	63,036	7.790	491,050.440	
	SONIC HEALTHCARE LTD	12,150	27.500	334,125.000	
	CHALLENGER LTD	13,900	6.500	90,350.000	
	WORLEYPARSONS LTD	9,400	13.740	129,156.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	19.570	371,830.000	
	BRAMBLES LTD	44,300	12.970	574,571.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	1,400	41.310	57,834.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	3,850	71.670	275,929.500	
	TPG TELECOM LTD	8,700	6.520	56,724.000	
	REA GROUP LTD	1,350	92.760	125,226.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,650	39.280	64,812.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 34,719,967.390 (2,594,623,163)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	7,600	36.140	274,664.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	600	1,202.500	721,500.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5,996	17.320	103,850.720	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	6,787	90.940	617,209.780	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	12,000	30.820	369,840.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	3,850	120.310	463,193.500	
	BCE INC	4,130	59.880	247,304.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	5,100	104.810	534,531.000	
	SUNCOR ENERGY INC	43,930	41.590	1,827,048.700	
	METRO INC/CN	7,300	50.520	368,796.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	9,500	61.730	586,435.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	34,400	70.590	2,428,296.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	12,550	103.510	1,299,050.500	
	TORONTO-DOMINION BANK	50,900	75.910	3,863,819.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,300	30.000	249,000.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	40,150	103.550	4,157,532.500	

TOURMALINE OIL CORP	6,600	15.560	102,696.000	
VERMILION ENERGY INC	4,500	26.780	120,510.000	
TC ENERGY CORP	25,450	65.660	1,671,047.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	13,929	48.360	673,606.440	
BOMBARDIER INC-B	53,000	2.180	115,540.000	
BARRICK GOLD CORP	49,900	18.660	931,134.000	
CAE INC	7,200	34.590	249,048.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,412	87.300	472,467.600	
EMPIRE CO LTD 'A'	4,600	31.840	146,464.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,600	62.210	99,536.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,150	64.220	266,513.000	
HYDRO ONE LTD	9,200	22.860	210,312.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,460	69.420	379,033.200	
WSP GLOBAL INC	2,700	70.350	189,945.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.000	169,600.000	
EMERA INC	1,700	53.450	90,865.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	3,300	37.950	125,235.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	10,000	69.050	690,500.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,400	62.060	397,184.000	
STARS GROUP INC/THE	6,300	22.020	138,726.000	
KINROSS GOLD CORP	34,100	4.740	161,634.000	
BANK OF MONTREAL	17,900	99.670	1,784,093.000	
POWER CORP OF CANADA	9,400	27.850	261,790.000	
METHANEX CORP	1,700	59.960	101,932.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	2,700	409.150	1,104,705.000	
NUTRIEN LTD	16,919	71.420	1,208,354.980	
AURORA CANNABIS INC	19,800	10.130	200,574.000	
CANOPY GROWTH CORP	5,500	55.260	303,930.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	20.750	114,125.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,800	51.190	296,902.000	
CAMECO CORP	10,600	13.820	146,492.000	
TELUS CORP	5,400	48.600	262,440.000	
POWER FINANCIAL CORP	7,000	29.730	208,110.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	14,000	29.140	407,960.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	138.050	248,490.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	33,800	35.570	1,202,266.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	800	633.330	506,664.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	8,700	61.730	537,051.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,037	101.470	206,694.390	

	BLACKBERRY LTD	13,500	11.470	154,845.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	16,550	52.710	872,350.500	
	ENBRIDGE INC	56,300	46.250	2,603,875.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	23,450	63.260	1,483,447.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	54,700	23.320	1,275,604.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	8,700	28.810	250,647.000	
	ENCANA CORP	41,800	6.250	261,250.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3,900	311.100	1,213,290.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	2,900	52.440	152,076.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,600	52.020	291,312.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	20,150	122.570	2,469,785.500	
	CGI INC - CLASS A	6,900	102.270	705,663.000	
	HUSKY ENERGY INC	9,358	12.700	118,846.600	
	ONEX CORPORATION	2,200	75.330	165,726.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12,500	26.670	333,375.000	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	4,500	25.520	114,840.000	
	IGM FINANCIAL INC	2,400	37.760	90,624.000	
	OPEN TEXT CORP	7,500	55.360	415,200.000	
	CI FINANCIAL CORP	7,000	21.050	147,350.000	
	SAPUTO INC	6,300	39.790	250,677.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	11.150	215,195.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	12,100	85.800	1,038,180.000	
	FORTIS INC	11,700	52.150	610,155.000	
	LUNDIN MINING CORP	19,400	6.730	130,562.000	
	CENOVUS ENERGY INC	29,300	11.360	332,848.000	
	DOLLARAMA INC	8,300	46.780	388,274.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,200	45.120	99,264.000	
	ALTAGAS LTD	6,900	19.180	132,342.000	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,800	22.210	106,608.000	
	KEYERA CORP	6,000	32.250	193,500.000	
	INTER PIPELINE LTD	11,500	19.960	229,540.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 51,463,492.310 (4,168,542,878)	
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	37,300	24.990	932,127.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	49,300	24.810	1,223,133.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	14,970	9.130	136,676.100	
	KEPPEL CORP LTD	39,500	6.300	248,850.000	
	UOL GROUP LTD	14,000	7.260	101,640.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	10,400	9.360	97,344.000	
	CAPITALAND LTD	68,900	3.430	236,327.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	69,300	1.470	101,871.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	41,000	2.370	97,170.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	36.500	98,550.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	89,500	10.780	964,810.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	170,000	0.885	150,450.000	
	VENTURE CORP LTD	7,200	16.630	119,736.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	220,950	3.330	735,763.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	44,000	4.110	180,840.000	
	SEBMCORP INDUSTRIES LTD	28,800	2.370	68,256.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	164,400	0.270	44,388.000	
	SATS LTD	19,600	5.140	100,744.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,800	7.540	156,832.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	55,300	2.580	142,674.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	53,400	3.480	185,832.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,124,013.600 (485,389,318)	
スイス・フラン	株		スイス・フラン	スイス・フラン	
	DUFREY AG-REG	1,250	80.800	101,000.000	
	UBS GROUP AG-REG	108,750	11.520	1,252,800.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	230	628.000	144,440.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	4,250	57.520	244,460.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	19,480	276.000	5,376,480.000	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,100	74.150	81,565.000	
	SIKA AG-REG	3,590	159.000	570,810.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	78,100.000	234,300.000	
	ABB LTD-REG	52,100	18.830	981,043.000	
	SWISS RE AG	8,400	98.860	830,424.000	
	NESTLE SA-REG	84,900	101.400	8,608,860.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	530	712.400	377,572.000	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,140	217.100	247,494.000	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	72,270	11.365	821,348.550	
	JULIUS BAER GROUP LTD	6,400	40.870	261,568.000	
	SGS SA-REG	150	2,582.000	387,300.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	580	211.800	122,844.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,300	138.600	180,180.000	
	TEMENOS AG - REG	1,820	174.600	317,772.000	
	ALCON INC	11,880	57.980	688,802.400	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	850	258.300	219,555.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,252	337.300	1,434,199.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,390	172.400	239,636.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	18.785	107,074.500	
	NOVARTIS AG-REG	60,200	89.410	5,382,482.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	60	1,978.000	118,680.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	14,410	79.440	1,144,730.400	
	SWISSCOM AG-REG	710	496.000	352,160.000	
	GEBERIT AG-REG	1,050	464.100	487,305.000	
	GIVAUDAN-REG	260	2,776.000	721,760.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	841.000	243,890.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,540	230.600	355,124.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,100	329.100	691,110.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	49.240	74,844.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	13,640	48.650	663,586.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	970	474.600	460,362.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,490	134.000	199,660.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,030	83.700	169,911.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	29	6,885.000	199,665.000	
	スイス・フラン 小計			スイス・フラン 35,096,798.250 (3,817,478,745)	
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	2,300	398.200	915,860.000	
	ERICSSON LM-B SHS	87,230	89.280	7,787,894.400	
	VOLVO AB-B SHS	42,600	140.950	6,004,470.000	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1,800	506.000	910,800.000	
	SKF AB-B SHARES	10,550	157.650	1,663,207.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	6,650	229.200	1,524,180.000	
	SWEDISH MATCH AB	4,600	424.900	1,954,540.000	

	TELE2 AB-B SHS	13,700	134.100	1,837,170.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	45,550	87.060	3,965,583.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	43,050	91.880	3,955,434.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	24,800	140.350	3,480,680.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	23,550	154.040	3,627,642.000	
	SKANSKA AB-B SHS	9,150	167.250	1,530,337.500	
	SANDVIK AB	31,150	161.600	5,033,840.000	
	INVESTOR AB-B SHS	12,950	439.400	5,690,230.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	18,550	280.800	5,208,840.000	
	SECURITAS AB-B SHS	8,450	164.600	1,390,870.000	
	TELIA CO AB	77,000	41.260	3,177,020.000	
	ALFA LAVAL AB	8,800	200.100	1,760,880.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,300	255.700	2,633,710.000	
	ASSA ABLOY AB-B	28,250	202.800	5,729,100.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,200	341.200	750,640.000	
	LUNDIN PETROLEUM AB	5,250	266.500	1,399,125.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	16,550	296.000	4,898,800.000	
	BOLIDEN AB	7,800	225.450	1,758,510.000	
	EPIROC AB-A	17,950	91.020	1,633,809.000	
	EPIROC AB-B	9,700	88.170	855,249.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,450	86.880	994,776.000	
	NORDEA BANK ABP	82,800	69.290	5,737,212.000	
	KINNEVIK AB - B	6,500	242.100	1,573,650.000	
	HEXAGON AB-B SHS	7,400	482.100	3,567,540.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	4,600	201.300	925,980.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 93,877,579.400 (1,074,898,284)	
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	47,700	340.500	16,241,850.000	
	DANSKE BANK A/S	20,100	109.600	2,202,960.000	
	ISS A/S	4,400	192.850	848,540.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	95	6,885.000	654,075.000	
	H LUNDBECK A/S	1,700	253.900	431,630.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	5,250	569.000	2,987,250.000	
	CARLSBERG AS-B	2,950	880.000	2,596,000.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,800	305.000	1,769,000.000	

	COLOPLAST-B	3,350	751.200	2,516,520.000	
	DSV A/S	5,360	619.800	3,322,128.000	
	DEMANT A/S	2,675	216.600	579,405.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	170	7,258.000	1,233,860.000	
	TRYG A/S	3,300	218.000	719,400.000	
	PANDORA A/S	3,150	220.700	695,205.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,050	735.000	2,241,750.000	
	GENMAB A/S	1,700	1,179.000	2,004,300.000	
	ORSTED A/S	5,200	566.800	2,947,360.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 43,991,233.000 (717,936,923)	
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	4.485	154,732.500	
	A2 MILK CO LTD	19,000	14.850	282,150.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	52,689	3.875	204,169.870	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29,400	9.020	265,188.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	20,100	5.430	109,143.000	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	15,100	15.070	227,557.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	11,800	11.650	137,470.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,380,410.370 (97,484,580)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	35,200	30.920	1,088,384.000	
	DNB ASA	26,150	150.550	3,936,882.500	
	ORKLA ASA	21,950	76.140	1,671,273.000	
	TELENOR ASA	21,300	189.050	4,026,765.000	
	EQUINOR ASA	27,023	169.950	4,592,558.850	
	YARA INTERNATIONAL ASA	4,960	406.500	2,016,240.000	
	MOWI ASA	12,850	205.300	2,638,105.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	5,550	175.100	971,805.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,400	225.000	540,000.000	
	AKER BP ASA	2,900	226.200	655,980.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 22,137,993.350	

(276,503,537)

銘柄	株	単価	口数	金額
ユ-口				
BAYER AG-REG	25,770	52.850		1,361,944.500
EVONIK INDUSTRIES AG	5,300	24.310		128,843.000
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	53,150	6.027		320,335.050
COMMERZBANK AG	28,135	6.113		171,989.250
VOLKSWAGEN AG	890	144.100		128,249.000
VOLKSWAGEN AG-PREF	5,130	141.240		724,561.200
SIEMENS AG-REG	21,300	104.020		2,215,626.000
E.ON SE	61,500	9.935		611,002.500
UNIPER SE	5,350	26.290		140,651.500
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9,050	62.460		565,263.000
GEA GROUP AG	4,500	25.050		112,725.000
CONTINENTAL AG	3,170	124.400		394,348.000
BASF SE	25,570	60.480		1,546,473.600
ALLIANZ SE-REG	11,890	207.400		2,465,986.000
THYSSENKRUPP AG	11,450	11.770		134,766.500
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4,900	88.480		433,552.000
RWE AG	15,250	22.850		348,462.500
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,650	17.690		117,638.500
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	76.180		89,892.400
BRENNTAG AG	4,300	42.240		181,632.000
FRESENIUS SE & CO KGAA	11,650	46.130		537,414.500
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	31.650		105,078.000
HOCHTIEF AG	710	106.600		75,686.000
SAP SE	27,342	113.540		3,104,410.680
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,120	221.600		912,992.000
ZALANDO SE	3,550	37.790		134,154.500
HEIDELBERGCEMENT AG	4,150	68.800		285,520.000
KION GROUP AG	1,850	52.480		97,088.000
WIRECARD AG	3,270	149.450		488,701.500
COVESTRO AG	5,200	41.760		217,152.000
INNOGY SE	3,730	41.320		154,123.600
SARTORIUS AG-VORZUG	950	177.700		168,815.000
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	4,300	56.180		241,574.000
DELIVERY HERO SE	3,200	37.590		120,288.000
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	89.550		111,937.500

METRO AG	5,000	15.065	75,325.000	
1&1 DRILLISCH AG	1,550	27.360	42,408.000	
AROUNDTOWN SA	22,200	7.684	170,584.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,000	36.610	146,440.000	
KNORR-BREMSE AG	1,450	99.100	143,695.000	
BEIERSDORF AG	2,890	106.950	309,085.500	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,950	34.860	67,977.000	
MERCK KGAA	3,500	91.800	321,300.000	
ADIDAS AG	5,010	260.600	1,305,606.000	
PUMA SE	2,360	54.450	128,502.000	
HENKEL AG & CO KGAA	2,850	82.600	235,410.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	92,850	15.390	1,428,961.500	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	5,870	66.700	391,529.000	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25,350	47.420	1,202,097.000	
QIAGEN N.V.	6,498	35.240	228,989.520	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	31,550	14.390	454,004.500	
HANNOVER RUECK SE	1,730	140.200	242,546.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	27,350	27.380	748,843.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	5,390	125.700	677,523.000	
LANXESS AG	2,500	45.700	114,250.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,430	198.700	284,141.000	
AXEL SPRINGER SE	1,400	62.200	87,080.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	9,950	37.000	368,150.000	
SYMRISE AG	3,670	88.280	323,987.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	26,300	2.475	65,092.500	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,550	53.200	82,460.000	
HUGO BOSS AG -ORD	1,760	54.700	96,272.000	
RTL GROUP	1,000	44.220	44,220.000	
VONOVIA SE	13,650	46.050	628,582.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	25,326	36.665	928,577.790	
NN GROUP NV	8,250	35.130	289,822.500	
ARCELORMITTAL	18,800	14.572	273,953.600	
UNILEVER NV-CVA	42,400	54.590	2,314,616.000	
HEINEKEN NV	7,100	96.420	684,582.000	
AEGON NV	48,644	4.194	204,012.930	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	32,883	20.575	676,567.720	
AKZO NOBEL N.V.	6,088	82.090	499,763.920	
KONINKLIJKE DSM NV	5,000	107.250	536,250.000	
WOLTERS KLUWER	7,800	64.340	501,852.000	
ING GROEP NV	106,850	9.821	1,049,373.850	
KONINKLIJKE KPN NV	91,950	2.837	260,862.150	
ASML HOLDING NV	11,650	171.040	1,992,616.000	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	11,700	18.815	220,135.500	
ADYEN NV	300	700.200	210,060.000	
VOPAK	1,900	39.080	74,252.000	
RANDSTAD NV	3,200	48.210	154,272.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,150	89.500	281,925.000	
JCDECAUX SA	1,900	26.280	49,932.000	
TOTAL SA	66,350	47.250	3,135,037.500	
MICHELIN (CGDE)	4,750	109.900	522,025.000	
AIR LIQUIDE SA	11,992	118.750	1,424,050.000	
KERING	2,130	486.450	1,036,138.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	15,400	75.060	1,155,924.000	
BOUYGUES SA	6,050	31.440	190,212.000	
BNP PARIBAS	31,650	40.860	1,293,219.000	
PEUGEOT SA	16,550	20.720	342,916.000	
NATIXIS	25,350	3.857	97,774.950	
THALES SA	2,850	105.450	300,532.500	
DANONE	17,250	72.520	1,250,970.000	
CARREFOUR SA	15,800	17.110	270,338.000	
SUEZ	9,925	12.575	124,806.870	
VIVENDI	29,091	24.480	712,147.680	
L'OREAL	7,070	248.000	1,753,360.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	13,700	33.265	455,730.500	
LEGRAND SA	7,217	62.540	451,351.180	
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,550	32.600	50,530.000	
PERNOD RICARD SA	5,937	157.850	937,155.450	
SOCIETE BIC SA	700	67.600	47,320.000	
EURAZEO SE	1,254	61.650	77,309.100	
SOCIETE GENERALE SA	20,900	21.235	443,811.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	7,760	354.000	2,747,040.000	
ACCOR SA	5,350	34.800	186,180.000	

CAPGEMINI SE	4,470	97.160	434,305.200	
VALEO SA	6,400	24.300	155,520.000	
PUBLICIS GROUPE	5,950	50.000	297,500.000	
BUREAU VERITAS SA	8,000	21.300	170,400.000	
EIFFAGE	2,140	85.460	182,884.400	
SODEXO SA	2,500	104.250	260,625.000	
IPSEN	1,000	114.700	114,700.000	
INGENICO GROUP	1,600	76.720	122,752.000	
AMUNDI SA	1,700	59.100	100,470.000	
TELEPERFORMANCE	1,650	173.900	286,935.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,200	68.040	149,688.000	
FAURECIA	1,900	35.340	67,146.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	320	360.000	115,200.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	800	129.300	103,440.000	
SEB SA	650	151.100	98,215.000	
ESSILORLUXOTTICA	8,000	106.400	851,200.000	
DASSAULT AVIATION SA	70	1,200.000	84,000.000	
WORLDLINE SA	2,364	61.000	144,204.000	
AXA SA	53,250	22.610	1,203,982.500	
EDENRED	6,400	42.960	274,944.000	
RENAULT SA	5,350	55.740	298,209.000	
HERMES INTERNATIONAL	860	612.200	526,492.000	
STMICROELECTRONICS NV	18,550	14.140	262,297.000	
REMY COINTREAU	630	115.200	72,576.000	
ATOS SE	2,660	71.480	190,136.800	
DASSAULT SYSTEMES SA	3,580	137.000	490,460.000	
WENDEL	780	117.400	91,572.000	
ORANGE	55,400	13.820	765,628.000	
ALSTOM	4,450	41.510	184,719.500	
CNP ASSURANCES	4,850	19.790	95,981.500	
SANOFI	30,975	75.980	2,353,480.500	
VINCI SA	14,300	89.580	1,280,994.000	
AIRBUS SE	16,300	122.420	1,995,446.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14,450	21.250	307,062.500	
CREDIT AGRICOLE SA	32,300	10.295	332,528.500	
BIOMERIEUX	1,150	74.800	86,020.000	
ENGIE	49,973	12.955	647,400.210	
IMERYS SA	900	44.600	40,140.000	
EDF	17,050	11.780	200,849.000	

SES	9,700	14.300	138,710.000	
SAFRAN SA	9,070	122.900	1,114,703.000	
ILIAD SA	740	101.500	75,110.000	
ARKEMA	1,920	76.280	146,457.600	
ADP	810	153.500	124,335.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4,700	16.340	76,798.000	
SCOR SE	4,500	38.810	174,645.000	
GETLINK SE	12,400	13.820	171,368.000	
BOLLORE	24,100	3.912	94,279.200	
UCB SA	3,550	70.400	249,920.000	
KBC GROUP NV	6,900	57.800	398,820.000	
COLRUYT SA	1,600	62.480	99,968.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2,200	85.000	187,000.000	
SOLVAY SA	1,950	86.760	169,182.000	
UMICORE	5,800	26.910	156,078.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	20,800	75.380	1,567,904.000	
AGEAS	4,940	44.020	217,458.800	
PROXIMUS	4,100	26.120	107,092.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	49.140	71,253.000	
PRYSMIAN SPA	6,850	16.930	115,970.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	31,643	16.135	510,559.800	
MEDIOBANCA SPA	17,065	8.526	145,496.190	
TENARIS SA	13,300	10.800	143,640.000	
UNICREDIT SPA	54,956	10.130	556,704.280	
TELECOM ITALIA SPA	313,982	0.458	143,835.150	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.442	76,087.870	
INTESA SANPAOLO	410,237	1.837	753,769.460	
ATLANTIA SPA	13,457	23.420	315,162.940	
POSTE ITALIANE SPA	13,500	9.268	125,118.000	
MONCLER SPA	4,700	35.050	164,735.000	
RECORDATI SPA	3,050	37.050	113,002.500	
ENI SPA	70,000	13.944	976,080.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	16,200	8.760	141,912.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	5.292	58,212.000	
LEONARDO SPA	10,975	10.780	118,310.500	
ENEL SPA	228,934	6.070	1,389,629.380	
SNAM SPA	61,600	4.718	290,628.800	
TERNA SPA	38,900	5.766	224,297.400	
EXOR NV	2,880	59.200	170,496.000	

CNH INDUSTRIAL NV	27,200	8.430	229,296.000	
FINECOBANK SPA	14,500	9.046	131,167.000	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	29,850	11.840	353,424.000	
FERRARI NV	3,345	136.000	454,920.000	
TELEFONICA SA	128,827	7.444	958,988.180	
ENDESA SA	8,250	23.790	196,267.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	186,012	4.878	907,459.540	
IBERDROLA SA	164,934	8.958	1,477,478.770	
BANCO DE SABADELL SA	160,109	0.919	147,268.250	
BANKINTER SA	18,300	6.154	112,618.200	
REPSOL SA	39,200	14.300	560,560.000	
GRIFOLS SA	8,500	24.210	205,785.000	
BANCO SANTANDER SA	446,250	3.954	1,764,695.620	
AMADEUS IT GROUP SA	12,300	68.100	837,630.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,850	25.440	250,584.000	
MAPFRE SA	30,650	2.637	80,824.050	
CAIXABANK SA	100,300	2.577	258,473.100	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,176	37.270	267,449.520	
AENA SME SA	1,850	173.200	320,420.000	
CELLNEX TELECOM SA	5,800	32.070	186,006.000	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	29,750	25.000	743,750.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	6,650	14.825	98,586.250	
ENAGAS SA	5,900	25.010	147,559.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	11,500	19.375	222,812.500	
FERROVIAL SA	13,400	22.140	296,676.000	
BANKIA SA	30,105	2.146	64,605.330	
UPM-KYMMENE OYJ	14,850	23.220	344,817.000	
NOKIA OYJ	160,000	4.386	701,760.000	
WARTSILA OYJ ABP	12,000	12.855	154,260.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	15,550	9.418	146,449.900	
METSO OYJ	2,800	31.910	89,348.000	
ELISA OYJ	4,150	42.100	174,715.000	
SAMPO OYJ-A SHS	12,250	40.590	497,227.500	
FORTUM OYJ	12,250	19.145	234,526.250	
KONE OYJ-B	9,400	50.100	470,940.000	

	NOKIAN RENKAAT OYJ	3,050	26.570	81,038.500	
	NESTE OYJ	11,850	30.870	365,809.500	
	ORION OYJ-CLASS B	2,750	31.430	86,432.500	
	VERBUND AG	2,000	45.860	91,720.000	
	OMV AG	3,550	42.090	149,419.500	
	ERSTE GROUP BANK AG	8,300	32.070	266,181.000	
	VOESTALPINE AG	2,850	24.160	68,856.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	3,400	21.450	72,930.000	
	ANDRITZ AG	2,100	31.320	65,772.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	6,000	26.600	159,600.000	
	AIB GROUP PLC	23,000	3.584	82,432.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	27,460	4.630	127,139.800	
	KINGSPAN GROUP PLC	4,400	46.540	204,776.000	
	JERONIMO MARTINS	6,000	14.385	86,310.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	66,000	3.442	227,172.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	13,950	13.150	183,442.500	
	KERRY GROUP PLC-A	4,570	106.200	485,334.000	
	CRH PLC	22,700	28.360	643,772.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,200	65.920	145,024.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 104,570,587.630 (12,744,017,515)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	37,500	56.200	2,107,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	65,000	48.500	3,152,500.000	
	MTR CORP	42,500	49.350	2,097,375.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,000	125.900	5,539,600.000	
	SINO LAND CO	90,000	12.500	1,125,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	76,669	75.100	5,757,841.900	
	WHARF HOLDINGS LTD	32,000	20.200	646,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	13,500	93.800	1,266,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	45,500	89.050	4,051,775.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	39,507	40.300	1,592,132.100	
	HONG KONG & CHINA GAS	288,199	17.180	4,951,258.820	
	HANG SENG BANK LTD	21,400	194.200	4,155,880.000	
	WHEELOCK & CO LTD	22,000	52.700	1,159,400.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	169,000	11.500	1,943,500.000	

WH GROUP LTD	265,000	7.350	1,947,750.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	33,300	260.400	8,671,320.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	57,000	17.220	981,540.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	7,600	73.050	555,180.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	19,000	21.400	406,600.000	
NWS HOLDINGS LTD	42,500	15.560	661,300.000	
KERRY PROPERTIES LTD	17,500	30.900	540,750.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	36,640	21.950	804,248.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	17,000	39.600	673,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	58,000	8.200	475,600.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	32,600	31.600	1,030,160.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	72,669	58.900	4,280,204.100	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	18,000	63.000	1,134,000.000	
PCCW LTD	117,000	4.560	533,520.000	
AIA GROUP LTD	336,000	73.800	24,796,800.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	51.900	1,712,700.000	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	22,000	46.450	1,021,900.000	
SANDS CHINA LTD	67,200	36.000	2,419,200.000	
SHANGRI-LA ASIA LTD	30,000	9.450	283,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	38,000	55.300	2,101,400.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	23,600	12.060	284,616.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	102,000	30.200	3,080,400.000	
WYNN MACAU LTD	42,000	16.000	672,000.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 98,614,350.920 (1,367,781,047)	
合計			107,829,712,844 [107,829,712,844]	

(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	3,767	783,875.030	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	8,337	1,358,264.040	
		BOSTON PROPERTIES INC	4,250	574,600.000	
		VORNADO REALTY TRUST	4,647	307,631.400	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	3,050	690,825.000	

EQUITY RESIDENTIAL	10,300	806,078.000	
EQUINIX INC	2,238	1,141,200.960	
AMERICAN TOWER CORP	12,150	2,566,444.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	20,043	366,987.330	
KIMCO REALTY CORP	11,100	207,903.000	
INVITATION HOMES INC	11,100	303,141.000	
VENTAS INC	9,600	640,896.000	
WEYERHAEUSER CO	20,064	515,845.440	
AGNC INVESTMENT CORP	14,100	238,008.000	
CROWN CASTLE INTL CORP	11,200	1,493,072.000	
IRON MOUNTAIN INC	7,410	235,119.300	
VEREIT INC	26,900	256,357.000	
SUN COMMUNITIES INC	2,400	309,888.000	
PROLOGIS INC	17,062	1,364,277.520	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,170	479,621.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,600	276,016.000	
DUKE REALTY CORP	9,400	298,450.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,800	538,542.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,000	266,280.000	
WELLTOWER INC	10,650	876,282.000	
HCP INC	13,500	433,620.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,950	198,448.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,000	353,370.000	
MACERICH CO/THE	2,900	100,137.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,400	297,672.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	37,700	343,824.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,150	229,412.000	
REALTY INCOME CORP	8,500	622,795.000	
PUBLIC STORAGE	4,290	1,043,799.900	
REGENCY CENTERS CORP	4,600	316,802.000	
SL GREEN REALTY CORP	2,400	210,096.000	
UDR INC	7,400	343,656.000	
WP CAREY INC	4,300	367,650.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	5,800	694,608.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,500	378,210.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 22,829,704.420 (2,480,675,682)	

イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	19,662	165,475.390	
	SEGRO PLC	30,550	219,654.500	
	BRITISH LAND CO PLC	25,550	137,765.600	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 522,895.490 (71,505,958)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	14,900	193,700.000	
	TRANSURBAN GROUP	75,300	1,092,603.000	
	SYDNEY AIRPORT	30,300	234,522.000	
	APA GROUP	33,300	371,961.000	
	SCENTRE GROUP	153,922	578,746.720	
	DEXUS	30,750	419,430.000	
	GPT GROUP	51,160	315,657.200	
	MIRVAC GROUP	111,600	358,236.000	
	STOCKLAND	66,000	287,760.000	
	GOODMAN GROUP	47,000	688,550.000	
VICINITY CENTRES	89,273	230,324.340		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 4,771,490.260 (356,573,467)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	71,442.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3,700	84,101.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,900	104,676.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 260,219.000 (21,077,739)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,100	144,406.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	69,500	207,110.000	
	CAPITALAND MALL TRUST	69,700	181,220.000	
	SUNTEC REIT	63,000	119,070.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 651,806.000 (51,662,144)	

ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3,780	ユーロ 513,513.000
	ICADE	950	76,000.000
	GECINA SA	1,250	167,500.000
	KLEPIERRE	5,650	167,409.500
	COVIVIO	1,270	120,586.500
ユーロ 小計			ユーロ 1,045,009.000 (127,355,247)
香港・ドル	LINK REIT	59,000	香港・ドル 5,655,150.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75,000	585,000.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107,000	1,341,780.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 7,581,930.000 (105,161,369)
投資証券 合計			3,214,011,606 [3,214,011,606]
合計			3,214,011,606 [3,214,011,606]

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 616銘柄	96.7%	3.3%	68.5%
	投資証券 40銘柄			
イギリス・ポンド	株式 94銘柄	99.0%	1.0%	6.2%
	投資証券 3銘柄			
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	87.9%	12.1%	2.7%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 86銘柄	99.5%	0.5%	3.8%
	投資証券 3銘柄			
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	90.4%	9.6%	0.5%
	投資証券 4銘柄			
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%	-%	0.6%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	239銘柄	99.0%	1.0%	11.6%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	37銘柄	92.9%	7.1%	1.3%
	投資証券	3銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（2018年6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

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

(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	184,814	-
コール・ローン	16,827,857	17,640,172
親投資信託受益証券	1,684,443,508	1,733,708,318
未収入金	-	1,800,000
流動資産合計	1,701,456,179	1,753,148,490
資産合計	1,701,456,179	1,753,148,490
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,680,882
未払受託者報酬	164,853	185,117
未払委託者報酬	3,256,712	3,656,777
その他未払費用	41,359	46,691
流動負債合計	3,462,924	5,569,467
負債合計	3,462,924	5,569,467
純資産の部		
元本等		
元本	1,232,384,733	1,267,003,630
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	465,608,522	480,575,393
（分配準備積立金）	163,184,866	131,493,498
元本等合計	1,697,993,255	1,747,579,023
純資産合計	1,697,993,255	1,747,579,023
負債純資産合計	1,701,456,179	1,753,148,490

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年6月16日 至 2018年6月15日	自	2018年6月16日 至 2019年6月17日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		142,496,585		11,024,810
営業収益合計		142,496,585		11,024,812
営業費用				
支払利息		7,366		12,490
受託者報酬		278,405		371,469
委託者報酬		5,500,121		7,338,062
その他費用		69,985		94,138
営業費用合計		5,855,877		7,816,159
営業利益		136,640,708		3,208,653
経常利益		136,640,708		3,208,653
当期純利益		136,640,708		3,208,653
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（ ）		13,653,351		427,232
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		146,644,116		465,608,522
剰余金増加額又は欠損金減少額		230,524,776		126,152,840
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		230,524,776		126,152,840
剰余金減少額又は欠損金増加額		34,547,727		114,821,854
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		34,547,727		114,821,854
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		465,608,522		480,575,393

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	679,453,477円	1,232,384,733円
期中追加設定元本額	695,338,362円	339,152,791円
期中一部解約元本額	142,407,106円	304,533,894円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,232,384,733口	1,267,003,630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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(122,993,019円)、投資信託約款に規定される収益調整金(302,430,638円)及び分配準備積立金(40,191,847円)より分配対象額は465,615,504円(1万口当たり3,778.17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(3,641,583円)、投資信託約款に規定される収益調整金(349,093,063円)及び分配準備積立金(127,851,915円)より分配対象額は480,586,561円(1万口当たり3,793.10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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	134,003,951	10,473,940
合計	134,003,951	10,473,940

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3778円 (13,778円)	1.3793円 (13,793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	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	223,805,289	342,869,702	
	外国株式インデックスマザーファンド	555,335,842	1,390,838,616	
親投資信託受益証券 合計			1,733,708,318	
合計			1,733,708,318	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	36,657,626	11,758,171
金銭信託	564,417	-
コール・ローン	51,391,860	36,874,733
株式	4,534,181,748	6,274,186,968
投資証券	665,088,728	609,190,229
派生商品評価勘定	44,480	204,249
未収入金	356,353	-
未収配当金	20,795,547	46,788,410
差入委託証拠金	28,092,622	24,175,918
流動資産合計	5,337,173,381	7,003,178,678
資産合計	5,337,173,381	7,003,178,678
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	195,903	4,395,222
未払株式払込金	-	357,906
未払解約金	15,380,000	1,820,000
その他未払費用	530	-
流動負債合計	15,576,433	6,573,128
負債合計	15,576,433	6,573,128
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,410,057,687	4,567,104,546
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,911,539,261	2,429,501,004
元本等合計	5,321,596,948	6,996,605,550
純資産合計	5,321,596,948	6,996,605,550
負債純資産合計	5,337,173,381	7,003,178,678

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6月16日 至 2019年6月17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	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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>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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	2,177,846,631円	3,410,057,687円
期中追加設定元本額	1,566,561,474円	1,486,881,231円
期中一部解約元本額	334,350,418円	329,834,372円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	- 円	8,415,448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)	207,947,133円	223,805,289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)	189,070,919円	216,916,938円
D-I's 新興国株式インデックス	70,735,373円	94,741,433円
iFree 新興国株式インデックス	1,068,005,927円	1,569,065,380円
iFree 8資産バランス	623,519,746円	1,104,455,012円

DCダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	836,181,573円	919,980,442円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	346,791,758円	368,062,743円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	67,805,258円	61,661,861円
計	3,410,057,687円	4,567,104,546円
2. 期末日における受益権の総数	3,410,057,687口	4,567,104,546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6月16日 至 2019年6月17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	<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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	238,863,425	20,517,551
投資証券	37,341,491	4,794,582
合計	201,521,934	15,722,969

（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7月6日から2018年6月15日まで、及び2018年7月6日から2019年6月17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

	2018年6月15日 現在	2019年6月17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								
株価指数 先物取引								
買 建	37,108,790	-	36,912,887	195,903	80,737,639	-	76,632,464	4,105,175
合計	37,108,790	-	36,912,887	195,903	80,737,639	-	76,632,464	4,105,175

(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6月15日 現在				2019年6月17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	-	-	-	-	217,750	-	217,680	70
インドネシ ア・ルピア	-	-	-	-	153,224	-	153,224	0
トルコ・リラ	-	-	-	-	64,526	-	64,456	70
買 建	10,945,520	-	10,990,000	44,480	22,021,010	-	21,935,142	85,868
アメリカ・ドル	10,945,520	-	10,990,000	44,480	22,021,010	-	21,935,142	85,868

合計	10,945,520	-	10,990,000	44,480	22,238,760	-	22,152,822	85,798
----	------------	---	------------	--------	------------	---	------------	--------

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	1.5606円	1.5320円
(1万口当たり純資産額)	(15,606円)	(15,320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	6.424	105,353.600	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	3,400	158.100	537,540.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,000	113.080	226,160.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,800	7.690	67,672.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	26,450	8.530	225,618.500	
	JD.COM INC-ADR	7,900	27.050	213,695.000	
	NETEASE INC-ADR	500	265.940	132,970.000	
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	3,600	33.470	120,492.000		

	VTB BANK JSC -GDR-REG S	89,306	1.260	112,525.560	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,830	28.300	51,789.000	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,950	71.460	282,267.000	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	15,530	3.858	59,914.740	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	10,490	22.750	238,647.500	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	18,700	13.745	257,031.500	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	60,610	0.882	53,458.020	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	70,450	15.195	1,070,487.750	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	930	203.200	188,976.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	15,880	80.680	1,281,198.400	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	46,270	6.310	291,963.700	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	187,960	7.170	1,347,673.200	
	SEVERSTAL - GDR REG S	6,180	17.300	106,914.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	4,540	9.736	44,202.530	
	ALROSA PJSC	39,180	1.323	51,857.390	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	32,809	1.388	45,568.120	
	AEROFLOT PJSC	40,700	1.518	61,819.840	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 7,175,795.350 (779,721,923)	
インド・ルピー	株		インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	12,150	501.800	6,096,870.000	
	AXIS BANK LTD	18,460	801.200	14,790,152.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	870	6,747.400	5,870,238.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	2,490	1,822.950	4,539,145.500	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	45,610	306.450	13,977,184.500	
	STATE BANK OF INDIA	52,780	343.800	18,145,764.000	
	NTPC LTD	64,840	132.750	8,607,510.000	
	POWER FINANCE CORPORATION	30,580	132.600	4,054,908.000	
	JSW STEEL LTD	22,270	271.250	6,040,737.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	108,280	159.800	17,303,144.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,045	386.500	17,023,392.500	
	RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	23,790	59.150	1,407,178.500	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,050	1,084.950	3,309,097.500	
	TECH MAHINDRA LTD	4,220	740.250	3,123,855.000	
	YES BANK LTD	23,520	115.050	2,705,976.000	

	TATA MOTORS LTD-A-DVR	31,820	80.600	2,564,692.000	
	REC LTD	33,110	156.650	5,186,681.500	
	COAL INDIA LTD	37,570	255.150	9,585,985.500	
	BHARTI INFRA TEL LTD	11,440	275.050	3,146,572.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	7,900	672.250	5,310,775.000	
	GAIL INDIA LTD	10,453	308.500	3,224,750.500	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	37,450	198.250	7,424,462.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,120	899.000	7,299,880.000	
	WIPRO LTD	13,653	298.800	4,079,516.400	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	6,156	2,254.500	13,878,702.000	
	INFOSYS LTD	36,240	740.450	26,833,908.000	
	LARSEN & TOUBRO LTD	4,182	1,526.300	6,382,986.600	
	TATA MOTORS LTD	84,520	164.200	13,878,184.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	12,470	2,185.850	27,257,549.500	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	31,860	1,317.550	41,977,143.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	74,175	169.300	12,557,827.500	
	ITC LTD	23,640	278.050	6,573,102.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	9,890	637.250	6,302,402.500	
	HERO MOTOCORP LTD	1,530	2,670.300	4,085,559.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	38,622	353.300	13,645,152.600	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,840	392.550	4,255,242.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	5,810	1,087.000	6,315,470.000	
	VEDANTA LTD	86,050	169.550	14,589,777.500	
	インド・ルピー 小計			インド・ルピー 373,351,474.600 (586,161,816)	
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	26,900.000	763,960,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	308,400	7,425.000	2,289,870,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	47,000	11,450.000	538,150,000.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	77,000	7,050.000	542,850,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	795,600	3,990.000	3,174,444,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	125,200	8,500.000	1,064,200,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	51,500	29,000.000	1,493,500,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	297,700	7,825.000	2,329,502,500.000	

	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	301,500	1,960.000	590,940,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	660,500	4,230.000	2,793,915,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	472,900	1,235.000	584,031,500.000	
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 16,165,363,000.000 (122,856,759)	
シンガポール・ ドル	株 YANGZIJIANG SHIPBUILDING	47,700	シンガポール・ドル 1.470	シンガポール・ドル 70,119.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 70,119.000 (5,557,631)	
タイ・パーツ	株 BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	10,200	タイ・パーツ 200.000	タイ・パーツ 2,040,000.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	16,600	458.000	7,602,800.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	11,000	193.500	2,128,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	7,800	193.500	1,509,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	57,100	133.500	7,622,850.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	30,200	56.000	1,691,200.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,000	198.500	3,970,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	179,000	19.500	3,490,500.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	123,300	14.500	1,787,850.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	29,900	126.500	3,782,350.000	
	IRPC PCL - NVDR	284,300	4.740	1,347,582.000	
	PTT PCL-NVDR	386,000	46.500	17,949,000.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	34,700	60.250	2,090,675.000	
	CP ALL PCL-NVDR	42,300	83.000	3,510,900.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	103,400	28.750	2,972,750.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	61,400	62.250	3,822,150.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 67,318,407.000 (234,268,056)	
チリ・ペソ	株 ENEL CHILE SA	487,797	チリ・ペソ 64.600	チリ・ペソ 31,511,686.200	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	7,000	6,307.000	44,149,000.000	
	CENCOSUD SA	41,450	1,375.000	56,993,750.000	

	BANCO SANTANDER CHILE	983,090	51.490	50,619,304.100	
	ENEL AMERICAS SA	528,500	116.480	61,559,680.000	
	EMPRESAS CMPC SA	16,880	1,858.000	31,363,040.000	
	S.A.C.I. FALABELLA	8,640	4,364.800	37,711,872.000	
	EMPRESAS COPEC SA	4,630	7,290.000	33,752,700.000	
	BANCO DE CHILE	396,692	100.000	39,669,200.000	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 387,330,232.300 (60,113,652)	
トルコ・リラ	株		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	94,550	7.860	743,163.000	
	AKBANK T.A.S.	122,692	6.060	743,513.520	
	TURKIYE IS BANKASI-C	99,510	5.090	506,505.900	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	43,950	12.400	544,980.000	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	4,410	117.500	518,175.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	50,791	7.380	374,837.580	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	63,180	7.790	492,172.200	
	TURKIYE HALK BANKASI	72,200	5.150	371,830.000	
	YAPI VE KREDI BANKASI	107,560	2.110	226,951.600	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	79,510	3.580	284,645.800	
	KOC HOLDING AS	36,115	16.380	591,563.700	
	TURK HAVA YOLLARI AO	35,620	12.680	451,661.600	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	3,440	78.950	271,588.000	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 6,121,587.900 (112,576,002)	
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	45.740	54,888.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,700	93.600	159,120.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	4,600	46.800	215,280.000	
	CIA DE SANEAMENTO DO PA- UNIT	1,600	77.000	123,200.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	13,900	24.640	342,496.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	85,100	27.060	2,302,806.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	78,160	36.130	2,823,920.800	

ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	107,336	33.990	3,648,350.640	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	22,800	16.770	382,356.000	
VALE SA	80,190	51.400	4,121,766.000	
GERDAU SA-PREF	33,200	14.350	476,420.000	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	64,100	30.190	1,935,179.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	39,097	14.530	568,079.410	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	37,541	11.980	449,741.180	
BRASKEM SA-PREF A	5,000	34.550	172,750.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	4,800	36.180	173,664.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	37,600	50.520	1,899,552.000	
COSAN SA	4,000	47.280	189,120.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	6,800	35.300	240,040.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	5,800	48.090	278,922.000	
EMBRAER SA	22,300	18.670	416,341.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	68,100	6.760	460,356.000	
CCR SA	24,200	14.000	338,800.000	
BRF SA	24,100	29.100	701,310.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	7,600	46.640	354,464.000	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	7,700	26.800	206,360.000	
TIM PARTICIPACOES SA	20,026	11.040	221,087.040	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	11,700	50.260	588,042.000	
LOJAS RENNEN S.A.	5,005	45.840	229,429.200	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,500	16.080	136,680.000	
JBS SA	49,000	21.130	1,035,370.000	
SUZANO SA	4,245	32.500	137,962.500	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	7,000	22.050	154,350.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	7,900	18.960	149,784.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	15,000	35.750	536,250.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	14,108	14.080	198,640.640	
CIELO SA	34,728	6.600	229,204.800	
HYPERA SA	5,300	29.000	153,700.000	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	4,500	86.360	388,620.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,800	89.400	160,920.000	

	SUL AMERICA SA - UNITS	4,500	33.090	148,905.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	3,200	17.890	57,248.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	8,200	43.380	355,716.000	
	KLABIN SA - UNIT	9,800	15.780	154,644.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	29,200	21.500	627,800.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	1,900	12.830	24,377.000	
	KROTON EDUCACIONAL SA	31,700	10.480	332,216.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	20,265	32.000	648,480.000	
	AMBEV SA	65,000	17.640	1,146,600.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 30,851,308.210 (860,134,473)	
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	64,700	8.960	579,712.000	
	GENTING BHD	45,000	6.480	291,600.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	34,600	23.120	799,952.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	39,100	8.340	326,094.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	67,500	3.230	218,025.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	73,700	5.280	389,136.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	44,100	12.180	537,138.000	
	PETRONAS GAS BHD	10,300	17.600	181,280.000	
	SAPURA ENERGY BHD	692,800	0.310	214,768.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 3,537,705.000 (92,086,462)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA IN	62,100	28.260	1,754,946.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	10,800	123.410	1,332,828.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	764,100	13.930	10,643,913.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	55,200	34.490	1,903,848.000	
	CEMEX SAB-CPO	707,319	7.910	5,594,893.290	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICANUBD	30,900	187.920	5,806,728.000	
	MEXICHEM SAB DE CV-*	29,623	41.060	1,216,320.380	

	ALFA S.A.B.-A	71,600	18.560	1,328,896.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	73,500	50.920	3,742,620.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	80,400	54.150	4,353,660.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	48,100	106.200	5,108,220.000	
メキシコ・ペソ	小計			メキシコ・ペソ 42,786,872.670 (242,601,567)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	95,000	9.880	938,600.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	165,000	6.270	1,034,550.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	13.060	313,440.000	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	16,000	20.300	324,800.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	45,000	12.160	547,200.000	
	CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	7.320	300,120.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	14,000	34.850	487,900.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	60,000	9.910	594,600.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,297,800	5.090	6,605,802.000	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,000	38.550	385,500.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	76,000	6.030	458,280.000	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICE-H	56,000	6.010	336,560.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	13,500	25.950	350,325.000	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	61,000	9.910	604,510.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	12,600	330.000	4,158,000.000	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	458,000	3.880	1,777,040.000	
	AIR CHINA LTD-H	42,000	7.300	306,600.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	210,000	8.450	1,774,500.000	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	41,000	23.050	945,050.000	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	150,000	4.630	694,500.000	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDING	60,000	11.400	684,000.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	686,000	4.270	2,929,220.000	

CNOOC LTD	396,000	12.340	4,886,640.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	64,000	4.880	312,320.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	188,000	4.880	917,440.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,000	46.700	793,900.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	84,000	5.000	420,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,091,000	6.330	19,566,030.000	
CHINA MOBILE LTD	130,500	68.300	8,913,150.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	33,000	19.440	641,520.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	342,000	4.330	1,480,860.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	30,600	8.750	267,750.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	279,000	1.330	371,070.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	10,000	57.250	572,500.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	156,000	4.380	683,280.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	112,000	16.200	1,814,400.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	22,000	11.440	251,680.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	27,600	27.300	753,480.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	54,000	33.100	1,787,400.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	19,000	20.000	380,000.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	58,000	6.750	391,500.000	
BYD CO LTD-H	8,000	45.350	362,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,008,000	3.210	3,235,680.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	15,100	34.550	521,705.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP-H	182,000	3.000	546,000.000	
CITIC LTD	122,000	10.660	1,300,520.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	215,000	1.760	378,400.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,494,000	5.740	14,315,560.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	386,000	1.920	741,120.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	74,000	4.440	328,560.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	30,000	16.200	486,000.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	78,000	27.750	2,164,500.000	

CRRR CORP LTD - H	64,000	6.670	426,880.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	167,000	7.100	1,185,700.000	
CGN POWER CO LTD-H	185,000	2.230	412,550.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	63,500	87.200	5,537,200.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	21,000	36.800	772,800.000	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	68,000	4.550	309,400.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	267,080	5.650	1,509,002.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	124,000	11.460	1,421,040.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	8,000	51.150	409,200.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	25,300	29.550	747,615.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	92,000	3.300	303,600.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	38,000	7.020	266,760.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	4,000	97.250	389,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	202,000	8.270	1,670,540.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	100,000	5.510	551,000.000	
WEICHAO POWER CO LTD-H	41,000	13.000	533,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	188,000	2.780	522,640.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	47,800	28.650	1,369,470.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,400	15.540	379,176.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	124,000	18.000	2,232,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	7,400	74.100	548,340.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	38,000	6.210	235,980.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	68,000	6.680	454,240.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	50,800	14.280	725,424.000	
CHINA OILFIELD SERVICES-H	44,000	7.010	308,440.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	114,000	2.930	334,020.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	46,000	8.450	388,700.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	194,000	6.360	1,233,840.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	296,100	6.260	1,853,586.000	

	CHINA EVERGRANDE GROUP	38,000	20.900	794,200.000	
	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	52,000	10.000	520,000.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	465,000	0.440	204,600.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	76,500	38.900	2,975,850.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	3,013,000	3.200	9,641,600.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	30,500	14.380	438,590.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	114,000	3.490	397,860.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	69,600	8.060	560,976.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	67,000	4.210	282,070.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	29,000	30.050	871,450.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 139,855,201.000 (1,939,791,639)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	16,000	78.700	1,259,200.000	
	TAIWAN CEMENT	94,600	43.950	4,157,670.000	
	ASIA CEMENT CORP	55,000	46.350	2,549,250.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	66,112	80.600	5,328,627.200	
	FORMOSA PLASTICS CORP	57,600	112.000	6,451,200.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	48,140	78.400	3,774,176.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	50,390	110.500	5,568,095.000	
	WALSIN LIHWA CORP	93,000	15.900	1,478,700.000	
	CHINA STEEL CORP	130,686	24.500	3,201,807.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	65,616	45.100	2,959,281.600	
	DELTA ELECTRONICS INC	34,000	148.000	5,032,000.000	
	ACER INC	93,000	19.250	1,790,250.000	
	INVENTEC CORP	67,000	23.750	1,591,250.000	
	TATUNG CO LTD	55,000	20.800	1,144,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	59,000	59.000	3,481,000.000	
	AU OPTRONICS CORP	272,000	9.190	2,499,680.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	68,400	112.500	7,695,000.000	
	MEDIATEK INC	31,003	307.000	9,517,921.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	17,000	217.500	3,697,500.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	61,187	24.150	1,477,666.050	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	113,411	43.550	4,939,049.050	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	145,693	41.300	6,017,120.900	

	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	172,000	9.270	1,594,440.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	136,334	25.900	3,531,050.600	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	169,828	17.850	3,031,429.800	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	155,993	30.650	4,781,185.450	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	153,575	14.150	2,173,086.250	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	355,677	8.870	3,154,854.990	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	242,028	21.350	5,167,297.800	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	96,210	22.200	2,135,862.000	
	LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,630.000	3,630,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	164.000	1,640,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	24,000	120.500	2,892,000.000	
	WISTRON CORP	62,110	23.750	1,475,112.500	
	INNOLUX CORP	219,000	7.270	1,592,130.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	23,000	78.000	1,794,000.000	
	PEGATRON CORP	47,000	52.000	2,444,000.000	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	14,220	122.000	1,734,840.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	61,800	20.450	1,263,810.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	21,400	74.000	1,583,600.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	22,000	115.000	2,530,000.000	
	POU CHEN	37,440	37.100	1,389,024.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	259,000	236.000	61,124,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	218,902	75.100	16,439,540.200	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	300.000	2,400,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	10,760	216.500	2,329,540.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	75,000	32.700	2,452,500.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	438,000	13.700	6,000,600.000	
	台湾・ドル 小計			台湾・ドル 225,894,347.390 (779,335,499)	
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	25,490	78.000	1,988,220.000	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,900	129.730	635,677.000	

OLD MUTUAL LTD	69,000	21.690	1,496,610.000	
VODACOM GROUP LTD	16,250	126.000	2,047,500.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	10,090	165.880	1,673,729.200	
NEDBANK GROUP LTD	10,010	253.470	2,537,234.700	
BIDVEST GROUP LTD	5,430	195.530	1,061,727.900	
BID CORP LTD	5,110	312.360	1,596,159.600	
NETCARE LTD	32,930	17.900	589,447.000	
STANDARD BANK GROUP LTD	30,290	195.920	5,934,416.800	
SASOL LTD	15,190	357.000	5,422,830.000	
REMGRO LTD	7,540	186.670	1,407,491.800	
EXXARO RESOURCES LTD	4,600	172.380	792,948.000	
PICK N PAY STORES LTD	8,570	70.120	600,928.400	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	9,640	71.740	691,573.600	
SANLAM LTD	31,040	78.250	2,428,880.000	
TIGER BRANDS LTD	3,180	228.330	726,089.400	
FIRSTRAND LTD	53,900	67.000	3,611,300.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,680	48.340	1,338,051.200	
THE FOSCHINI GROUP LTD	4,330	177.000	766,410.000	
ABSA GROUP LTD	25,130	171.980	4,321,857.400	
NASPERS LTD-N SHS	1,420	3,448.430	4,896,770.600	
INVESTEC LTD	6,990	89.880	628,261.200	
MTN GROUP LTD	54,410	106.740	5,807,723.400	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,780	69.100	952,198.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	7,030	101.010	710,100.300	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,790	237.700	1,376,283.000	
BARLOWORLD LTD	6,070	125.830	763,788.100	
SAPPI LIMITED	15,710	58.050	911,965.500	
TELKOM SA SOC LTD	10,830	95.230	1,031,340.900	
MONDI LTD	2,170	319.620	693,575.400	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,730	190.000	898,700.000	
MR PRICE GROUP LTD	3,190	202.330	645,432.700	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	27,640	22.810	630,468.400	
SIBANYE GOLD LTD	55,570	14.950	830,771.500	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 62,446,461.000 (458,981,489)	
合計			6,274,186,968	

(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	256,000	アメリカ・ドル 5,324,800.000	
		アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 5,324,800.000 (578,592,768)	
	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	171,870	トルコ・リラ 189,057.000	
		トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 189,057.000 (3,476,758)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	67,700	メキシコ・ペソ 1,706,717.000	
		メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 1,706,717.000 (9,677,085)	
	南アフリカ・ランド	REDEFINE PROPERTIES LTD	105,000	南アフリカ・ランド 948,150.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	59,430	1,425,131.400	
		南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 2,373,281.400 (17,443,618)	
	投資証券 合計			609,190,229 [609,190,229]	
合計			609,190,229 [609,190,229]		

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	57.4%	42.6%	19.7%
	投資証券 1銘柄			

インド・ルピー	株式	38銘柄	100%	-%	8.5%
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%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式	16銘柄	100%	-%	3.4%
チリ・ペソ	株式	9銘柄	100%	-%	0.9%
トルコ・リラ	株式 投資証券	13銘柄 1銘柄	97.0%	3.0%	1.7%
ブラジル・レアル	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 投資証券	11銘柄 1銘柄	96.2%	3.8%	3.7%
香港・ドル	株式	91銘柄	100%	-%	28.2%
台湾・ドル	株式	48銘柄	100%	-%	11.3%
南アフリカ・ランド	株式 投資証券	35銘柄 2銘柄	96.3%	3.7%	6.9%

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 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6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	820,627	-
コール・ローン	74,720,632	58,479,756
親投資信託受益証券	25,095,927,810	27,345,256,937
未収入金	62,785,794	-
流動資産合計	25,234,254,863	27,403,736,693
資産合計	25,234,254,863	27,403,736,693
負債の部		
流動負債		
未払解約金	96,116,755	11,495,232
未払受託者報酬	1,229,049	1,424,362
未払委託者報酬	15,363,693	17,804,946
その他未払費用	615,315	720,048
流動負債合計	113,324,812	31,444,588
負債合計	113,324,812	31,444,588
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 25,335,886,514	¹ 26,970,241,880
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 214,956,463	² 402,050,225
（分配準備積立金）	121,793,614	680,324,762
元本等合計	25,120,930,051	27,372,292,105
純資産合計	25,120,930,051	27,372,292,105
負債純資産合計	25,234,254,863	27,403,736,693

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		-		22
有価証券売買等損益		162,898,640		667,413,051
営業収益合計		162,898,640		667,413,073
営業費用				
支払利息		27,892		44,511
受託者報酬		2,122,258		2,860,177
委託者報酬		26,529,414		35,753,275
その他費用		1,063,033		1,435,679
営業費用合計		29,742,597		40,093,642
営業利益		133,156,043		627,319,431
経常利益		133,156,043		627,319,431
当期純利益		133,156,043		627,319,431
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		7,177,146		36,031,343
期首剰余金又は期首欠損金()		205,358,462		214,956,463
剰余金増加額又は欠損金減少額		100,049,250		72,577,897
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		100,049,250		72,577,897
剰余金減少額又は欠損金増加額		235,626,148		46,859,297
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		235,626,148		46,859,297
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		214,956,463		402,050,225

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	14,453,552,894円	25,335,886,514円
期中追加設定元本額	17,894,969,975円	9,926,740,515円
期中一部解約元本額	7,012,636,355円	8,292,385,149円
2. 計算期間末日における受益権の総数	25,335,886,514口	26,970,241,880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214,956,463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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17日

<p>1 分配金の計算過程</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(121,793,614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121,793,614円(1万口当たり48.07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(591,308,207円)、投資信託約款に規定される収益調整金(40,607,892円)及び分配準備積立金(89,016,555円)より分配対象額は720,932,654円(1万口当たり267.31円)であり、分配を行っておりません。</p>
-------------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	156,995,021	642,477,378
合計	156,995,021	642,477,378

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9915円 (9,915円)	1.0149円 (10,149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	19,024,110,851	27,345,256,937	
親投資信託受益証券 合計			27,345,256,937	
合計			27,345,256,937	

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6月15日現在	2019年6月17日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,590,675	-

コール・ローン	235,888,930	360,887,346
国債証券	62,694,390,280	69,574,913,070
地方債証券	4,460,002,450	4,268,356,600
特殊債券	3,338,374,600	3,042,776,500
社債券	3,606,957,200	3,220,570,700
未収利息	208,511,175	214,730,664
前払費用	6,324,909	7,066,913
流動資産合計	74,553,040,219	80,689,301,793
資産合計	74,553,040,219	80,689,301,793
負債の部		
流動負債		
未払金	-	121,902,500
未払解約金	71,156,514	92,742,073
その他未払費用	3,891	-
流動負債合計	71,160,405	214,644,573
負債合計	71,160,405	214,644,573
純資産の部		
元本等		
元本	1	53,122,088,329
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		24,489,602,294
元本等合計		80,474,657,220
純資産合計		80,474,657,220
負債純資産合計		80,689,301,793

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6月16日 至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	45,733,895,667円	53,122,088,329円
期中追加設定元本額	14,320,084,238円	13,594,968,519円
期中一部解約元本額	6,931,891,576円	10,732,001,922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)	144,466,105円	110,544,053円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	930,933,526円	667,506,184円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	111,826,913円	81,173,073円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	1,283,693,789円	934,094,036円
D-I's 日本債券インデックス	761,060円	- 円
DCダイワ日本債券インデックス	5,457,745,439円	6,683,254,527円
ダイワ・バランスファンド35VA	13,867,768,482円	11,850,024,585円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	2,269,479,451円	1,979,999,931円

ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	312,147,523円	271,217,036円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	416,966,702円	377,796,020円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	56,296,878円	76,456,533円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	17,898,814,500円	19,024,110,851円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	199,030,194円	3,556,309,557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	1,453,404,501円	1,464,191,094円
ダイワ・インデックスセレクト ト 日本債券	1,305,882,033円	1,188,807,626円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,333,134,398円	6,681,339,672円
ダイワライフスタイル25	451,884,199円	436,056,658円
ダイワライフスタイル50	489,448,250円	471,431,380円
ダイワライフスタイル75	138,404,386円	130,742,110円
計	53,122,088,329円	55,985,054,926円
2. 期末日における受益権の総数	53,122,088,329口	55,985,054,926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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	112,073,410	1,750,414,970
地方債証券	8,139,750	33,470,900
特殊債券	5,579,100	21,243,900
社債券	7,687,100	16,769,600
合計	90,667,460	1,821,899,370

(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6月15日まで、及び2018年12月1日から2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4021円 (14,021円)	1.4374円 (14,374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 1 2年国債	100,000,000	100,320,000	
	3 9 2 2年国債	50,000,000	50,172,000	
	3 9 4 2年国債	550,000,000	552,194,500	
	3 9 9 2年国債	100,000,000	100,537,000	
	4 0 0 2年国債	200,000,000	201,124,000	
	1 2 5 5年国債	940,000,000	943,374,600	
	1 2 6 5年国債	790,000,000	793,460,200	
	1 2 7 5年国債	1,380,000,000	1,387,162,200	
	1 2 8 5年国債	1,000,000,000	1,006,040,000	
	1 2 9 5年国債	1,020,000,000	1,027,048,200	
	1 3 0 5年国債	880,000,000	886,872,800	
	1 3 1 5年国債	920,000,000	928,022,400	
	1 3 2 5年国債	680,000,000	686,582,400	
	1 3 3 5年国債	430,000,000	434,510,700	
	1 3 4 5年国債	610,000,000	617,002,800	
	1 3 5 5年国債	880,000,000	890,824,000	
	1 3 6 5年国債	700,000,000	709,338,000	
	1 3 7 5年国債	400,000,000	405,672,000	
	1 3 8 5年国債	650,000,000	659,763,000	
	1 3 9 5年国債	620,000,000	629,827,000	
	1 4 0年国債	70,000,000	109,055,100	
	2 4 0年国債	110,000,000	166,633,500	
	3 4 0年国債	74,000,000	113,267,360	
	4 4 0年国債	107,000,000	165,220,840	
	5 4 0年国債	125,000,000	187,256,250	
	6 4 0年国債	105,000,000	155,301,300	
7 4 0年国債	121,000,000	172,414,110		

8	40年国債	230,000,000	307,229,400	
9	40年国債	220,000,000	220,352,000	
10	40年国債	375,000,000	440,835,000	
11	40年国債	320,000,000	365,398,400	
12	40年国債	80,000,000	82,601,600	
310	10年国債	130,000,000	131,940,900	
311	10年国債	150,000,000	151,861,500	
312	10年国債	700,000,000	714,700,000	
313	10年国債	200,000,000	205,260,000	
314	10年国債	260,000,000	265,922,800	
315	10年国債	221,000,000	227,227,780	
316	10年国債	250,000,000	256,542,500	
317	10年国債	214,000,000	220,332,260	
318	10年国債	200,000,000	205,464,000	
319	10年国債	100,000,000	103,288,000	
320	10年国債	230,000,000	236,982,800	
321	10年国債	175,000,000	180,864,250	
322	10年国債	130,000,000	133,996,200	
324	10年国債	410,000,000	422,587,000	
325	10年国債	310,000,000	320,319,900	
326	10年国債	30,000,000	30,975,300	
327	10年国債	450,000,000	466,218,000	
328	10年国債	350,000,000	360,927,000	
329	10年国債	500,000,000	520,710,000	
330	10年国債	612,000,000	638,964,720	
331	10年国債	365,000,000	377,942,900	
332	10年国債	400,000,000	415,116,000	
333	10年国債	780,000,000	811,106,400	
334	10年国債	800,000,000	833,616,000	
335	10年国債	780,000,000	810,295,200	
336	10年国債	275,000,000	286,195,250	
337	10年国債	300,000,000	308,868,000	
338	10年国債	490,000,000	507,850,700	
339	10年国債	680,000,000	705,867,200	
340	10年国債	770,000,000	800,538,200	
341	10年国債	440,000,000	455,250,400	
342	10年国債	830,000,000	848,492,400	
343	10年国債	830,000,000	849,197,900	
344	10年国債	700,000,000	716,779,000	

345	10年国債	630,000,000	645,384,600
346	10年国債	800,000,000	819,864,000
347	10年国債	330,000,000	338,190,600
348	10年国債	600,000,000	614,850,000
349	10年国債	800,000,000	819,704,000
350	10年国債	670,000,000	686,374,800
351	10年国債	600,000,000	614,532,000
352	10年国債	630,000,000	644,779,800
353	10年国債	550,000,000	562,716,000
354	10年国債	380,000,000	388,633,600
1	30年国債	16,000,000	20,776,480
2	30年国債	24,000,000	30,442,080
3	30年国債	30,000,000	37,865,700
4	30年国債	36,000,000	48,258,000
5	30年国債	28,000,000	35,533,400
6	30年国債	24,000,000	31,253,520
7	30年国債	55,000,000	71,390,550
8	30年国債	27,000,000	33,459,480
9	30年国債	43,000,000	50,993,270
10	30年国債	45,000,000	51,594,750
11	30年国債	40,000,000	49,282,000
12	30年国債	60,000,000	77,467,200
13	30年国債	75,000,000	95,994,000
14	30年国債	82,000,000	110,060,400
15	30年国債	100,000,000	136,084,000
16	30年国債	100,000,000	136,477,000
17	30年国債	80,000,000	108,261,600
18	30年国債	80,000,000	107,296,000
19	30年国債	57,000,000	76,694,070
20	30年国債	60,000,000	82,903,200
21	30年国債	60,000,000	81,171,000
22	30年国債	70,000,000	97,281,100
23	30年国債	60,000,000	83,589,000
24	30年国債	92,000,000	128,584,720
25	30年国債	150,000,000	205,014,000
26	30年国債	180,000,000	249,820,200
27	30年国債	150,000,000	211,888,500
28	30年国債	170,000,000	241,547,900
29	30年国債	200,000,000	281,852,000

3 0	3 0 年国債	220,000,000	307,498,400	
3 1	3 0 年国債	180,000,000	249,357,600	
3 2	3 0 年国債	235,000,000	332,012,700	
3 3	3 0 年国債	311,000,000	422,558,810	
3 4	3 0 年国債	233,000,000	327,751,780	
3 5	3 0 年国債	195,000,000	267,231,900	
3 6	3 0 年国債	270,000,000	371,722,500	
3 7	3 0 年国債	300,000,000	407,901,000	
3 8	3 0 年国債	190,000,000	255,173,800	
3 9	3 0 年国債	172,000,000	235,469,720	
4 0	3 0 年国債	140,000,000	188,764,800	
4 1	3 0 年国債	170,000,000	225,618,900	
4 2	3 0 年国債	176,000,000	234,124,000	
4 3	3 0 年国債	170,000,000	226,412,800	
4 4	3 0 年国債	165,000,000	220,268,400	
4 5	3 0 年国債	200,000,000	257,474,000	
4 6	3 0 年国債	140,000,000	180,594,400	
4 7	3 0 年国債	210,000,000	276,523,800	
4 8	3 0 年国債	250,000,000	316,935,000	
4 9	3 0 年国債	93,000,000	118,118,370	
5 0	3 0 年国債	215,000,000	240,430,200	
5 1	3 0 年国債	240,000,000	237,624,000	
5 2	3 0 年国債	235,000,000	244,684,350	
5 3	3 0 年国債	200,000,000	213,348,000	
5 4	3 0 年国債	218,000,000	244,048,820	
5 5	3 0 年国債	200,000,000	224,098,000	
5 6	3 0 年国債	210,000,000	235,206,300	
5 7	3 0 年国債	230,000,000	257,830,000	
5 8	3 0 年国債	300,000,000	336,144,000	
5 9	3 0 年国債	200,000,000	218,432,000	
6 0	3 0 年国債	180,000,000	206,548,200	
6 1	3 0 年国債	200,000,000	218,428,000	
6 2	3 0 年国債	150,000,000	155,434,500	
4 7	2 0 年国債	89,000,000	91,680,680	
4 8	2 0 年国債	54,000,000	56,198,880	
4 9	2 0 年国債	64,000,000	66,592,000	
5 0	2 0 年国債	107,000,000	110,955,790	
5 1	2 0 年国債	82,000,000	85,636,700	
5 2	2 0 年国債	52,000,000	54,721,680	

5 3	2 0 年国債	66,000,000	69,833,280	
5 4	2 0 年国債	65,000,000	68,939,000	
5 5	2 0 年国債	140,000,000	148,576,400	
5 8	2 0 年国債	200,000,000	213,876,000	
5 9	2 0 年国債	45,000,000	48,053,250	
6 0	2 0 年国債	10,000,000	10,572,500	
6 1	2 0 年国債	100,000,000	104,637,000	
6 2	2 0 年国債	95,000,000	98,934,900	
6 3	2 0 年国債	130,000,000	140,611,900	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	98,220,600	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	191,887,500	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	202,010,750	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	60,600,650	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	133,948,800	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	122,258,400	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	94,005,800	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	140,310,000	
7 2	2 0 年国債	175,000,000	196,595,000	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	134,850,000	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	82,440,360	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	90,788,000	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	57,283,200	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	146,773,900	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	68,848,870	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	56,738,000	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	60,464,520	
8 1	2 0 年国債	76,000,000	86,677,240	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	99,774,210	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	107,207,610	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	67,177,920	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	93,755,200	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	64,079,950	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	117,846,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	91,365,300	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	23,552,200	
9 1	2 0 年国債	60,000,000	71,098,800	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	364,476,300	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	117,326,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	153,546,900	

9 5	2 0 年国債	50,000,000	60,120,500	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	65,238,250	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	47,999,600	
9 8	2 0 年国債	120,000,000	142,993,200	
9 9	2 0 年国債	150,000,000	179,467,500	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	187,557,750	
1 0 1	2 0 年国債	75,000,000	92,085,750	
1 0 2	2 0 年国債	80,000,000	98,667,200	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	208,115,700	
1 0 4	2 0 年国債	10,000,000	12,059,400	
1 0 5	2 0 年国債	126,000,000	152,471,340	
1 0 6	2 0 年国債	150,000,000	182,920,500	
1 0 7	2 0 年国債	90,000,000	109,318,500	
1 0 8	2 0 年国債	277,000,000	331,125,800	
1 0 9	2 0 年国債	55,000,000	65,964,250	
1 1 0	2 0 年国債	260,000,000	316,963,400	
1 1 1	2 0 年国債	50,000,000	61,716,000	
1 1 2	2 0 年国債	150,000,000	183,630,000	
1 1 3	2 0 年国債	200,000,000	245,728,000	
1 1 4	2 0 年国債	70,000,000	86,306,500	
1 1 5	2 0 年国債	180,000,000	223,840,800	
1 1 6	2 0 年国債	140,000,000	174,717,200	
1 1 7	2 0 年国債	215,000,000	265,980,800	
1 1 8	2 0 年国債	95,000,000	116,874,700	
1 1 9	2 0 年国債	93,000,000	112,350,510	
1 2 0	2 0 年国債	210,000,000	249,032,700	
1 2 1	2 0 年国債	170,000,000	207,882,800	
1 2 2	2 0 年国債	160,000,000	193,840,000	
1 2 3	2 0 年国債	200,000,000	249,910,000	
1 2 4	2 0 年国債	193,000,000	238,928,210	
1 2 5	2 0 年国債	85,000,000	107,610,850	
1 2 6	2 0 年国債	110,000,000	136,659,600	
1 2 7	2 0 年国債	165,000,000	203,039,100	
1 2 8	2 0 年国債	119,000,000	146,849,570	
1 2 9	2 0 年国債	230,000,000	281,050,800	
1 3 0	2 0 年国債	140,000,000	171,519,600	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	97,026,400	
1 3 2	2 0 年国債	320,000,000	389,008,000	
1 3 3	2 0 年国債	230,000,000	282,483,700	

1 3 4	2 0 年国債	80,000,000	98,490,400	
1 3 5	2 0 年国債	92,000,000	112,089,120	
1 3 6	2 0 年国債	200,000,000	241,118,000	
1 3 7	2 0 年国債	70,000,000	85,476,300	
1 3 8	2 0 年国債	87,000,000	103,971,960	
1 3 9	2 0 年国債	235,000,000	283,898,800	
1 4 0	2 0 年国債	335,000,000	409,956,250	
1 4 1	2 0 年国債	200,000,000	245,260,000	
1 4 2	2 0 年国債	200,000,000	247,954,000	
1 4 3	2 0 年国債	210,000,000	255,158,400	
1 4 4	2 0 年国債	200,000,000	240,268,000	
1 4 5	2 0 年国債	380,000,000	468,179,000	
1 4 6	2 0 年国債	230,000,000	283,923,500	
1 4 7	2 0 年国債	250,000,000	305,587,500	
1 4 8	2 0 年国債	330,000,000	399,201,000	
1 4 9	2 0 年国債	252,000,000	305,282,880	
1 5 0	2 0 年国債	250,000,000	299,515,000	
1 5 1	2 0 年国債	370,000,000	432,478,200	
1 5 2	2 0 年国債	350,000,000	409,391,500	
1 5 3	2 0 年国債	400,000,000	474,864,000	
1 5 4	2 0 年国債	400,000,000	468,888,000	
1 5 5	2 0 年国債	275,000,000	313,662,250	
1 5 6	2 0 年国債	230,000,000	239,591,000	
1 5 7	2 0 年国債	400,000,000	402,980,000	
1 5 8	2 0 年国債	100,000,000	105,709,000	
1 5 9	2 0 年国債	280,000,000	300,722,800	
1 6 0	2 0 年国債	270,000,000	294,659,100	
1 6 1	2 0 年国債	280,000,000	300,507,200	
1 6 2	2 0 年国債	300,000,000	321,702,000	
1 6 3	2 0 年国債	290,000,000	310,978,600	
1 6 4	2 0 年国債	370,000,000	389,709,900	
1 6 5	2 0 年国債	330,000,000	347,169,900	
1 6 6	2 0 年国債	300,000,000	326,904,000	
1 6 7	2 0 年国債	300,000,000	315,414,000	
1 6 8	2 0 年国債	200,000,000	206,228,000	
2 7	メキシコ国債	100,000,000	101,010,000	
1 1	フィリピン共和国	100,000,000	102,984,400	
国債証券 合計			69,574,913,070	
地方債証券	6 8 8 東京都公債	100,000,000	101,194,900	

6 9 9	東京都公債	100,000,000	102,381,900	
7 1 3	東京都公債	100,000,000	102,640,900	
7 5 1	東京都公債	100,000,000	102,554,300	
1 6	東京都 2 0 年	100,000,000	118,651,600	
2 4 - 1	北海道公債	100,000,000	102,884,600	
2 4 - 6	北海道公債	100,000,000	102,768,300	
3 1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	111,816,700	
3 6 1	大阪府公債	100,000,000	102,836,000	
4 2 0	大阪府公債	200,000,000	202,259,400	
2 2 - 5	京都府公債	100,000,000	101,928,600	
2 4 - 5	京都府公債	100,000,000	102,790,700	
2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	102,713,700	
3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	206,710,400	
1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	119,027,300	
2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	102,970,200	
2 1 - 5	愛知県公債	100,000,000	122,242,500	
2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	102,902,700	
2 9 - 5	広島県公債	100,000,000	101,793,500	
4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	121,511,900	
2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	101,465,000	
1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	119,265,100	
9 0	共同発行地方	100,000,000	101,433,600	
1 0 8	共同発行地方	100,000,000	102,879,600	
1 1 7	共同発行地方	100,000,000	102,688,900	
1 2 6	共同発行地方	100,000,000	103,638,200	
1 3 1	共同発行地方	100,000,000	103,277,800	
2 3 - 2	島根県公債	100,000,000	102,591,900	
2 5 - 6	大阪市公債	200,000,000	206,515,200	
2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	120,842,200	
2 4 - 1 0	神戸市公債	100,000,000	102,788,900	
2 4 - 3	横浜市公債	100,000,000	102,720,600	
2 4 - 5	札幌市公債	100,000,000	102,577,000	
4	川崎市公債 3 0 年	100,000,000	136,506,200	
2 3 - 4	福岡市 2 0 年	100,000,000	121,090,000	
2 4 - 4	福井県公債	100,000,000	101,946,700	
2 2 - 1	岡山県公債	100,000,000	101,549,600	
地方債証券 合計			4,268,356,600	
特殊債券	1 9 政保政策投資 C	100,000,000	103,001,800	
	8 1 道路機構	100,000,000	102,644,100	

	8 6 政保道路機構	100,000,000	120,421,400	
	1 1 0 政保道路機構	100,000,000	101,457,100	
	1 6 8 政保道路機構	100,000,000	102,979,800	
	1 7 3 政保道路機構	100,000,000	103,101,000	
	1 7 5 政保道路機構	100,000,000	103,099,500	
	1 8 6 政保道路機構	100,000,000	103,002,000	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	102,926,900	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	119,242,100	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	102,404,600	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	206,324,800	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	197,973,800	
	3 公営企業 1 5 年	100,000,000	104,433,500	
	2 9 地方公共団体	100,000,000	102,481,600	
	3 3 地方公共団体	100,000,000	102,862,800	
	3 9 政保地方公共団	100,000,000	102,903,600	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	110,673,600	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	110,944,600	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	103,334,900	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	103,662,100	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	120,935,500	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	102,930,600	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	102,708,200	
	2 5 日本政策金融	100,000,000	102,950,700	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	103,505,400	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,870,500	
	特殊債券 合計		3,042,776,500	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,214,100	
	1 7 シテイグループ・インク	100,000,000	102,359,700	
	9 A U S T ・ N Z 銀行	100,000,000	100,286,300	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	103,346,700	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	103,362,900	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	101,284,900	
	5 野村不動産HD	100,000,000	104,037,300	
	1 1 セブンアンドアイ	100,000,000	101,460,700	
	4 J Xホールディングス	100,000,000	103,787,900	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,959,900	
	1 5 デンソー	100,000,000	100,749,600	
	7 凸版印刷	100,000,000	108,814,300	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	103,208,800	

2 0	東京三菱銀行	100,000,000	102,865,300	
9	三菱UFJ信託BK劣	100,000,000	103,071,800	
1 1	三菱UFJ信託BK	100,000,000	103,657,200	
1 5	トヨタファイナンス	100,000,000	102,092,500	
7 8	トヨタファイナンス	100,000,000	100,960,500	
2	イオンFS	100,000,000	100,826,200	
1 7 5	オリックス	100,000,000	104,206,700	
4 4	野村ホールディング	100,000,000	101,081,500	
1 8	エヌティティ都市開	100,000,000	108,165,000	
7 2	東日本旅客鉄道	100,000,000	101,957,900	
1 0 7	東日本旅客鉄	100,000,000	121,210,800	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	119,489,200	
5 0 9	関西電力	100,000,000	101,358,700	
3 7 2	中国電力	100,000,000	103,834,900	
3 3 2	北海道電力	100,000,000	104,587,100	
1 1	東京電力パワー	100,000,000	99,782,800	
3 0	大阪瓦斯	100,000,000	102,718,000	
4	ファーストリテイリング	100,000,000	103,831,500	
社債券 合計			3,220,570,700	
合計			80,106,616,870	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年6月16日から2019年6月17日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,896,881	-
コール・ローン	263,769,854	372,641,014
親投資信託受益証券	61,096,056,167	72,778,781,170
未収入金	-	13,020,670
流動資産合計	61,362,722,902	73,164,442,854
資産合計	61,362,722,902	73,164,442,854
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,344,219	174,650,664
未払受託者報酬	5,970,110	7,432,520
未払委託者報酬	107,462,900	133,786,207
その他未払費用	1,061,497	1,094,942
流動負債合計	207,838,726	316,964,333
負債合計	207,838,726	316,964,333
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 64,540,834,408	¹ 73,543,593,762
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 3,385,950,232	² 696,115,241
（分配準備積立金）	271,363,864	2,374,884,429
元本等合計	61,154,884,176	72,847,478,521
純資産合計	61,154,884,176	72,847,478,521
負債純資産合計	61,362,722,902	73,164,442,854

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		-		34
有価証券売買等損益		950,083,529		3,392,901,979
営業収益合計		950,083,529		3,392,902,013
営業費用				
支払利息		91,737		162,917
受託者報酬		10,254,157		14,585,465
委託者報酬		184,576,423		262,540,263
その他費用		2,166,670		2,186,760
営業費用合計		197,088,987		279,475,405
営業利益又は営業損失（ ）		1,147,172,516		3,113,426,608
経常利益又は経常損失（ ）		1,147,172,516		3,113,426,608
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,147,172,516		3,113,426,608
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		103,035,585		142,424,968
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,007,882,132		3,385,950,232
剰余金増加額又は欠損金減少額		382,215,491		953,602,457
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		382,215,491		953,602,457
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,716,146,660		1,234,769,106
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,716,146,660		1,234,769,106
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,385,950,232		696,115,241

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	34,752,986,225円	64,540,834,408円
期中追加設定元本額	41,568,085,908円	27,255,813,662円
期中一部解約元本額	11,780,237,725円	18,253,054,308円
2. 計算期間末日における受益権の総数	64,540,834,408口	73,543,593,762口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,385,950,232円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は696,115,241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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(371,049,308円)及び分配準備積立金(271,363,864円)より分配対象額は642,413,172円(1万口当たり99.54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(2,165,508,764円)、投資信託約款に規定される収益調整金(522,621,308円)及び分配準備積立金(209,375,665円)より分配対象額は2,897,505,737円(1万口当たり393.98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6月16日 至 2019年6月17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	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6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17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	922,297,063	3,326,062,303
合計	922,297,063	3,326,062,303

(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6月15日現在	第3期 2019年6月17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6月16日 至 2019年6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9475円 (9,475円)	0.9905円 (9,905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	72,662,521,137	72,778,781,170	
親投資信託受益証券 合計			72,778,781,170	
合計			72,778,781,170	

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6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	284,212,058	222,122,908
金銭信託	32,356,713	-
コール・ローン	2,946,177,671	1,814,269,093
国債証券	62,822,098,221	86,713,568,595
派生商品評価勘定	28,448,168	20,454,927
未収利息	420,542,318	561,770,663
前払費用	54,845,725	44,471,503
差入委託証拠金	68,896,960	123,414,598
流動資産合計	66,657,577,834	89,500,072,287
資産合計	66,657,577,834	89,500,072,287
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	856,003,067	365,925,981
未払解約金	-	123,178,918
その他未払費用	24,246	-
流動負債合計	856,027,313	489,104,899
負債合計	856,027,313	489,104,899
純資産の部		
元本等		
元本	1 68,969,365,389	88,872,666,940
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 3,167,814,868	138,300,448
元本等合計	65,801,550,521	89,010,967,388
純資産合計	65,801,550,521	89,010,967,388
負債純資産合計	66,657,577,834	89,500,072,287

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6月16日 至 2019年6月17日
-----	------------------------------

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</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>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。 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>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首 期首元本額	2017年6月16日 35,493,735,600円	2018年6月16日 68,969,365,389円

期中追加設定元本額	37,519,095,983円	30,384,881,483円
期中一部解約元本額	4,043,466,194円	10,481,579,932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)	64,035,275,304円	72,662,521,137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)	3,469,288,196円	3,492,377,916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)	1,464,801,889円	12,717,767,887円
計	68,969,365,389円	88,872,666,940円
2. 期末日における受益権の総数	68,969,365,389口	88,872,666,940口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,167,814,868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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,620,326,653	3,330,070,609
合計	1,620,326,653	3,330,070,609

(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6月16日から2018年6月15日まで、及び2018年6月16日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買 建	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155	1,217,042,947	-	1,219,378,229	2,335,282
合計	1,379,467,016	-	1,382,383,171	2,916,155	1,217,042,947	-	1,219,378,229	2,335,282

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2018年6月15日 現在				2019年6月17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	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054	87,125,941,574	-	87,473,747,910	347,806,336
アメリカ・ドル	27,240,290,248	-	27,771,494,530	531,204,282	41,806,504,464	-	41,885,690,500	79,186,036
イギリス・ポンド	4,503,775,286	-	4,569,338,340	65,563,054	5,764,866,522	-	5,762,815,540	2,050,982

オーストラ リア・ドル	1,364,464,868	-	1,370,891,860	6,426,992	1,767,496,665	-	1,757,111,700	10,384,965
カナダ・ドル	1,414,734,319	-	1,424,666,220	9,931,901	1,732,183,922	-	1,748,168,100	15,984,178
シンガポ ール・ドル	250,268,736	-	253,360,600	3,091,864	308,189,983	-	309,912,240	1,722,257
スイス・ フラン	92,555,627	-	92,865,150	309,523	-	-	-	-
スウェー デン・クロー ナ	250,277,496	-	257,084,960	6,807,464	377,567,308	-	379,063,700	1,496,392
デンマー ク・クロー ネ	352,938,868	-	355,556,360	2,617,492	421,688,519	-	424,662,720	2,974,201
ノルウェ ー・クロー ネ	190,273,514	-	194,805,100	4,531,586	181,719,881	-	182,984,780	1,264,899
ポーランド ・ズロチ	407,585,909	-	414,309,400	6,723,491	493,400,120	-	500,067,690	6,667,570
マレーシ ア・リンギ ット	278,648,216	-	283,686,480	5,038,264	293,046,504	-	293,167,200	120,696
メキシコ ・ペソ	482,197,808	-	471,812,560	10,385,248	581,335,800	-	597,840,000	16,504,200
ユーロ	25,723,592,209	-	25,936,968,900	213,376,691	32,958,046,665	-	33,197,918,160	239,871,495
南アフリ カ・ラン ド	367,021,642	-	352,255,340	14,766,302	439,895,221	-	434,345,580	5,549,641
合計	62,918,624,746	-	63,749,095,800	830,471,054	87,125,941,574	-	87,473,747,910	347,806,336

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	0.9541円	1.0016円
（1万口当たり純資産額）	（9,541円）	（10,016円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	32,370,000.000	32,672,012.100	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	10,040,000.000	10,321,120.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	18,946,000.000	19,031,067.540	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	14,500,000.000	14,404,735.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	14,020,000.000	13,976,117.400	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	24,540,000.000	24,502,453.800	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	6,310,000.000	6,478,098.400	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	12,905,000.000	13,399,906.750	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	5,201,150.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	12,580,000.000	12,961,299.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	22,990,000.000	23,115,525.400	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	2,800,000.000	3,293,052.000	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	6,750,000.000	8,877,802.500			

5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	1,000,000.000	1,285,310.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,700,000.000	3,428,784.000	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,800,000.000	5,326,232.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,506,516.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	6,030,000.000	7,095,139.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	410,000.000	540,589.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	490,000.000	666,703.800	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,770,000.000	2,454,901.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,970,000.000	3,287,641.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	9,600,000.000	10,158,720.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,314,500.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,085,267.320	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,195,930.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	3,679,488.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,190,000.000	3,520,452.100	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	11,810,000.000	12,033,209.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	15,450,000.000	15,422,190.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	8,300,000.000	8,397,857.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,570,000.000	1,698,049.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	9,820,000.000	9,864,484.600	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	16,720,000.000	16,680,708.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,700,000.000	8,861,037.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,300,000.000	2,488,485.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	2,000,000.000	1,958,420.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,165,000.000	5,051,989.800	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,070,000.000	2,033,443.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	2,500,000.000	2,421,275.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	2,350,000.000	2,352,937.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,480,000.000	2,621,434.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,370,000.000	3,432,378.700	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	5,000,000.000	5,005,850.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	3,350,000.000	3,441,321.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,434,387.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	1,500,000.000	1,526,010.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,200,000.000	3,239,744.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	6,310,000.000	6,499,300.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,800,000.000	1,857,654.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	5,300,000.000	5,868,902.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	7,900,000.000	8,425,824.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	5,500,000.000	5,577,550.000	

	3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,622,805.000	
	3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	950,000.000	1,103,558.000	
	3% United States Treasury Note/Bond 20490215	2,650,000.000	2,871,937.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 381,573,257.210 (41,461,750,128)	
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	812,160.000	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,160,000.000	1,622,028.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,725,000.000	1,822,169.250	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	249,525.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	200,000.000	202,960.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	720,000.000	770,184.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000	1,226,610.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,050,000.000	1,090,666.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	856,016.000	
	8% United Kingdom Gilt 20210607	1,000,000.000	1,145,960.000	
	6% United Kingdom Gilt 20281207	863,000.000	1,270,853.800	
	4.25% United Kingdom Gilt 20320607	700,000.000	970,970.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	175,000.000	217,836.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,565,000.000	2,276,918.500	
	4.75% United Kingdom Gilt 20381207	200,000.000	318,620.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	450,000.000	821,025.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	620,000.000	1,015,684.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	600,000.000	773,262.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	411,000.000	666,436.500	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,283,749.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	2,243,000.000	3,812,651.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,630,000.000	2,471,080.000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,040,000.000	1,136,959.200	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	787,000.000	1,437,691.600	
	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,500,000.000	1,556,175.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	742,000.000	794,132.920	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	1,380,000.000	1,432,219.200	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,425,000.000	1,961,940.000	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,290,000.000	2,447,964.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	748,900.000	1,327,350.360	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,900,000.000	2,107,157.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,290,000.000	1,859,664.000	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 41,758,619.430 (5,710,491,207)	
オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	1,770,000.000	1,928,485.800	オーストラリア・ドル

5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,080,000.000	1,235,638.800	
5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,383,000.000	1,617,404.670	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,089,000.000	1,371,726.180	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	656,000.000	708,775.200	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	920,000.000	1,078,644.800	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,200,000.000	1,343,736.000	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	859,000.000	1,178,333.250	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	998,000.000	1,197,609.980	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	952,033.750	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	400,000.000	403,988.000	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	849,418.560	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,449,331.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,158,000.000	2,322,288.540	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	475,000.000	575,804.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	500,000.000	560,955.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	2,300,000.000	2,397,451.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,400,000.000	1,584,478.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	500,000.000	555,400.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 23,311,503.030 (1,742,068,621)	
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	821,133.200	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,264,657.310	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	450,000.000	686,506.500	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	848,000.000	1,288,044.160	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	370,000.000	525,440.700	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	5,820,000.000	5,922,257.400	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	400,000.000	416,100.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,040,000.000	1,440,618.400	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,238,000.000	1,245,700.360	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	230,000.000	242,937.500	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	300,000.000	372,780.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	592,000.000	622,422.880	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	820,000.000	826,232.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,959,000.000	1,932,847.350	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	901,728.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,240,000.000	1,211,926.400	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	629,070.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	300,000.000	304,455.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,042,130.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 21,696,987.160 (1,757,455,960)	

シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	シンガポール・ドル 203,000.000	シンガポール・ドル 226,751.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	1,000,000.000	1,043,900.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	159,120.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	300,000.000	324,300.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	390,000.000	394,130.100	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	89,000.000	95,274.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	207,960.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	120,000.000	137,752.800	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	413,400.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	350,486.400	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	204,040.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	260,826.800	
シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 3,817,941.600 (302,610,051)		
スウェーデン・クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 2,780,000.000	スウェーデン・クローナ 3,008,377.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	1,920,000.000	2,998,368.000	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	12,950,000.000	14,531,454.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,525,367.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,368,046.000	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	2,280,000.000	2,486,704.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,741,071.500	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 32,659,388.800 (373,950,002)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,140,000.000	9,758,804.000	デンマーク・クローネ
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,310,000.000	2,518,131.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,925,519.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,330,000.000	2,677,309.800	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,601,700.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	2,200,000.000	2,229,722.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 25,711,185.800 (419,606,552)	
ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	2,620,000.000	2,750,214.000	ノルウェー・クローネ
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,150,000.000	1,186,662.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,408,589.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	154,647.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,452,022.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,093,090.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,206,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ	

			14,251,224.000 (177,997,788)	
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	1,350,756.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	640,000.000	650,400.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,000,000.000	2,018,400.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	1,520,000.000	1,524,164.800	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,839,230.250	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	800,000.000	813,192.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,072,870.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	779,826.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	772,543.900	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,500,000.000	1,547,475.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	1,430,000.000	1,522,992.900	
ポーランド・ズロチ	小計		ポーランド・ズロチ 15,891,850.850 (454,983,690)	
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	1,855,568.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,264,237.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	600,000.000	590,106.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,171,528.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,113,706.000	

	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	600,000.000	607,596.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,478,489.800	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	400,000.000	402,512.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,049,520.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,076,230.000	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 11,609,493.300 (302,195,111)	
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	8,314,684.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	11,509,196.500	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,843,324.200	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	7,032,391.400	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	4,800,000.000	4,766,112.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,315,950.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,877,715.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,296,700.000	
	8% Mexican Bonos 20200611	5,500,000.000	5,506,490.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	13,700,000.000	13,388,599.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	2,700,000.000	2,705,697.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	8,900,000.000	8,632,644.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	4,750,000.000	4,659,037.500	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	10,266,319.000	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 99,114,859.600 (561,981,254)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	202,876.300	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	189,428.400	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	220,000.000	263,285.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	210,326.000	

1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	167,424.000	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	525,155.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	840,000.000	922,210.800	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,290,000.000	1,381,848.000	
1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	143,294.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	400,000.000	421,068.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	643,542.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	670,000.000	713,677.300	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,022,000.000	1,103,279.660	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	610,000.000	732,305.000	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	644,271.950	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	564,000.000	641,397.720	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	120,000.000	152,227.200	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	411,584.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,730,000.000	1,850,269.600	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	522,405.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	399,239.700	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,280,000.000	1,366,720.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	553,310.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	100,000.000	114,864.000	

6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	855,000.000	1,339,254.900	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,219,392.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,496,000.000	2,544,172.400	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,060,000.000	1,770,019.800	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	970,000.000	1,673,075.400	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	890,000.000	1,504,909.900	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	720,000.000	1,308,391.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	610,000.000	1,194,648.400	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	806,000.000	1,361,994.920	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,658,652.300	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,548,000.000	2,394,879.840	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,243,242.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,624,425.200	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	500,000.000	556,400.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	725,000.000	1,145,130.250	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,094,633.100	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	200,000.000	216,826.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,263,387.300	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	1,800,000.000	1,974,258.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	943,547.310	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	950,000.000	982,756.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	700,000.000	737,436.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	700,000.000	752,262.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	960,000.000	1,209,120.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	450,000.000	484,011.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,300,000.000	1,367,496.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	3,440,000.000	3,482,415.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,700,000.000	1,721,641.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,800,000.000	1,829,646.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,500,000.000	1,529,835.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	500,000.000	511,515.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	150,000.000	153,931.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,028,460.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	514,755.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,415,000.000	3,391,046.400	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,000,000.000	1,538,790.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,700,000.000	2,916,469.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,310,000.000	2,173,499.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,532,000.000	2,851,480.960	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	650,000.000	703,157.000	

4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,722,019.800	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,452,732.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,043,000.000	1,841,009.730	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	1,040,000.000	1,312,781.600	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	4,270,000.000	4,451,432.300	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,314,000.000	3,618,390.900	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	1,900,000.000	2,097,163.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,910,000.000	2,371,226.800	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,195,000.000	3,500,985.150	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	2,077,804.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	2,730,000.000	2,978,784.900	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,200,000.000	2,495,768.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,486,000.000	3,116,026.980	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,360,000.000	1,520,140.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,100,000.000	2,205,000.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	2,200,000.000	2,312,222.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,070,000.000	1,104,240.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,300,000.000	2,751,766.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,526,000.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,300,000.000	1,634,334.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,200,000.000	1,224,624.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	1,300,000.000	1,389,908.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,100,000.000	2,339,316.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	1,950,000.000	2,081,332.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	1,200,000.000	1,224,996.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	500,000.000	560,280.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	1,200,000.000	1,248,384.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	869,686.800	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	655,000.000	1,089,029.200	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,356,158.700	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	175,000.000	182,813.750	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	630,000.000	1,110,557.700	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	2,100,000.000	2,272,578.000	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	500,000.000	545,205.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	590,000.000	784,074.600	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	822,022.500	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	740,000.000	1,205,178.800	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	380,000.000	428,887.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	718,434.900	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	670,000.000	710,220.100	

0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	470,000.000	508,206.300	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	409,772.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	650,874.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	600,000.000	620,286.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,600,000.000	2,182,272.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,135,000.000	2,861,412.400	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,600,000.000	1,673,280.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	705,000.000	724,436.850	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	910,165.200	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	500,000.000	507,320.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	800,000.000	810,712.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,200,000.000	1,189,656.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	750,000.000	704,452.500	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,400,000.000	1,363,992.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	3,000,000.000	2,982,840.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	900,000.000	803,592.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,279,941.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	500,000.000	509,035.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,500,000.000	1,513,410.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	350,000.000	368,483.500	

0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	697,921.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	500,000.000	500,130.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,000,000.000	2,107,780.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	200,000.000	220,910.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,063,530.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,012,980.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	740,000.000	936,743.800	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,288,000.000	1,750,546.560	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,351,500.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,450,000.000	1,855,942.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	770,000.000	891,806.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,118,158.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,170,000.000	2,469,915.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	1,700,000.000	2,004,555.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,114,000.000	1,431,389.740	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	3,050,000.000	3,193,594.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	1,850,000.000	2,160,633.500	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	3,250,000.000	3,439,897.500	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	1,320,000.000	1,439,182.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	780,000.000	866,502.000	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	2,770,000.000	3,169,212.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	80,000.000	97,977.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,375,000.000	1,735,332.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	830,000.000	943,046.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,335,031.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,513,302.000	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	700,000.000	724,703.000	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	500,000.000	741,085.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	450,000.000	750,870.000	
4% Belgium Government Bond 20220328	550,000.000	620,950.000	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	534,000.000	563,701.080	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	665,000.000	1,114,307.250	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	300,000.000	396,414.000	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	846,865.700	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	437,028.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,112,640.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	340,000.000	559,487.000	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	921,152.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	407,535.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	909,006.240	
5% IRISH TREASURY 20201018	910,000.000	977,785.900	

3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	488,548.200	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	600,000.000	707,124.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	826,261.200	
2% IRISH TREASURY 20450218	310,000.000	377,890.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	320,000.000	343,737.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	170,000.000	193,929.200	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	532,945.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	163,017.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	578,778.000	
3.9% Austria Government Bond 20200715	480,000.000	503,140.800	
3.5% Austria Government Bond 20210915	660,000.000	721,743.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	510,000.000	831,606.000	
3.65% Austria Government Bond 20220420	400,000.000	448,624.000	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	978,275.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	620,000.000	1,268,315.400	
3.15% Austria Government Bond 20440620	380,000.000	601,870.600	
1.75% Austria Government Bond 20231020	680,000.000	747,252.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	280,000.000	362,502.000	
1.65% Austria Government Bond 20241021	280,000.000	311,038.000	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	253,612.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	150,859.200	
1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,050,217.000	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	308,221.200	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	392,189.000	

6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,320,000.000	3,540,436.000	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,400,000.000	1,531,180.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	610,000.000	698,132.800	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,865,000.000	2,110,713.750	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,000,000.000	1,017,660.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,000,000.000	1,123,270.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	389,000.000	511,978.460	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	480,000.000	713,572.800	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,749,000.000	1,889,129.880	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,250,000.000	1,275,300.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	600,000.000	657,756.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,579,063.200	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	670,000.000	732,752.200	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	950,000.000	1,036,098.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	350,000.000	444,867.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	3,000,000.000	3,026,580.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	873,360.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	280,000.000	457,038.400	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	800,000.000	1,206,224.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,300,000.000	2,186,639.000	

	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	943,000.000	1,563,616.590	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,600,000.000	1,715,680.000	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	724,000.000	803,437.280	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	600,000.000	697,236.000	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,310,000.000	2,781,886.800	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,588,000.000	1,904,869.520	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,100,000.000	1,577,587.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	890,000.000	1,600,771.800	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	700,000.000	833,658.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,397,558.640	
	ユーロ 小計		ユーロ 271,035,426.160 (33,031,087,386)	
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	8,937,558.000	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	1,200,000.000	1,204,620.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	2,610,000.000	1,821,388.500	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	2,900,000.000	2,933,205.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	15,900,000.000	14,067,048.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	5,250,000.000	4,696,492.500	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	2,850,000.000	2,639,499.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	2,300,000.000	2,045,919.000	

	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	9,700,000.000	8,886,461.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	5,000,000.000	4,674,750.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	5,300,000.000	4,880,929.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 56,787,870.000 (417,390,845)	
国債証券 合計			86,713,568,595 [86,713,568,595]	
合計			86,713,568,595 [86,713,568,595]	

- (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 56銘柄	100%	48.0%
イギリス・ポンド	国債証券 32銘柄	100%	6.6%
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 19銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	100%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券 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 11銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	100%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.6%
ユーロ	国債証券 219銘柄	100%	38.1%
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 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年6月16日から2019年6月17日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	145,644	-
コール・ローン	13,261,330	14,528,190
親投資信託受益証券	2,403,653,220	3,672,973,565
流動資産合計	2,417,060,194	3,687,501,755
資産合計	2,417,060,194	3,687,501,755
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,919,914	4,224,609
未払受託者報酬	219,671	354,656
未払委託者報酬	3,954,915	6,384,623
その他未払費用	82,394	134,302
流動負債合計	11,176,894	11,098,190
負債合計	11,176,894	11,098,190
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,246,613,872	1 3,348,730,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	159,269,428	327,672,653
（分配準備積立金）	9,444,467	62,444,006
元本等合計	2,405,883,300	3,676,403,565
純資産合計	2,405,883,300	3,676,403,565
負債純資産合計	2,417,060,194	3,687,501,755

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	2017年6月16日 至 2018年6月15日	自	2018年6月16日 至 2019年6月17日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		11,057,008		87,989,142
営業収益合計		11,057,008		87,989,143
営業費用				
支払利息		2,683		5,954
受託者報酬		387,487		650,550
委託者報酬		6,976,546		11,711,445
その他費用		145,338		244,400
営業費用合計		7,512,054		12,612,349
営業利益		3,544,954		75,376,794
経常利益		3,544,954		75,376,794
当期純利益		3,544,954		75,376,794
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		19,457,764		7,634,705
期首剰余金又は期首欠損金()		82,225,804		159,269,428
剰余金増加額又は欠損金減少額		130,190,162		140,955,221
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		130,190,162		140,955,221
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,233,728		40,294,085
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,233,728		40,294,085
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		159,269,428		327,672,653

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	1,322,658,686円	2,246,613,872円
期中追加設定元本額	1,454,615,593円	1,649,381,625円
期中一部解約元本額	530,660,407円	547,264,585円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,246,613,872口	3,348,730,912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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(149,827,806円)及び分配準備積立金(9,444,467円)より分配対象額は159,272,273円(1万口当たり708.94円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(54,700,792円)、投資信託約款に規定される収益調整金(265,234,087円)及び分配準備積立金(7,743,214円)より分配対象額は327,678,093円(1万口当たり978.51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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	5,963,032	84,061,696
合計	5,963,032	84,061,696

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0709円 (10,709円)	1.0978円 (10,978円)
---------------------------	----------------------	----------------------

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	1,314,828,554	3,672,973,565	
親投資信託受益証券 合計			3,672,973,565	
合計			3,672,973,565	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金	450,277,438	283,833,241
金銭信託	6,740,515	-
コール・ローン	613,744,470	961,052,430
国債証券	161,781,211,688	172,799,261,126
派生商品評価勘定	6,412,552	962,330
未収入金	2,107,837	210,828
未収利息	1,200,038,774	1,198,596,642
前払費用	33,324,989	36,497,176
流動資産合計	164,093,858,263	175,280,413,773
資産合計	164,093,858,263	175,280,413,773
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,138,003	2,553,600
未払金	-	1,168,600
未払解約金	94,056,724	19,756,159
その他未払費用	13,859	-
流動負債合計	95,208,586	23,478,359
負債合計	95,208,586	23,478,359
純資産の部		
元本等		
元本	1 60,439,178,019	62,737,394,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	103,559,471,658	112,519,541,306
元本等合計	163,998,649,677	175,256,935,414
純資産合計	163,998,649,677	175,256,935,414
負債純資産合計	164,093,858,263	175,280,413,773

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6月16日 至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	59,482,440,391円	60,439,178,019円
期中追加設定元本額	6,470,833,619円	6,100,976,543円
期中一部解約元本額	5,514,095,991円	3,802,760,454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	854,523,679円	654,072,209円
V A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	29,450,309円	22,454,828円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	206,824,310円	147,272,269円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	57,761,758円	41,724,252円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	662,292,154円	480,965,798円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	- 円	11,613,534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)	353,339,336円	384,151,534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)	885,845,515円	1,314,828,554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)	641,273,428円	773,960,847円
D-I's 外国債券インデッ クス	935,352円	2,268,798円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	27,099円	69,170円
iFree 外国債券イン デックス	435,441,531円	554,887,492円
iFree 8資産バランス	363,248,667円	613,821,475円
iFree 年金バランス	- 円	9,711,173円
DCダイワ外国債券インデッ クス	41,138,711,641円	43,728,026,780円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	718,124,357円	758,436,363円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	345,053,257円	377,625,094円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	224,187,800円	231,913,346円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	301,508,138円	364,075,106円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	246,918,816円	286,464,004円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	78,267,023円	93,554,489円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	11,123,826円	10,211,317円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	18,255,807円	18,516,474円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,700,379円	2,180,071円
ダイワつみたてインデックス外国債券	- 円	31,345,881円
ダイワつみたてインデックスバランス30	- 円	53,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	- 円	35,706円
ダイワつみたてインデックスバランス70	- 円	35,706円
ダイワ世界バランスファンド40VA	337,001,995円	211,467,656円
ダイワ世界バランスファンド60VA	168,856,742円	149,389,183円
ダイワ・バランスファンド35VA	6,143,693,045円	5,225,915,482円
ダイワ・ワールド・バランスファンド50VA	83,827,530円	- 円
ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA	27,516,152円	1,603,962円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	349,404,648円	308,506,848円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	139,464,733円	148,300,880円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	26,817,344円	30,702,909円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	369,220円	3,934,856円

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,470,401,280円	5,631,519,712円
ダイワライフスタイル25	35,960,613円	34,452,178円
ダイワライフスタイル50	63,227,770円	60,560,622円
ダイワライフスタイル75	17,822,765円	16,763,992円
計	60,439,178,019円	62,737,394,108円
2. 期末日における受益権の総数	60,439,178,019口	62,737,394,108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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	3,424,903,537	8,527,965,263
合計	3,424,903,537	8,527,965,263

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2017年12月1日から2018年6月15日まで、及び2018年12月1日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549	962,987,000	-	961,395,730	1,591,270
アメリカ・ドル	267,833,163	-	272,345,920	4,512,757	442,047,550	-	440,916,760	1,130,790
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	61,551,731	-	61,369,320	182,411

オーストラリア・ドル	16,985,074	-	17,065,080	80,006	3,850,994	-	3,808,170	42,824
カナダ・ドル	10,541,009	-	10,615,500	74,491	51,595,479	-	51,707,880	112,401
シンガポール・ドル	-	-	-	-	23,732,703	-	23,748,000	15,297
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	2,156,276	-	2,152,600	3,676
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	7,784,257	-	7,784,640	383
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	12,093,167	-	12,120,840	27,673
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	23,728,799	-	23,938,200	209,401
メキシコ・ペソ	15,871,398	-	15,544,320	327,078	20,124,048	-	20,366,040	241,992
ユーロ	254,923,461	-	256,439,500	1,516,039	306,243,343	-	305,431,280	812,063
南アフリカ・ランド	20,123,006	-	19,541,340	581,666	8,078,653	-	8,052,000	26,653
合計	586,277,111	-	591,551,660	5,274,549	962,987,000	-	961,395,730	1,591,270

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.7134円	2.7935円

(1万口当たり純資産額)	(27,134円)	(27,935円)
--------------	-----------	-----------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.625% United States Treasury Note/Bond 20200815	アメリカ・ドル 2,854,000.000	アメリカ・ドル 2,874,377.560	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20201115	4,509,000.000	4,551,068.970	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20210215	4,076,000.000	4,190,128.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20210515	2,551,000.000	2,610,285.240	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,534,000.000	2,549,127.980	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,162,666.970	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,239,475.200	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,454,672.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,527,894.580	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	3,168,000.000	3,147,186.240	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,376,491.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,670,335.950	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20200531	2,461,000.000	2,445,421.870	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20200630	2,131,000.000	2,127,739.570			

2% United States Treasury Note/Bond 20200731	2,827,000.000	2,826,886.920	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,689,691.520	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20200831	1,993,000.000	1,996,268.520	
2% United States Treasury Note/Bond 20200930	1,885,000.000	1,886,319.500	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201031	2,345,000.000	2,338,387.100	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,213,555.350	
2% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,501,000.000	2,503,125.850	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20201231	2,006,000.000	2,019,380.020	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,439,362.670	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210131	1,647,000.000	1,652,649.210	
2% United States Treasury Note/Bond 20210228	1,734,000.000	1,736,965.140	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	2,821,000.000	2,838,941.560	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,060,882.720	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,907,000.000	7,962,269.930	
2% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,732,000.000	2,739,349.080	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	3,485,000.000	3,504,028.100	
8.75% United States Treasury Note/Bond 20200815	642,000.000	691,677.960	
8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,408,569.020	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	769,162.860	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,070,118.000	

6.5% United States Treasury Note/Bond 20261115	630,000.000	825,344.100	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	932,498.070	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	899,717.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	937,200.960	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	773,000.000	986,262.970	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	964,000.000	1,351,180.960	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,591,000.000	2,121,121.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,326,000.000	1,735,190.340	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	747,000.000	1,044,515.160	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	718,093.720	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	691,121.160	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,249,000.000	1,469,623.360	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,453,533.440	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,419,403.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,595,397.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	2,710,000.000	3,687,280.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,478,000.000	1,950,265.340	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,591,000.000	1,968,226.100	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,909,802.830	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,754,000.000	2,432,710.300	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,805,949.600	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,367,000.000	1,662,395.030	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,606,658.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,796,579.850	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,466,516.700	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,316,915.810	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	2,630,000.000	2,727,783.400	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,326,000.000	2,567,136.420	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	3,398,000.000	3,595,763.600	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,064,000.000	3,661,480.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	3,581,000.000	4,363,484.310	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,617,000.000	4,325,678.810	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,657,000.000	4,204,964.880	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,857,663.900	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	5,162,000.000	5,288,985.200	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,629,000.000	4,004,928.110	
2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,305,319.320	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,649,903.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,171,435.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,032,906.900	

3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,696,000.000	3,993,380.160	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,889,030.300	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,192,767.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,427,000.000	2,407,268.490	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,773,954.770	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	3,763,000.000	3,705,952.920	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	1,809,000.000	1,805,743.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,886,229.850	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,856,240.520	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,835,000.000	4,147,782.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,607,507.360	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	2,826,000.000	2,831,510.700	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	3,013,000.000	2,997,452.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,001,000.000	2,989,026.010	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,846,783.940	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,135,000.000	3,121,770.300	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,179,000.000	2,190,897.340	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,769,015.790	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,573,000.000	3,776,196.510	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,449,009.800	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,868,000.000	2,847,493.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,466,190.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200930	2,876,000.000	2,853,739.760	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,948,098.400	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,116,000.000	3,092,630.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,709,000.000	4,012,952.550	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,562,374.180	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201130	3,096,000.000	3,081,944.160	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,322,835.900	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201231	3,043,000.000	3,034,905.620	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	3,492,000.000	3,528,002.520	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,126,000.000	3,099,116.400	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	5,366,000.000	5,254,440.860	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,553,982.860	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,428,000.000	3,368,524.200	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,309,000.000	3,266,313.900	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	4,262,000.000	4,211,708.400	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20210331	3,002,000.000	2,968,677.800	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,123,000.000	2,097,439.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,029,000.000	6,875,205.480	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	2,450,000.000	2,427,974.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,055,282.300	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	3,362,549.820	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20210531	2,700,000.000	2,674,674.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,480,250.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,464,450.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	2,946,540.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,600,000.000	5,423,656.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	3,246,457.200	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,642,465.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,645,647.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,715,698.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,355,744.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,457,229.650	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	2,995,639.920	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,500,000.000	5,506,875.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	2,959,200.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,477,125.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,350,000.000	3,541,050.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,519,556.300	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,400,000.000	2,395,104.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	2,000,000.000	2,009,060.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,543,350.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,340,000.000	5,438,843.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,013,521.700	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,523,573.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	3,839,660.400	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,013,973.200	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,328,382.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	5,550,000.000	5,618,931.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,906,090.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,700,000.000	5,855,382.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	3,786,825.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,004,920.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,019,680.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	2,994,360.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	2,000,000.000	2,014,840.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200615	2,700,000.000	2,686,176.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	2,995,050.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,416,104.000	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20200715	2,000,000.000	1,989,060.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,002,306.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20200815	1,300,000.000	1,292,733.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,904,292.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,037,260.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,800,000.000	3,914,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,180,224.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,000,620.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20200915	2,500,000.000	2,482,500.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,504,475.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,400,000.000	3,442,228.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20201015	1,000,000.000	995,740.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,514,250.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,591,520.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,100,000.000	3,193,000.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,566,150.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20201115	3,600,000.000	3,590,856.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20201215	2,000,000.000	1,998,500.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,238,720.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	1,300,000.000	1,324,674.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20210115	2,300,000.000	2,303,496.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,566,990.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,300,000.000	6,651,855.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20210215	2,500,000.000	2,514,350.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,393,819.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,683,278.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,823,174.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,600,000.000	3,891,060.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210315	3,200,000.000	3,226,624.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,970,673.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,014,173.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20210415	2,500,000.000	2,522,150.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,900,000.000	4,318,626.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,932,640.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210515	3,000,000.000	3,042,300.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,584,750.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,000,928.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200531	1,400,000.000	1,405,950.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	1,900,000.000	2,002,562.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,586,700.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	5,000,000.000	5,077,100.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,576,750.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20200630	3,300,000.000	3,315,972.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,142,260.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,352,437.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200731	3,300,000.000	3,322,803.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,500,000.000	2,589,825.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,000,000.000	6,402,600.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,200,000.000	4,543,854.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,547,925.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,637,100.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20200831	2,500,000.000	2,518,825.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,731,904.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,772,656.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,572,030.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	3,300,000.000	3,334,914.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,657,600.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,126,780.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,070,650.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,658,775.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20201031	3,300,000.000	3,341,118.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,172,160.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,097,960.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,400,000.000	6,969,472.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,400,000.000	5,111,216.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20201130	2,500,000.000	2,528,800.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,169,440.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	3,000,000.000	3,132,180.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,855,664.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20201231	1,000,000.000	1,008,630.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,562,460.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,583,975.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	2,000,000.000	2,033,980.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,907,296.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,052,380.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210131	3,000,000.000	3,028,230.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,114,360.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,604,675.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,600,000.000	4,985,250.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20210228	3,000,000.000	3,030,330.000	

	2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,586,500.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,378,606.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,554,250.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,547,050.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,744,067.000	
	2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,430,396.000	
	2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,300,000.000	1,376,167.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	1,500,000.000	1,537,500.000	
	2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,565,065.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,875,684.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 752,838,216.360 (81,803,400,590)	
イギリス・ポ ンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,280,000.000	2,312,854.800	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,821,000.000	1,971,924.480	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,477,000.000	2,512,569.720	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,351,940.600	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,547,523.450	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	1,300,000.000	1,297,530.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,210,000.000	1,227,908.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,200,000.000	1,283,640.000	

1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,430,000.000	1,594,593.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,110,000.000	2,191,720.300	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,012,180.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,300,000.000	2,461,046.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	930,000.000	1,037,322.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	600,000.000	610,632.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	70,000.000	75,327.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	340,000.000	362,861.600	
8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,262,847.920	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,397,497.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,858,714.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,832,316.160	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,032,000.000	2,956,356.800	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,457,000.000	2,321,146.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	3,116,246.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	2,086,000.000	3,417,285.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,587,764.640	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,596,000.000	2,587,914.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,330,000.000	1,881,418.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,523,000.000	2,588,795.400	

	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,246,000.000	1,888,936.000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,510,843.860	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,310,000.000	1,917,447.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,374,000.000	2,510,023.200	
	3.75% United Kingdom Gilt 20200907	1,795,000.000	1,862,222.750	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,422,429.700	
	3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	859,418.780	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,352,000.000	2,196,729.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,326,837.280	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,966,000.000	2,706,788.800	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,942,000.000	2,075,959.160	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,621,000.000	2,873,060.400	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,392,000.000	1,543,769.760	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,061,958.400	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 81,416,299.860 (11,133,679,006)	
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	2,636,686.800	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	2,162,000.000	2,473,565.820	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,068,000.000	2,418,505.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,589,000.000	3,261,156.180	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,671,952.850	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,304,000.000	2,701,301.760	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,698,000.000	3,021,166.440	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,358,000.000	1,862,836.500	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,848,000.000	3,417,628.480	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,461,535.950	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	557,000.000	644,816.620	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20201121	2,195,000.000	2,216,884.150	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	712,000.000	884,190.080	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	2,978,932.640	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,078,000.000	2,236,198.140	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,517,699.440	
2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	1,800,000.000	1,845,252.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,141,348.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	750,000.000	781,777.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,150,363.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,570,000.000	1,743,956.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	290,000.000	333,836.400	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 46,401,590.070 (3,467,590,826)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル

2.75% Canada Government International Bond 20641201	425,000.000	572,101.000	
8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	386,000.000	575,884.980	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,370,626.390	
5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,127,000.000	1,719,317.390	
5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,112,000.000	1,689,039.040	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	1,935,609.930	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200601	1,876,000.000	1,908,961.320	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	990,329.960	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,821,477.750	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,561,000.000	2,162,312.810	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,260,793.660	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,484,031.250	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,197,000.000	1,487,392.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,215,406.840	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200901	1,831,000.000	1,813,349.160	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,129,000.000	1,137,580.400	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210301	1,837,000.000	1,816,315.380	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	1,480,000.000	1,460,242.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,202,304.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	840,000.000	820,982.400	

	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,400,000.000	1,384,530.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,258,140.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,600,000.000	1,623,760.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	600,000.000	616,266.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	550,000.000	592,372.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20200801	300,000.000	300,951.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,100,000.000	1,182,335.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20201101	2,200,000.000	2,214,938.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	600,000.000	625,278.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210201	300,000.000	303,972.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210501	1,050,000.000	1,057,087.500	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,000,000.000	1,008,560.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	401,112.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 41,013,359.360 (3,322,082,109)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20200901	696,000.000	708,729.840	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	862,324.000	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	457,228.200	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	660,878.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	388,079.000	

	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	500,242.050	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	428,200.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	491,000.000	510,541.800	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	468,000.000	537,235.920	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	125,000.000	135,187.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	541,554.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20200701	224,000.000	224,535.360	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	568,000.000	603,261.440	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	255,050.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	455,418.400	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	200,000.000	200,244.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	300,000.000	300,954.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	200,000.000	200,200.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	580,794.500	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	190,000.000	192,226.800	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 8,742,885.210 (692,961,081)	
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	9,842,154.250	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,155,000.000	6,488,655.750	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,498,745.800	

	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	7,025,000.000	7,660,411.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,095,000.000	5,972,868.500	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,194,948.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,890,931.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	2,550,000.000	2,738,572.500	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 53,287,288.350 (610,139,451)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	11,512,000.000	デンマーク・クローネ 21,856,683.200	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	8,230,255.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,309,762.200	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	7,363,000.000	8,460,528.780	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,510,275.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20201115	1,500,000.000	1,520,265.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 53,887,769.180 (879,448,393)	
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 7,345,800.600	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	5,204,000.000	5,369,903.520	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,437,055.350	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,500,177.100	

	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,391,436.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,557,053.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,680,250.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,100,000.000	2,163,987.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 33,445,663.070 (417,736,332)	
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	2,599,079.670	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,377,000.000	3,431,876.250	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,127,000.000	2,146,568.400	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,059,359.740	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,870,000.000	2,908,314.500	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,358,256.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	2,919,226.500	
	Poland Government Bond 20200725	300,000.000	295,362.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,190,000.000	2,246,523.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	750,000.000	775,485.000	
	Poland Government Bond 20210525	800,000.000	777,064.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,074,860.170	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	2,256,000.000	2,370,582.240	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,084,000.000	1,188,226.600	

	4% Poland Government Bond 20231025	2,225,000.000	2,421,000.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	2,837,037.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,591,000.000	2,759,492.730	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 36,168,316.250 (1,035,498,895)	
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	563,820.540	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	820,139.400	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,241,965.400	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,916,000.000	1,946,445.240	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,580,010.400	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,342,380.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	875,752.500	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	739,326.090	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	627,529.560	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,003,932.930	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,403,468.770	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,180,342.780	
	3.889% MALAYSIAN GOVERNMENT 20200731	656,000.000	660,618.240	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	648,102.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,091,743.590	

4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	869,820.720	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	737,000.000	750,796.640	
3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	700,000.000	703,507.000	
3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,175,466.060	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	820,000.000	837,080.600	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	702,000.000	710,887.320	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	968,306.700	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	658,807.500	
3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	354,210.560	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	500,000.000	506,800.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	768,570.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	898,170.200	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,130,041.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,221,600.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	500,000.000	505,635.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	747,978.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	400,000.000	437,100.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	250,000.000	254,187.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	410,000.000	415,489.900	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	600,000.000	643,758.000	
マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット	

			30,283,790.640 (788,287,070)
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	13,818,643.300
	8% Mexican Bonos 20471107	7,000,000.000	7,036,190.000
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,894,400.000
	8% Mexican Bonos 20240905	4,800,000.000	4,888,032.000
	8% Mexican Bonos 20231207	20,633,000.000	20,949,303.890
	10% Mexican Bonos 20241205	22,119,000.000	24,534,615.990
	7.5% Mexican Bonos 20270603	24,168,000.000	23,997,373.920
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,700,269.200
	8.5% Mexican Bonos 20290531	14,344,000.000	15,177,529.840
	8.5% Mexican Bonos 20381118	12,194,000.000	12,917,591.960
	8% Mexican Bonos 20200611	18,928,000.000	18,950,335.040
	6.5% Mexican Bonos 20210610	27,826,000.000	27,193,515.020
	7.75% Mexican Bonos 20310529	13,015,000.000	13,042,461.650
	6.5% Mexican Bonos 20220609	24,599,000.000	23,860,046.040
	7.75% Mexican Bonos 20421113	18,654,000.000	18,296,775.900
	7.75% Mexican Bonos 20341123	6,944,000.000	6,921,293.120
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 252,178,376.870 (1,429,851,397)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0.375% Finland Government Bond 20200915	432,000.000	437,317.920
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	442,056.780
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	300,084.030
	0.5% Finland Government Bond 20260415	411,000.000	432,528.180
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,278.000
	1.375% Finland Government Bond 20470415	200,000.000	239,350.000
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	782,805.100
	0.5% Finland Government Bond 20270915	300,000.000	315,489.000

1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	412,979.200	
0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	525,155.000	
0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	522,780.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	958,440.510	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,206,171.200	
1.5% Austria Government Bond 20470220	534,000.000	637,660.080	
1.5% Austria Government Bond 20861102	150,000.000	180,766.500	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	918,612.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	580,000.000	610,548.600	
2.1% Austria Government Bond 21170920	440,000.000	676,007.200	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	407,452.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,000,000.000	1,072,570.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	300,000.000	313,707.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,490,200.810	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,124,000.000	1,213,391.720	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	558,000.000	669,879.000	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,389,245.230	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	944,000.000	1,073,545.120	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	440,000.000	558,166.400	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	504,190.400	

0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,497,328.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	650,000.000	679,126.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	592,420.200	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	300,000.000	336,555.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,140,000.000	1,217,235.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	608,641.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	800,000.000	858,976.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	402,024.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,284,686.520	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,367,000.000	2,141,241.460	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,076,014.880	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	1,250,000.000	1,836,962.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,617,318.150	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,448,000.000	2,417,913.840	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,775,000.000	3,061,555.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	2,071,000.000	3,501,874.610	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,225,000.000	2,226,082.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,399,000.000	2,739,857.560	
3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200704	1,928,000.000	2,001,784.560	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,374,000.000	2,321,812.680	

2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20200904	1,444,000.000	1,495,420.840	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210104	2,333,000.000	2,451,026.470	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,810,096.200	
2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,508,616.400	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	2,807,000.000	3,002,704.040	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,390,094.300	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,338,000.000	3,617,073.040	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,762,154.280	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,524,322.800	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,974,061.480	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,779,079.380	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,737,080.800	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,409,000.000	3,804,991.410	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,762,469.860	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,671,728.460	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,329,303.980	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,340,592.540	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,168,000.000	2,316,659.760	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,850,000.000	2,948,268.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,600,000.000	1,685,568.000	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,471,718.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,350,000.000	1,700,325.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,500,000.000	1,613,370.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,500,000.000	1,577,880.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,700,000.000	1,784,643.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200612	800,000.000	805,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20200911	350,000.000	352,863.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20201211	700,000.000	707,070.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210312	400,000.000	404,840.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20201016	1,448,000.000	1,465,853.840	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20210409	1,578,000.000	1,598,087.940	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,423,058.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,183,072.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,148,363.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	730,000.000	749,133.300	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	900,000.000	925,614.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,050,000.000	1,080,985.500	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	985,000.000	1,333,059.600	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,247,584.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,023,000.000	4,651,762.170	

5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,807,000.000	4,815,604.990	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,459,000.000	4,079,874.440	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,364,000.000	2,538,785.920	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20210425	3,230,000.000	3,494,149.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,624,000.000	4,242,798.080	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,959,869.170	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,084,000.000	5,443,599.240	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,167,000.000	2,251,668.150	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,971,164.340	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201025	3,113,000.000	3,245,271.370	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,531,177.500	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	4,006,685.100	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,199,000.000	3,971,494.520	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,952,004.380	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,438,000.000	3,780,362.800	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,652,012.110	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,500,881.840	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,087,000.000	5,122,768.410	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,399,000.000	3,799,232.250	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,292,000.000	3,456,600.000	

1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	2,601,000.000	2,818,105.470	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20201125	2,193,000.000	2,220,653.730	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,070,137.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,737,000.000	3,927,624.370	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,269,000.000	2,513,371.300	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	887,000.000	1,050,784.550	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210525	2,770,000.000	2,803,350.800	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,889,600.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,070,120.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,420,000.000	1,698,916.400	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,500,000.000	2,725,000.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,250,000.000	2,828,655.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,449,248.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,100,000.000	4,383,556.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20210225	2,400,000.000	2,425,800.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,550,000.000	1,726,638.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,100,000.000	2,241,435.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,400,000.000	2,449,992.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	400,000.000	406,244.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	800,000.000	896,448.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	1,200,000.000	1,248,384.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	400,000.000	407,264.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	709,769.600	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,239,000.000	1,857,830.940	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,355,000.000	2,252,877.200	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	916,856.010	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20200715	1,146,000.000	1,197,168.900	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,549,000.000	2,730,561.710	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,583,229.340	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,568,009.580	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,552,201.920	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,518,001.550	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,249,000.000	2,034,146.380	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,708,776.100	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,291,000.000	1,344,202.110	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,338,000.000	1,418,320.140	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,220,172.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,200,000.000	1,297,548.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	800,000.000	819,544.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,247,508.500	

0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	723,667.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	400,000.000	415,184.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,106,000.000	1,462,795.600	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,513,951.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,205,854.080	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,897,081.200	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,429,000.000	1,468,397.530	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,649,167.020	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,687,000.000	1,668,965.970	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,765,000.000	1,617,040.050	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	1,918,684.240	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,524,138.560	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201101	774,000.000	779,418.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,440,000.000	1,343,160.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	2,359,000.000	2,338,665.420	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,763,800.020	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,675,858.140	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	924,000.000	867,885.480	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,568,000.000	1,507,004.800	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	700,000.000	681,996.000	

0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,350,232.240	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	648,000.000	578,586.240	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,700,000.000	1,673,769.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	2,010,000.000	2,046,320.700	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,322,646.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,261,175.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20200615	970,000.000	973,540.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,450,000.000	1,526,574.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,300,000.000	1,306,838.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,694,951.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,200,000.000	1,190,796.000	
0.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20201015	1,900,000.000	1,902,584.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,200,000.000	1,204,068.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,500,390.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	900,000.000	892,179.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,284,127.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210415	1,500,000.000	1,491,660.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,633,529.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,462,650.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,100,000.000	1,146,882.000	

2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	700,000.000	726,544.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,000,000.000	1,074,240.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	850,000.000	938,867.500	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,050,000.000	1,049,874.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,063,530.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	500,000.000	504,215.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	500,000.000	506,490.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,454,000.000	3,106,444.980	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,872,132.880	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,655,000.000	2,236,732.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,498,000.000	3,197,340.080	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,790,000.000	3,231,350.100	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801	2,734,000.000	2,918,599.680	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,034,000.000	2,627,033.040	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,562,110.710	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,497,439.700	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,043,000.000	2,625,071.130	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20200901	2,214,000.000	2,318,235.120	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,417,573.700	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210301	2,144,000.000	2,269,273.920	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	2,281,000.000	2,486,951.490	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,235,130.800	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	1,657,000.000	1,888,400.050	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,910,000.000	2,185,269.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,951,575.200	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,125,730.900	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,413,000.000	1,783,290.780	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,492,822.800	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210501	1,729,000.000	1,836,215.290	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,435,736.650	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,938,000.000	2,140,714.800	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,649,216.970	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,528,582.020	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,704,000.000	2,843,294.400	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	990,133.000	
3.75% Belgium Government Bond 20200928	1,736,000.000	1,832,556.320	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,674,000.000	2,805,038.100	
4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,607,677.260	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,322,701.380	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,526,678.440	

4% Belgium Government Bond 20320328	680,000.000	990,596.800	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,488,712.320	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	853,000.000	1,403,654.150	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,732,917.200	
3% Belgium Government Bond 20340622	597,000.000	810,994.650	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,131,000.000	1,494,311.130	
5% IRISH TREASURY 20201018	765,000.000	821,984.850	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	504,000.000	586,257.840	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	715,373.780	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	761,000.000	924,683.490	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	533,884.560	
2% IRISH TREASURY 20450218	781,000.000	952,039.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,152,595.140	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	627,418.000	
IRISH TREASURY 20221018	50,000.000	50,699.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	532,945.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	700,000.000	760,746.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	200,000.000	220,262.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	323,652.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	300,000.000	321,645.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,256,557.500	
3.9% Austria Government Bond 20200715	1,248,000.000	1,308,166.080	
3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,462,076.350	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,075,753.800	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,182,028.750	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	893,883.320	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	991,926.160	

3.8% Austria Government Bond 20620126	318,000.000	650,523.060	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	986,751.010	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,053,845.100	
2.4% Austria Government Bond 20340523	621,000.000	803,977.650	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,035,312.200	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	845,796.020	
3.5% Finland Government Bond 20210415	459,000.000	493,778.430	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	489,035.240	
1.625% Finland Government Bond 20220915	612,000.000	655,849.800	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	481,153.720	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	597,362.040	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	592,765.660	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,589,269.600	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,745,000.000	1,908,506.500	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,348,472.960	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,792,000.000	2,028,096.000	
1.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20200730	1,650,000.000	1,679,139.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,946,626.910	
0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,788,246.670	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,452,000.000	1,911,035.280	

3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	950,000.000	1,412,279.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,730,000.000	1,868,607.600	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,122,099.200	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,800,000.000	1,973,268.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,450,000.000	1,734,577.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,242,003.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210131	1,300,000.000	1,308,684.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,000,000.000	1,023,630.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,100,000.000	2,290,323.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	850,000.000	1,080,392.500	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,429,638.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,200,000.000	1,305,624.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,200,000.000	1,210,632.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,074,230.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	800,000.000	896,168.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	400,000.000	406,616.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,230,282.120	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,654,000.000	2,493,868.120	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,308,000.000	2,200,095.240	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	2,066,707.040	

	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,105,677.490	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,807,545.730	
	4.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20201031	1,681,000.000	1,802,536.300	
	5.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210430	2,515,000.000	2,790,945.800	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,761,591.350	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,298,554.680	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	2,608,000.000	3,140,762.240	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,280,325.540	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,538,480.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,499,000.000	2,696,131.380	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,346,151.800	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,412,514.620	
	ユーロ 小計		ユーロ 543,823,794.140 (66,275,805,792)	
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	19,434,000.000	21,684,457.200	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,612,000.000	8,370,045.720	
	6.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20210331	4,622,000.000	4,639,794.700	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	8,904,000.000	6,213,656.400	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	9,999,000.000	8,409,159.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	7,439,000.000	7,524,176.550	

	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	20,052,000.000	17,740,405.440	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	11,021,000.000	9,859,055.970	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	11,862,000.000	10,985,872.680	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	11,944,000.000	10,624,546.320	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,743,000.000	9,841,984.590	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	6,166,000.000	5,764,901.700	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	7,179,000.000	6,611,356.470	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 128,269,412.740 (942,780,184)	
国債証券 合計			172,799,261,126 [172,799,261,126]	
合計			172,799,261,126 [172,799,261,126]	

- (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 244銘柄	100%	47.4%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.4%
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 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8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 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 17銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 35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 307銘柄	100%	38.4%
南アフリカ・ランド	国債証券 13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 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6月16日から2019年6月17日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

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

(1) 【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	61,159	-
コール・ローン	5,568,760	4,010,802
親投資信託受益証券	1,194,460,520	1,343,240,672
未収入金	7,881,767	1,761,613
流動資産合計	1,207,972,206	1,349,013,087
資産合計	1,207,972,206	1,349,013,087
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,076,705	1,751,509
未払受託者報酬	118,829	139,538
未払委託者報酬	2,199,274	2,582,155
その他未払費用	44,533	52,797
流動負債合計	12,439,341	4,525,999
負債合計	12,439,341	4,525,999
純資産の部		
元本等		
元本	1,112,542,866	1,219,423,623
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	82,989,999	125,063,465
（分配準備積立金）	13,310,528	22,979,887
元本等合計	1,195,532,865	1,344,487,088
純資産合計	1,195,532,865	1,344,487,088
負債純資産合計	1,207,972,206	1,349,013,087

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
有価証券売買等損益	14,640,910		38,289,799	
その他収益	-		9,051	
営業収益合計	14,640,910		38,298,850	
営業費用				
支払利息	1,148		2,179	
受託者報酬	202,617		273,887	
委託者報酬	3,750,277		5,068,595	
その他費用	75,916		102,709	
営業費用合計	4,029,958		5,447,370	
営業利益又は営業損失（ ）	18,670,868		32,851,480	
経常利益又は経常損失（ ）	18,670,868		32,851,480	
当期純利益又は当期純損失（ ）	18,670,868		32,851,480	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,052,594		3,144,254	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	41,637,159		82,989,999	
剰余金増加額又は欠損金減少額	74,150,046		31,900,927	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	74,150,046		31,900,927	
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,073,744		19,534,687	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,073,744		19,534,687	
分配金	1 -		1 -	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	82,989,999		125,063,465	

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	557,544,250円	1,112,542,866円
期中追加設定元本額	683,181,594円	364,448,905円
期中一部解約元本額	128,182,978円	257,568,148円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,112,542,866口	1,219,423,623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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(69,680,734円)及び分配準備積立金(13,310,528円)より分配対象額は82,991,262円(1万口当たり745.96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(5,783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(12,330,655円)、投資信託約款に規定される収益調整金(102,083,578円)及び分配準備積立金(10,643,449円)より分配対象額は125,063,465円(1万口当たり1,025.59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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	16,881,216	35,599,704
合計	16,881,216	35,599,704

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0746円 (10,746円)	1.1026円 (11,026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	199,537,093	270,113,362	
	外国債券インデックスマザーファンド	384,151,534	1,073,127,310	
親投資信託受益証券 合計			1,343,240,672	
合計			1,343,240,672	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	62,827,549	120,906,887
金銭信託	1,022,784	-
コール・ローン	93,127,644	157,354,876
国債証券	8,713,400,729	12,113,022,561
派生商品評価勘定	190,647	1,139,592
未収入金	13,072	1,186,355
未収利息	147,130,183	212,291,160
前払費用	30,176,649	21,089,750
流動資産合計	9,047,889,257	12,626,991,181
資産合計	9,047,889,257	12,626,991,181
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	830,455	175,948
未払金	-	15,991,480
未払解約金	17,515,053	3,481,657
その他未払費用	1,837	-
流動負債合計	18,347,345	19,649,085
負債合計	18,347,345	19,649,085
純資産の部		
元本等		
元本	1 6,882,755,540	9,313,186,541
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,146,786,372	3,294,155,555
元本等合計	9,029,541,912	12,607,342,096
純資産合計	9,029,541,912	12,607,342,096
負債純資産合計	9,047,889,257	12,626,991,181

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6月16日 至 2019年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	3,958,047,683円	6,882,755,540円
期中追加設定元本額	3,396,346,573円	2,872,245,706円
期中一部解約元本額	471,638,716円	441,814,705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）	- 円		9,240,531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）	179,670,376円		199,537,093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）	326,925,628円		403,369,138円
D - I ' s 新興国債券イン デックス	45,764,193円		58,417,356円
i F r e e 新興国債券イン デックス	1,340,012,391円		2,157,305,281円
i F r e e 8資産バランス	739,451,734円		1,267,577,936円
D Cダイワ新興国債券イン デックスファンド	4,039,037,258円		5,006,795,753円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	183,461,837円		179,398,402円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	28,432,123円		31,545,051円
計	6,882,755,540円		9,313,186,541円
2. 期末日における受益権の総数	6,882,755,540口		9,313,186,541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6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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6月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2018年6月15日現在	2019年6月17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	253,155,275	373,038,039

合計	253,155,275	373,038,039
----	-------------	-------------

(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7月6日から2018年6月15日まで、及び2018年7月6日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	85,362,698	-	84,722,890	639,808	99,642,186	-	100,605,830	963,644
タイ・バーツ	-	-	-	-	14,610,960	-	14,574,000	36,960
チェコ・ コルナ	29,407,028	-	29,571,500	164,472	15,462,080	-	15,660,400	198,320
トルコ・リラ	25,357,561	-	24,791,900	565,661	8,589,875	-	8,544,600	45,275
ハンガリー・ フォリント	15,689,071	-	15,562,800	126,271	3,319,219	-	3,287,730	31,489
ポーランド・ ズロチ	2,685,078	-	2,682,900	2,178	11,990,924	-	12,012,000	21,076
メキシコ・ ペソ	6,969,010	-	6,864,000	105,010	21,441,736	-	22,091,500	649,764
ルーマニア・ レイ	3,207,100	-	3,202,290	4,810	17,599,779	-	17,774,400	174,621
南アフリカ・ ランド	2,047,850	-	2,047,500	350	6,627,613	-	6,661,200	33,587
合計	85,362,698	-	84,722,890	639,808	99,642,186	-	100,605,830	963,644

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3119円 (13,119円)	1,3537円 (13,537円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アルゼンチン・ペソ	18.2% REPUBLIC OF ARGENTINA 20211003	4,700,000.000	3,058,901.000	
		16% REPUBLIC OF ARGENTINA 20231017	1,400,000.000	917,532.000	
		15.5% REPUBLIC OF ARGENTINA 20261017	16,800,000.000	11,066,664.000	
		アルゼンチン・ペソ 小計		15,043,097.000 (37,156,450)	
	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	8,392,395,000.000	
8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	4,000,000,000.000	4,249,840,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	2,800,000,000.000	2,681,756,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	6,881,418,000.000	
8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	5,000,000,000.000	5,195,600,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	5,000,000,000.000	5,117,000,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	9,000,000,000.000	9,365,580,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20201115	2,400,000,000.000	2,539,872,000.000	
12.8% Indonesia Treasury Bond 20210615	1,600,000,000.000	1,773,392,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	4,700,000,000.000	5,501,068,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	4,180,000,000.000	4,982,392,800.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20210715	9,210,000,000.000	9,451,117,800.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,324,321,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	10,224,000,000.000	10,667,108,160.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	4,853,977,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	9,924,134,300.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20220515	8,660,000,000.000	8,646,577,000.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	8,910,000,000.000	8,450,422,200.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	8,700,000,000.000	7,829,043,000.000	
6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	6,975,000,000.000	6,179,710,500.000	

	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,020,000,000.000	12,417,862,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	13,761,212,000.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	7,820,000,000.000	8,439,813,200.000	
インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア 160,625,612,460.000 (1,220,754,654)	
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	5,231,736.000	
	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,366,224.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			ウルグアイ・ペソ 7,597,960.000 (23,401,717)	
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	113,070,600.000	
	7.75% Colombia Government International Bond 20210414	95,000,000.000	98,985,250.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	43,483,500.000	
	11% Colombian TES 20200724	2,265,000,000.000	2,431,454,850.000	
	7% Colombian TES 20220504	4,335,000,000.000	4,583,438,850.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,450,000,000.000	4,162,701,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	3,590,000,000.000	3,586,661,300.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	3,310,000,000.000	3,653,015,300.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	3,034,152,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	2,200,000,000.000	2,319,768,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,000,000,000.000	2,066,280,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			コロンビア・ペソ 26,093,010,650.000 (866,287,953)	
タイ・バーツ		タイ・バーツ	タイ・バーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	23,050,000.000	28,691,257.000	

	3.625% Thailand Government Bond 20230616	19,300,000.000	20,675,704.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	20,610,000.000	22,986,333.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20211217	30,600,000.000	32,006,070.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	22,700,000.000	26,062,551.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	21,200,000.000	21,267,416.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	19,100,000.000	21,599,617.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	23,400,000.000	23,649,678.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	26,000,000.000	26,193,440.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	25,000,000.000	29,016,500.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	21,000,000.000	20,626,200.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	14,000,000.000	14,344,120.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	13,000,000.000	13,868,660.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	9,000,000.000	10,077,480.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 311,065,026.000 (1,082,506,290)	
チェコ・コルナ		チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
	3.75% Czech Republic Government Bond 20200912	6,500,000.000	6,677,060.000	
	3.85% Czech Republic Government Bond 20210929	8,200,000.000	8,616,888.000	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	12,600,000.000	13,652,100.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,331,180.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,201,640.000	

	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	16,960,545.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	10,900,000.000	10,579,322.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	10,000,000.000	9,308,000.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	2,900,000.000	2,772,313.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	8,000,000.000	7,294,800.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	12,000,000.000	13,320,840.000	
チェコ・コルナ 小計			チェコ・コルナ 110,714,688.000 (528,109,062)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20210301	425,000,000.000	439,267,250.000	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	470,000,000.000	509,188,600.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	500,000,000.000	587,385,000.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	556,874,300.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	320,000,000.000	358,118,400.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	260,630,000.000	
	5.5% Chile Government International Bond 20200805	50,000,000.000	51,441,500.000	
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 2,762,905,050.000 (428,802,863)	
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	1,303,548.200	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	586,045.700	
	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	1,878,863.000	

	8.8% Turkey Government Bond 20230927	1,390,000.000	974,723.600	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	498,875.200	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,129,117.300	
	8% Turkey Government Bond 20250312	1,490,000.000	970,049.600	
	9.4% Turkey Government Bond 20200708	1,180,000.000	1,036,287.800	
	10.7% Turkey Government Bond 20210217	1,610,000.000	1,367,984.800	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	1,904,498.500	
	9.2% Turkey Government Bond 20210922	2,010,000.000	1,614,753.600	
	11% Turkey Government Bond 20220302	2,400,000.000	1,935,936.000	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,198,067.300	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,490,854.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,187,450.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,134,014.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	1,000,000.000	786,120.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	2,000,000.000	1,810,060.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 23,807,248.600 (437,815,302)	
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	105,508,275.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	179,581,200.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20211027	89,000,000.000	93,043,270.000	

	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	143,654,000.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	85,000,000.000	88,498,600.000	
	0.5% Hungary Government Bond 20210421	60,000,000.000	60,162,000.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	50,000,000.000	67,696,500.000	
	7.5% Hungary Government Bond 20201112	99,500,000.000	109,982,325.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	158,146,820.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	147,646,250.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	172,567,500.000	
	ハンガリー・フォリント 小計		ハンガリー・フォリント 1,326,486,740.000 (501,411,988)	
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 15,075,000.000	
	フィリピン・ペソ 小計		フィリピン・ペソ 15,075,000.000 (31,506,750)	
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 5,308,611.700	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	6,410,000.000	7,004,655.700	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	4,990,000.000	5,553,371.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	3,750,000.000	4,215,525.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	1,500,000.000	1,702,245.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20200701	8,340,000.000	7,858,865.400	

	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701	5,030,000.000	4,443,904.400	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	4,000,000.000	3,404,000.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	4,200,000.000	3,443,454.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	1,200,000.000	909,096.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 43,843,728.200 (1,222,363,142)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 1,130,000.000	ペルー・ソル 1,238,581.700	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,220,978.000	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	2,033,372.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	2,089,468.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	1,947,924.200	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	1,565,000.000	1,835,275.500	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,255,712.000	
	ペルー・ソル 小計			ペルー・ソル 13,621,311.400 (442,147,768)
ポーランド・ズロチ	5.75% Poland Government Bond 20220923	ポーランド・ズロチ 2,210,000.000	ポーランド・ズロチ 2,487,642.300	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	3,640,000.000	3,699,150.000	
	2% Poland Government Bond 20210425	2,260,000.000	2,280,792.000	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	2,230,000.000	2,236,110.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	2,890,000.000	2,928,581.500	

	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,252,768.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,072,870.000	
	Poland Government Bond 20200725	2,000,000.000	1,969,080.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	3,500,000.000	3,590,335.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	500,000.000	516,990.000	
	5.25% Poland Government Bond 20201025	1,720,000.000	1,807,358.800	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,820,000.000	1,994,993.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,752,867.700	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,200,000.000	3,301,280.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,350,000.000	2,502,820.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 38,393,639.000 (1,099,209,885)	
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	2,029,340.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,200,000.000	1,244,616.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,053,160.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,000,000.000	1,048,940.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,500,000.000	1,549,905.000	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	1,350,000.000	1,371,451.500	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,500,000.000	2,488,075.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,797,193.800	

	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,350,000.000	1,375,272.000	
	3.659% MALAYSIAN GOVERNMENT 20201015	1,740,000.000	1,748,717.400	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	900,000.000	911,394.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,300,000.000	1,317,615.000	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,207,536.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,420,000.000	1,455,159.200	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,120,000.000	2,139,461.600	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,100,000.000	1,183,853.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,415,778.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,033,500.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	700,000.000	709,373.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 29,080,340.500 (756,961,262)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	10,400,000.000	9,399,208.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	9,500,000.000	9,549,115.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	9,894,400.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	16,250,000.000	16,499,112.500	
	10% Mexican Bonos 20241205	18,350,000.000	20,354,003.500	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	23,230,000.000	23,065,996.200	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	8,910,862.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	11,230,000.000	11,882,575.300	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	14,100,000.000	14,936,694.000	
	6.5% Mexican Bonos 20210610	21,950,000.000	21,451,076.500	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,950,000.000	22,998,424.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	19,450,000.000	18,865,722.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	11,320,000.000	11,103,222.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,130,000.000	7,106,684.900	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 206,017,096.400 (1,168,116,936)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,519,989.900	
	5.95% Romania Government Bond 20210611	940,000.000	981,313.000	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,178,853.500	
	3.25% Romania Government Bond 20210322	1,130,000.000	1,124,576.000	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	1,200,000.000	1,314,900.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,071,273.800	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	800,000.000	767,120.000	
	3.4% Romania Government Bond 20220308	800,000.000	790,360.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,505,970.000	
4% Romania Government Bond 20211027	1,000,000.000	1,004,480.000		
ルーマニア・レイ 小計			ルーマニア・レイ 11,258,836.200 (290,477,974)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20210414	14,880,000.000	14,991,600.000	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	41,760,000.000	43,467,566.400	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	21,910,000.000	22,107,190.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	14,277,600.000	
7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	36,160,000.000	35,250,214.400		

	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	24,300,000.000	23,984,343.000	
	7.5% Russian Federal Bond - OFZ 20210818	29,300,000.000	29,484,297.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	24,000,000.000	25,758,000.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	56,100,000.000	57,161,412.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	39,000,000.000	39,234,780.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	47,000,000.000	47,259,440.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	35,600,000.000	35,119,400.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	49,000,000.000	48,821,640.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	31,000,000.000	29,968,320.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	25,000,000.000	24,141,500.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	39,000,000.000	37,352,250.000	
	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	22,000,000.000	22,649,440.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	28,000,000.000	27,984,320.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 579,013,312.800 (978,532,499)	
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	22,050,000.000	24,603,390.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	10,220,000.000	7,366,678.200	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,880,000.000	6,894,758.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	8,440,000.000	7,098,040.000	

	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	9,880,000.000	9,993,126.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	21,020,000.000	18,596,814.400	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	14,500,000.000	12,971,265.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	12,100,000.000	11,206,294.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	13,100,000.000	11,652,843.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	10,300,000.000	9,436,139.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	10,100,000.000	9,442,995.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	7,000,000.000	6,446,510.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 135,708,852.600 (997,460,066)	
国債証券 合計			12,113,022,561 [12,113,022,561]	
合計			12,113,022,561 [12,113,022,561]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アルゼンチン・ペソ	国債証券 3銘柄	100%	0.3%
インドネシア・ルピア	国債証券 23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%	7.2%
タイ・バーツ	国債証券 14銘柄	100%	8.9%
チェコ・コルナ	国債証券 11銘柄	100%	4.4%
チリ・ペソ	国債証券 7銘柄	100%	3.5%
トルコ・リラ	国債証券 18銘柄	100%	3.6%
ハンガリー・フォリント	国債証券 11銘柄	100%	4.1%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.3%
ブラジル・レアル	国債証券 10銘柄	100%	10.1%

ペルー・ソル	国債証券	7銘柄	100%	3.7%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	9.1%
マレーシア・リングgit	国債証券	19銘柄	100%	6.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	100%	9.6%
ルーマニア・レイ	国債証券	10銘柄	100%	2.4%
ロシア・ルーブル	国債証券	18銘柄	100%	8.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	8.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 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6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	392,419	-
コール・ローン	35,730,950	15,515,511
親投資信託受益証券	2,350,731,287	3,252,858,304
未収入金	16,850,000	3,042,000
流動資産合計	2,403,704,656	3,271,415,815
資産合計	2,403,704,656	3,271,415,815
負債の部		
流動負債		
未払解約金	44,666,343	12,068,718
未払受託者報酬	232,555	308,957
未払委託者報酬	3,372,589	4,480,382
その他未払費用	58,200	77,948
流動負債合計	48,329,687	16,936,005
負債合計	48,329,687	16,936,005
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,297,924,064	1 2,753,769,433
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	57,450,905	500,710,377
(分配準備積立金)	99,070,831	435,415,462
元本等合計	2,355,374,969	3,254,479,810
純資産合計	2,355,374,969	3,254,479,810
負債純資産合計	2,403,704,656	3,271,415,815

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		-		3
有価証券売買等損益	114,843,303		400,376,017	
その他収益		268		-
営業収益合計	114,843,571		400,376,020	
営業費用				
支払利息	4,265		8,027	
受託者報酬	392,016		583,375	
委託者報酬	5,685,636		8,460,193	
その他費用	98,159		146,582	
営業費用合計	6,180,076		9,198,177	
営業利益	108,663,495		391,177,843	
経常利益	108,663,495		391,177,843	
当期純利益	108,663,495		391,177,843	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,178,922		33,481,973	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,573,487		57,450,905	
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,633,086		104,380,406	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,633,086		-	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		104,380,406	
剰余金減少額又は欠損金増加額	45,093,267		18,816,804	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		18,816,804	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	45,093,267		-	
分配金	1 -		1 -	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	57,450,905		500,710,377	

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	1,235,784,993円	2,297,924,064円
期中追加設定元本額	1,366,263,589円	1,052,662,291円
期中一部解約元本額	304,124,518円	596,816,922円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,297,924,064口	2,753,769,433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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(99,070,831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99,070,831円(1万口当たり431.13円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(357,700,099円)、投資信託約款に規定される収益調整金(65,302,064円)及び分配準備積立金(77,715,363円)より分配対象額は500,717,526円(1万口当たり1,818.30円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	113,745,178	385,994,237
合計	113,745,178	385,994,237

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0250円 (10,250円)	1.1818円 (11,818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	1,114,412,383	3,252,858,304	
親投資信託受益証券 合計			3,252,858,304	
合計			3,252,858,304	

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6月15日現在	2019年6月17日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

金銭信託		38,099,261	-
コール・ローン		3,469,054,314	3,926,297,899
投資証券	2	209,017,190,580	274,642,114,000
派生商品評価勘定		18,885,600	27,184,000
未収入金		1,060,294,414	-
未収配当金		1,315,936,685	1,704,536,535
流動資産合計		214,919,460,854	280,300,132,434
資産合計		214,919,460,854	280,300,132,434
負債の部			
流動負債			
前受金		16,380,000	34,400,000
未払金		-	604,206,193
未払解約金		2,702,297,400	670,176,100
その他未払費用		36,292	-
流動負債合計		2,718,713,692	1,308,782,293
負債合計		2,718,713,692	1,308,782,293
純資産の部			
元本等			
元本	1	84,131,299,324	95,580,504,970
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		128,069,447,838	183,410,845,171
元本等合計		212,200,747,162	278,991,350,141
純資産合計		212,200,747,162	278,991,350,141
負債純資産合計		214,919,460,854	280,300,132,434

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6月16日 至 2019年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	110,682,384,557円	84,131,299,324円
期中追加設定元本額	4,835,703,556円	19,598,932,151円
期中一部解約元本額	31,386,788,789円	8,149,726,505円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	8,634,387,920円	6,706,584,651円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	68,030,957,225円	80,193,938,516円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	427,102,393円	338,060,927円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	29,232円	79,957円
iFree J-REITイ ンデックス	123,106,225円	96,476,948円
iFree 8資産バランス	390,865,743円	590,869,858円
DC・ダイワJ-REIT オープン	3,554,437,382円	4,402,876,383円

	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,995,920円	2,455,804円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	5,407,352円	4,838,857円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	1,334,004円	1,399,634円
	ダイワ・ノーロード J - R EITファンド	54,950,461円	50,397,512円
	ダイワファンドラップ J - REITインデックス	931,979,260円	1,114,412,383円
	ダイワ J - REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	127,599,903円	438,357,130円
	ダイワファンドラップオンラ イン J - REITインデッ クス	351,216,953円	374,445,092円
	ダイワ・インデックスセレク ト J - REIT	1,494,929,351円	1,265,311,318円
	計	84,131,299,324円	95,580,504,970円
2.	期末日における受益権の総数	84,131,299,324口	95,580,504,970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 371,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 投資証券 455,400,000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6月16日 至 2019年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	6,566,853,993	8,449,127,430
合計	6,566,853,993	8,449,127,430

(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3月16日から2018年6月15日まで、及び2019年3月16日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000	3,803,600,000	-	3,831,000,000	27,400,000
合計	3,079,620,000	-	3,098,700,000	19,080,000	3,803,600,000	-	3,831,000,000	27,400,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2018年6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.5223円	2.9189円
(1万口当たり純資産額)	(25,223円)	(29,189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	2,915	309,573,000	
	サンケイリアルエステート	2,807	306,805,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	9,436	5,567,240,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	32,000	3,318,400,000	
	森ヒルズリート	32,567	4,972,980,900	
	産業ファンド	34,851	4,656,093,600	
	アドバンス・レジデンス	27,675	8,703,787,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	17,554	3,245,734,600	
	A P I 投資法人	14,918	7,078,591,000	
	G L P 投資法人	70,365	8,570,457,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,776	3,591,680,000	
	日本プロロジスリート	38,090	9,236,825,000	
	星野リゾート・リート	4,321	2,350,624,000	
	O N E リート投資法人	4,139	1,152,297,600	
	イオンリート投資	29,148	3,987,446,400	
	ヒューリックリート投資法	22,955	4,221,424,500	
	日本リート投資法人	9,166	3,941,380,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	173,075	3,028,812,500	
	日本ヘルスケア投資法	1,300	226,590,000	
	積水ハウス・リート投資	83,033	6,626,033,400	
	トーセイ・リート投資法人	5,466	641,708,400	
	ケネディクス商業リート	10,408	2,761,242,400	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,948	728,630,000	
	サムティ・レジデンシャル	5,684	616,145,600	
	野村不動産マスターF	88,353	14,613,586,200	
	いちごホテルリート投資	4,966	634,654,800	
	ラサールロジポート投資	23,463	2,984,493,600	
	スターアジア不動産投	8,815	1,024,303,000	
	マリモ地方創生リート	2,442	291,330,600	
	三井不ロジパーク	6,891	2,480,760,000	
大江戸温泉リート	4,583	387,721,800		
さくら総合リート	6,144	564,633,600		
投資法人みらい	30,592	1,502,067,200		
森トラスト・ホテルリート投	6,662	926,684,200		

三菱地所物流REIT	3,005	822,468,500	
CREロジスティクスファンド	2,843	339,454,200	
ザイマックス・リート	2,619	327,898,800	
タカラレーベン不動産投	4,250	415,225,000	
伊藤忠アドバンスロジ	4,393	439,739,300	
日本ビルファンド	27,499	20,871,741,000	
ジャパンリアルエステイト	28,397	18,656,829,000	
日本リテールファンド	53,669	11,705,208,900	
オリックス不動産投資	56,580	11,191,524,000	
日本プライムリアルティ	17,975	8,708,887,500	
プレミア投資法人	26,998	3,679,827,400	
東急リアル・エステート	19,039	3,567,908,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	19,644	2,624,438,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	62,629	11,285,745,800	
森トラスト総合リート	20,295	3,559,743,000	
インヴィンシブル投資法人	97,966	5,819,180,400	
フロンティア不動産投資	9,660	4,578,840,000	
平和不動産リート	17,684	2,233,489,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,554	4,605,102,800	
福岡リート投資法人	14,686	2,571,518,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	8,784	6,746,112,000	
いちごオフィスリート投資法人	23,559	2,391,238,500	
大和証券オフィス投資法人	6,554	5,079,350,000	
阪急阪神リート投資法人	12,777	1,899,939,900	
スターツプロシード投資法人	4,440	774,336,000	
大和ハウスリート投資法人	38,101	9,765,286,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	91,405	7,952,235,000	
日本賃貸住宅投資法人	31,940	2,676,572,000	
ジャパンエクセレント投資法人	25,428	4,101,536,400	
投資証券 合計		274,642,114,000	
合計		274,642,114,000	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本ビルファンド

600口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 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6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	255,328	-
コール・ローン	23,248,416	62,263,405
親投資信託受益証券	8,805,742,899	10,918,058,430
派生商品評価勘定	330,380	5,228,448
未収入金	-	924,258
流動資産合計	8,829,577,023	10,986,474,541
資産合計	8,829,577,023	10,986,474,541
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	119,702,888	40,949,810
未払金	9,566	59,460
未払解約金	4,682,249	27,724,774
未払受託者報酬	837,713	1,103,445
未払委託者報酬	15,708,135	20,690,411
その他未払費用	209,790	278,664
流動負債合計	141,150,341	90,806,564
負債合計	141,150,341	90,806,564
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,936,929,166	1 10,126,367,998
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 248,502,484	2 769,299,979
(分配準備積立金)	192,092,032	1,089,204,741
元本等合計	8,688,426,682	10,895,667,977
純資産合計	8,688,426,682	10,895,667,977
負債純資産合計	8,829,577,023	10,986,474,541

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益	178,202,667		1,025,505,531	
為替差損益	163,522,845		49,909,833	
その他収益		-		19,940
営業収益合計	14,679,822		1,075,435,305	
営業費用				
支払利息	11,755		29,554	
受託者報酬	1,496,565		2,123,649	
委託者報酬	28,062,554		39,819,913	
その他費用	385,624		543,953	
営業費用合計	29,956,498		42,517,069	
営業利益又は営業損失（ ）	15,276,676		1,032,918,236	
経常利益又は経常損失（ ）	15,276,676		1,032,918,236	
当期純利益又は当期純損失（ ）	15,276,676		1,032,918,236	
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（ ）	26,896,884		93,196,250	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	83,499,628		248,502,484	
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,746,788		78,080,477	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,746,788		58,732,152	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		19,348,325	
剰余金減少額又は欠損金増加額	200,369,852		-	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	200,369,852		-	
分配金	1 -		1 -	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	248,502,484		769,299,979	

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	5,369,088,014円	8,936,929,166円
期中追加設定元本額	4,660,565,456円	3,628,593,466円
期中一部解約元本額	1,092,724,304円	2,439,154,634円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,936,929,166口	10,126,367,998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248,502,484円でありませ	
------------	--	--

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第2期 自 2017年6月16日 至 2018年6月15日	第3期 自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(11,630,148円)、投資信託約款に規定される収益調整金(167,889,634円)及び分配準備積立金(180,461,884円)より分配対象額は359,981,666円(1万口当たり402.80円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(939,720,575円)、投資信託約款に規定される収益調整金(258,405,632円)及び分配準備積立金(149,484,166円)より分配対象額は1,347,610,373円(1万口当たり1,330.79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6月16日 至 2019年6月17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。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	<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	第3期 2019年6月17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

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在

種 類	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	174,154,638	949,388,259
合計	174,154,638	949,388,259

(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6月15日 現在				第3期 2019年6月17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	8,592,500,919	-	8,711,873,427	119,372,508	10,388,616,746	-	10,424,338,108	35,721,362
アメリカ・ドル	6,084,377,844	-	6,187,252,167	102,874,323	7,577,552,770	-	7,608,954,604	31,401,834
イギリス・ ポンド	502,220,533	-	508,612,557	6,392,024	526,336,857	-	525,580,694	756,163
イスラエル・ シケル	5,392,636	-	5,381,238	11,398	7,082,849	-	7,154,770	71,921
オーストラリ ア・ドル	699,255,108	-	700,814,640	1,559,532	716,355,818	-	712,088,035	4,267,783
カナダ・ドル	156,231,633	-	156,539,714	308,081	198,288,878	-	200,397,947	2,109,069
シンガポー ル・ドル	287,809,650	-	290,620,656	2,811,006	368,077,807	-	370,121,952	2,044,145
ニュージー ランド・ドル	38,668,464	-	38,940,209	271,745	49,032,688	-	48,863,894	168,794
ユーロ	631,581,728	-	634,051,460	2,469,732	672,549,584	-	676,738,700	4,189,116
香港・ドル	186,963,323	-	189,660,786	2,697,463	273,339,495	-	274,437,512	1,098,017
合計	8,592,500,919	-	8,711,873,427	119,372,508	10,388,616,746	-	10,424,338,108	35,721,362

(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
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 自 2018年6月16日 至 2019年6月17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6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	0.9722円	1.0760円
（1万口当たり純資産額）	(9,722円)	(10,760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	4,497,284,850	10,918,058,430	
親投資信託受益証券 合計			10,918,058,430	

合計		10,918,058,430	
----	--	----------------	--

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6月15日現在	2019年6月17日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	49,907,321	31,637,876
金銭信託	1,711,640	-
コール・ローン	155,850,086	206,694,603
投資信託受益証券	137,679,722	139,379,269
投資証券	16,471,872,345	22,264,457,330
派生商品評価勘定	828,281	9,191,356
未収入金	197,007	527,362
未収配当金	32,903,547	41,015,642
差入委託証拠金	37,424,658	51,198,111
流動資産合計	16,888,374,607	22,744,101,549
資産合計	16,888,374,607	22,744,101,549
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	702,774	77,705

未払金		28,930,016	54,858,688
未払解約金		20,267,000	9,222,000
その他未払費用		2,034	-
流動負債合計		49,901,824	64,158,393
負債合計		49,901,824	64,158,393
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,648,262,213	9,341,984,740
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,190,210,570	13,337,958,416
元本等合計		16,838,472,783	22,679,943,156
純資産合計		16,838,472,783	22,679,943,156
負債純資産合計		16,888,374,607	22,744,101,549

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6月16日 至 2019年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)出資証券</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)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</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、出資証券、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首	2017年6月16日	2018年6月16日
期首元本額	4,755,388,415円	7,648,262,213円
期中追加設定元本額	3,327,846,253円	2,725,741,065円
期中一部解約元本額	434,972,455円	1,032,018,538円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	3,999,701,535円	4,497,284,850円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	540,038,266円	686,878,821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）	323,038,547円	334,635,641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）	227,561,132円	229,637,689円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,222,466円	1,216,249円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	35,023円	79,996円
iFree 外国REITイ ンデックス	70,112,709円	83,862,326円
iFree 8資産バランス	453,719,542円	710,450,097円

DCダイワ・グローバルREIT	1,576,902,629円	1,995,608,217円
ITインデックスファンド		
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,424,485円	2,943,144円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,256,261円	5,830,872円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,336,304円	1,473,077円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	284,483,123円	247,516,568円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	25,922,759円	29,860,566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)	129,954,928円	294,668,334円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,552,504円	220,038,293円
計	7,648,262,213円	9,341,984,740円
2. 期末日における受益権の総数	7,648,262,213口	9,341,984,740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6月16日 至 2019年6月17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)における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	3,726,817	3,679,934
投資証券	252,937,558	1,672,277,308
合計	249,210,741	1,675,957,242

(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6月15日まで、及び2018年12月1日から2019年6月17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6月15日 現在				2019年6月17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	164,465,621	-	164,086,117	379,504	208,985,320	-	217,708,695	8,723,375
合計	164,465,621	-	164,086,117	379,504	208,985,320	-	217,708,695	8,723,375

(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6月15日 現在				2019年6月17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	108,411,289	-	108,916,300	505,011	133,244,999	-	133,635,275	390,276
アメリカ・ドル	82,330,999	-	82,893,700	562,701	97,266,586	-	97,695,000	428,414
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	8,257,836	-	8,200,200	57,636

オーストラ ア・ドル	-	-	-	-	4,259,296	-	4,259,040	256
カナダ・ドル	-	-	-	-	11,135,297	-	11,169,420	34,123
シンガポ ー ル・ドル	10,666,392	-	10,674,600	8,208	7,920,800	-	7,915,000	5,800
ニュージ ー ランド・ドル	-	-	-	-	1,419,360	-	1,410,800	8,560
ユーロ	15,413,898	-	15,348,000	65,898	2,985,824	-	2,985,815	9
合計	108,411,289	-	108,916,300	505,011	133,244,999	-	133,635,275	390,276

(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6月15日現在	2019年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.2016円	2.4277円
(1万口当たり純資産額)	(22,016円)	(24,277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	14,300.000	1,282,710.000	
		アメリカ・ドル 小計		1,282,710.000 (139,379,269)	
投資信託受益証券 合計				139,379,269 [139,379,269]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,900	624,369.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	91,242.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	19,582	341,314.260	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,000	380,340.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,100	4,806,879.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	51,747	8,430,621.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	25,900	3,501,680.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,867	1,322,579.710	
		VORNADO REALTY TRUST	28,864	1,910,796.800	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,100	206,238.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,100	271,726.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,100	125,364.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	8,800	403,832.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	62,000	4,852,120.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,200	570,512.000	
		EPR PROPERTIES	12,500	975,000.000	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	42,175.000	
		CITY OFFICE REIT INC	5,300	65,084.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	13,333	261,193.470	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,829	308,951.370	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,400	141,784.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	10,000	288,500.000	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,700	201,771.000	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,600	683,958.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,300	315,858.000			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	109,243.000			
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	41,459.040			
HOST HOTELS & RESORTS INC	123,300	2,257,623.000			
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,308	1,070,573.760			
CORESITE REALTY CORP	6,100	701,134.000			

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,700	877,141.000	
RLJ LODGING TRUST	29,371	519,866.700	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	18,734.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	30,400	550,848.000	
CYRUSONE INC	18,200	1,072,162.000	
KIMCO REALTY CORP	70,200	1,314,846.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,700	40,330.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	34,150	985,227.500	
WHITESTONE REIT	5,800	73,718.000	
TIER REIT INC	9,000	259,920.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,600	1,336,608.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,700	427,455.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	33,000	929,610.000	
COLONY CAPITAL INC	78,811	401,936.100	
INVITATION HOMES INC	63,697	1,739,565.070	
JBG SMITH PROPERTIES	20,032	815,302.400	
CLIPPER REALTY INC	1,400	18,144.000	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	30,625.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	30,800	1,017,940.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,500	204,540.000	
VICI PROPERTIES INC	60,000	1,363,800.000	
SPIRIT MTA REIT	5,870	50,540.700	
RETAIL VALUE INC	2,009	69,471.220	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	16,600	307,598.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	16,835.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,300	89,279.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,400	151,872.000	
SAFEHOLD INC	1,300	38,376.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	118,941.200	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	8,300	89,391.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	7,500	159,900.000	
CORECIVIC INC	19,124	455,151.200	
STORE CAPITAL CORP	33,200	1,167,644.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,700	182,905.000	
LIFE STORAGE INC	7,800	765,258.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,400	302,400.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	13,682	163,089.440	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,600	100,980.000	
PARAMOUNT GROUP INC	33,600	495,936.000	

EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23,300	353,461.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	17,100	684,000.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,500	426,270.000	
STAG INDUSTRIAL INC	20,700	644,391.000	
VENTAS INC	59,679	3,984,170.040	
CARETRUST REIT INC	15,903	387,397.080	
GEO GROUP INC/THE	19,500	453,180.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,700	904,540.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,700	184,646.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	29,687	576,818.410	
UMH PROPERTIES INC	5,600	74,704.000	
IRON MOUNTAIN INC	48,000	1,523,040.000	
TERRENO REALTY CORP	9,900	469,755.000	
VEREIT INC	161,208	1,536,312.240	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,320	641,106.400	
SUN COMMUNITIES INC	14,400	1,859,328.000	
ACADIA REALTY TRUST	13,611	383,557.980	
ALEXANDER'S INC	600	231,852.000	
PROLOGIS INC	105,602	8,443,935.920	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,000	2,874,700.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	28,500	433,770.000	
SAUL CENTERS INC	1,700	96,900.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	25,239.500	
MACK-CALI REALTY CORP	14,500	349,160.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,100	1,709,176.000	
COUSINS PROPERTIES INC	70,007	681,868.180	
SITE CENTERS CORP	24,078	323,126.760	
DUKE REALTY CORP	59,800	1,898,650.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,100	704,001.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,967	3,281,216.730	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,100	772,049.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,400	1,650,936.000	
GETTY REALTY CORP	5,703	178,161.720	
WELLTOWER INC	64,700	5,323,516.000	
HCP INC	79,600	2,556,752.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,200	760,756.000	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27,400	672,396.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20,900	680,922.000	
EQUITY COMMONWEALTH	20,275	685,092.250	

KILROY REALTY CORP	16,800	1,299,648.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	24,600	1,235,904.000	
LTC PROPERTIES INC	6,400	292,800.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	34,800	327,120.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,028	2,241,308.120	
MACERICH CO/THE	17,600	607,728.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,000	1,860,450.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,100	558,344.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	27,100	1,498,088.000	
REALTY INCOME CORP	50,617	3,708,707.590	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18,400	525,320.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	56,674.000	
PUBLIC STORAGE	25,100	6,107,081.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,300	562,320.000	
REGENCY CENTERS CORP	27,920	1,922,850.400	
RPT REALTY	11,700	148,707.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,100	244,771.000	
SL GREEN REALTY CORP	14,000	1,225,560.000	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	38,000	304,760.000	
TAUBMAN CENTERS INC	9,800	429,240.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,400	94,160.000	
UDR INC	45,900	2,131,596.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	167,504.000	
WP CAREY INC	28,600	2,445,300.000	
WASHINGTON REIT	12,800	350,976.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,100	571,443.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	41,245.000	
AGREE REALTY CORP	6,100	412,604.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,448	1,294,206.480	
CUBESMART	31,300	1,063,574.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,226	520,638.120	
DIGITAL REALTY TRUST INC	34,778	4,165,013.280	
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	30,780.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,200	2,290,872.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	89,147.500	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	123,641.200	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,350	213,733.500	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,800	203,352.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	68,200.000	

	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,000	1,081,000.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	100,110.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,242	331,755.160	
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	8,049	128,784.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	63,500	1,145,540.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,300	125,021.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	27,100	1,118,959.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34,600	423,504.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	229,527	199,688.490	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 149,538,391.230 (16,248,841,591)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	383,930	244,563.410	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	59,270	8,783.810	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	86,570	78,518.990	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,170	105,218.660	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	88,110	83,880.720	
	REGIONAL REIT LTD	46,310	50,570.520	
	NEWRIVER REIT PLC	46,330	87,378.380	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100,490	77,075.830	
	LXI REIT PLC	54,038	68,520.180	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,330	46,071.840	
	RDI REIT PLC	41,036	41,282.210	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,151	1,070,102.810	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	60,790	58,844.720	
	SEGRO PLC	183,550	1,319,724.500	
	HAMMERSON PLC	127,610	360,498.250	
	UNITE GROUP PLC	44,520	422,940.000	
	BRITISH LAND CO PLC	163,330	880,675.360	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	45,691	325,685.440	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	125,101.390	
	DERWENT LONDON PLC	18,830	603,313.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	192,040	266,551.520	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,960	182,352.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	33,820	222,028.300	
	SHAFTESBURY PLC	39,160	320,524.600	
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,310	258,921.300	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	116,040	238,578.240	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	76,600	43,125.800	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	284,570	427,139.570	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 8,017,971.550 (1,096,457,610)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	499,797.200	イスラエル・シュケル
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 499,797.200 (15,048,894)	
オーストラリ ア・ドル	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	36,520	140,236.800	オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	278,284	333,940.800	
	RURAL FUNDS GROUP	50,595	117,380.400	
	VIVA ENERGY REIT	76,330	206,854.300	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	37,424	193,107.840	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	145,160	378,867.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	39,307	169,806.240	
	NATIONAL STORAGE REIT	105,195	194,084.770	
	APN INDUSTRIA REIT	11,760	34,809.600	
	GDI PROPERTY GROUP	83,310	117,883.650	
	SCENTRE GROUP	906,410	3,408,101.600	
	ARENA REIT	42,890	123,094.300	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,300	74,337.000	
	BWP TRUST	78,550	296,133.500	
	DEXUS	184,470	2,516,170.800	
	GPT GROUP	306,720	1,892,462.400	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	59,400	282,150.000	
	MIRVAC GROUP	676,340	2,171,051.400	
	STOCKLAND	414,450	1,807,002.000	
	ABACUS PROPERTY GROUP	52,350	220,393.500	
	GOODMAN GROUP	272,840	3,997,106.000	
	VICINITY CENTRES	547,060	1,411,414.800	
	CHARTER HALL GROUP	78,800	907,776.000	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	28,460	90,787.400	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 21,084,952.700	

			(1,575,678,515)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	156,938.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	15,400	210,518.000	
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	39,277.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	151,228.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	30,804.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,200	23,724.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	10,200	125,460.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15,200	198,360.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,200	27,930.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,900	238,173.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9,400	115,620.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,600	109,060.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,300	351,923.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	31,280.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,000	116,000.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,400	387,828.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,500	607,000.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,790	172,375.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,866	542,474.180	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,600	687,104.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	129,330.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,700	152,477.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4,900	133,182.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,500	99,645.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800	424,512.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 5,262,222.180 (426,239,996)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	153,628	251,949.920	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	81,200	82,012.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	365,100	511,140.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	125,490.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	86,478.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271,650	325,980.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	465,075	958,054.500	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	434,200	1,293,916.000	

	CAPITALAND MALL TRUST	478,900	1,245,140.000	
	SUNTEC REIT	379,400	717,066.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	389,700	615,726.000	
	KEPPEL REIT	308,400	388,584.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	104,960	166,886.400	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	213,600	277,680.000	
	ESR-REIT	294,337	166,300.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	130,600	210,266.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	114,968	295,467.760	
	STARHILL GLOBAL REIT	243,800	184,069.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	108,000	163,080.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,300	211,365.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267,200	61,456.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	216,480	465,432.000	
	CACHE LOGISTICS TRUST	174,500	134,365.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	318,400	643,168.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127,100	82,615.000	
	SPH REIT	89,600	94,976.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	95,000	57,475.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124,400	54,736.000	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	108,900	105,088.500	
	OUE HOSPITALITY TRUST	166,873	117,645.460	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 10,093,607.940 (800,019,366)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	51,480	111,196.800	
	ARGOSY PROPERTY LTD	128,520	171,574.200	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	243,920	382,954.400	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56,800	136,036.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	168,250	317,151.250	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190,240	320,554.400	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 1,439,467.050 (101,655,163)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,600	382,774.000	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	107,700.200	
	WERELDHAVE NV	6,470	150,751.000	

	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,290	3,163,946.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	6,530	156,589.400	
	NSI NV	2,731	101,183.550	
	VASTNED RETAIL NV	2,450	71,907.500	
	ICADE	7,460	596,800.000	
	ALTAREA	540	97,200.000	
	GECINA SA	9,211	1,234,274.000	
	KLEPIERRE	34,830	1,032,012.900	
	COVIVIO	10,442	991,467.900	
	MERCIALYS	8,070	92,643.600	
	AEDIFICA	4,144	348,924.800	
	COFINIMMO	3,560	400,856.000	
	BEFIMMO	3,720	193,068.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,310	83,577.500	
	RETAIL ESTATES	1,140	91,998.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,920	419,312.000	
	MONTEA	1,650	127,380.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	37,315.200	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	72,657.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	45,083	458,494.110	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	61,780	756,187.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	58,050	94,389.300	
	GREEN REIT PLC	111,570	195,470.640	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	159,248.800	
ユーロ 小計			ユーロ 11,618,129.100 (1,415,901,393)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 38,820,000.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 38,820,000.000 (3,559,794)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	227,000	香港・ドル 1,205,370.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	153,000	899,640.000	
	FORTUNE REIT	232,000	2,454,560.000	
	PROSPERITY REIT	195,000	647,400.000	
	LINK REIT	360,500	34,553,925.000	
	CHAMPION REIT	327,000	2,132,040.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル	

			41,892,935.000 (581,055,008)
投資証券	合計		22,264,457,330 [22,264,457,330]
合計			22,403,836,599 [22,403,836,599]

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄 投資証券 156銘柄	0.9%	99.1%	73.1%
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	-%	100%	4.9%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 24銘柄	-%	100%	7.0%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	100%	6.3%
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%	2.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 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6月16日から2019年6月17日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2018年6月15日現在	第3期 2019年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	101,438	-
コール・ローン	9,236,199	4,709,600
親投資信託受益証券	1,188,948,246	1,667,535,713
未収入金	6,340,000	57,000
流動資産合計	1,204,625,883	1,672,302,313
資産合計	1,204,625,883	1,672,302,313
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,274,604	1,393,062
未払受託者報酬	111,131	160,288
未払委託者報酬	2,084,515	3,006,396
その他未払費用	27,742	40,404
流動負債合計	15,497,992	4,600,150
負債合計	15,497,992	4,600,150
純資産の部		
元本等		
元本	1,094,522,792	1,397,806,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	94,605,099	269,895,187
(分配準備積立金)	34,010,134	146,911,049
元本等合計	1,189,127,891	1,667,702,163
純資産合計	1,189,127,891	1,667,702,163
負債純資産合計	1,204,625,883	1,672,302,313

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自 2017年6月16日 至 2018年6月15日		自 2018年6月16日 至 2019年6月17日	
営業収益				
有価証券売買等損益	20,597,399		138,406,467	
その他収益	-		4,269	
営業収益合計	20,597,399		138,410,736	
営業費用				
支払利息	948		2,306	
受託者報酬	192,648		302,336	
委託者報酬	3,613,606		5,670,404	
その他費用	48,076		75,571	
営業費用合計	3,855,278		6,050,617	
営業利益	16,742,121		132,360,119	
経常利益	16,742,121		132,360,119	
当期純利益	16,742,121		132,360,119	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	29,672		12,601,767	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	41,449,491		94,605,099	
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,868,012		81,446,671	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,868,012		81,446,671	
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,424,853		25,914,935	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,424,853		25,914,935	
分配金	1 -		1 -	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	94,605,099		269,895,187	

(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6月16日	至 2019年6月17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6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在
1. 1 期首元本額	568,394,416円	1,094,522,792円
期中追加設定元本額	637,956,340円	579,621,490円
期中一部解約元本額	111,827,964円	276,337,306円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,094,522,792口	1,397,806,976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6月16日 至 2018年6月15日	自 2018年6月16日 至 2019年6月17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(16,713,215円)、投資信託約款に規定される収益調整金(60,595,866円)及び分配準備積立金(17,296,919円)より分配対象額は94,606,000円(1万口当たり864.36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(2,111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(119,755,520円)、投資信託約款に規定される収益調整金(122,984,138円)及び分配準備積立金(27,153,418円)より分配対象額は269,895,187円(1万口当たり1,930.85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6月16日 至 2019年6月17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6月17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6月15日現在	2019年6月17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	20,548,428	133,605,371
合計	20,548,428	133,605,371

（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6月15日現在	2019年6月17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6月16日
至 2019年6月17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6月15日現在	2019年6月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0864円 (10,864円)	1.1931円 (11,931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	686,878,821	1,667,535,713	
親投資信託受益証券 合計			1,667,535,713	
合計			1,667,535,713	

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 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		52,857,455
親投資信託受益証券		11,341,086,645
流動資産合計		11,393,944,100
資産合計		11,393,944,100
負債の部		
流動負債		
未払解約金		34,994,181
未払受託者報酬		1,083,675
未払委託者報酬		15,713,929
その他未払費用		273,522
流動負債合計		52,065,307
負債合計		52,065,307
純資産の部		
元本等		
元本		1 8,215,530,371
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		3,126,348,422
(分配準備積立金)		557,462,727
元本等合計		11,341,878,793
純資産合計		11,341,878,793
負債純資産合計		11,393,944,100

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	80
有価証券売買等損益	1,435,111,898
営業収益合計	1,435,111,978
営業費用	
支払利息	4,431
受託者報酬	1,083,675
委託者報酬	15,713,929
その他費用	273,551
営業費用合計	17,075,586
営業利益又は営業損失（ ）	1,418,036,392
経常利益又は経常損失（ ）	1,418,036,392
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,418,036,392
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	86,745,765
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,500,758,750
剰余金増加額又は欠損金減少額	546,370,923
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	546,370,923
剰余金減少額又は欠損金増加額	252,071,878
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	252,071,878
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,126,348,422

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	7,338,540,787円
期中追加設定元本額	2,081,777,643円
期中一部解約元本額	1,204,788,059円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	8,215,530,371口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3805円 (13,805円)

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,046,321,584
株式	160,088,684,700
派生商品評価勘定	12,040,200
未収入金	4,809,500
未収配当金	16,221,170

未収利息		554,015
その他未収収益	4	4,723,315
差入委託証拠金		9,120,000
流動資産合計		173,182,474,484
資産合計		173,182,474,484
負債の部		
流動負債		
前受金		9,635,000
未払解約金		330,981,680
受入担保金		12,081,242,879
流動負債合計		12,421,859,559
負債合計		12,421,859,559
純資産の部		
元本等		
元本	1	141,478,894,492
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		19,281,720,433
元本等合計		160,760,614,925
純資産合計		160,760,614,925
負債純資産合計		173,182,474,484

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

	(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	137,575,273,801円
期中追加設定元本額	23,448,172,265円
期中一部解約元本額	19,544,551,574円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス ファンド	3,725,081,949円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	7,483,613,601円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	5,762,771円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	757,369,276円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	46,148,600円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	1,115,043,907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)	49,280,185円
D-I's TOPIXイン デックス	55,205,568円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	15,656,840円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,197,584円
iFree TOPIXイン デックス	1,317,113,184円
iFree 8資産バランス	2,037,018,533円
iFree 年金バランス	65,777,526円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,872,581,302円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,834,256,690円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,207,500,578円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,977,185,378円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,813,210,329円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	13,334,541円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	55,752,305円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	25,479,310円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	305,256,682円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,530,950円

	ダイワつみたてインデックス バランス50	442,340円
	ダイワつみたてインデックス バランス70	2,320,710円
	ダイワ世界バランスファンド 40VA	147,698,185円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	156,400,259円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,507,004,927円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	719,627,452円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	111,646,037円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	215,465,757円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	144,834,058円
	ダイワファンドラップTO PIXインデックス	9,980,715,168円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	7,734,871,439円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,559,229,179円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,314,751,897円
	ダイワライフスタイル25	177,904,636円
	ダイワライフスタイル50	658,765,493円
	ダイワライフスタイル75	529,987,111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)	12,670,262,934円
	計	141,478,894,492円
2.	期末日における受益権の総数	141,478,894,492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	11,581,085,750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	581,820,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分3,490,420円が含まれております。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年12月17日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買 建	615,960,000	-	628,020,000	12,060,000
合計	615,960,000	-	628,020,000	12,060,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.1363円
（1万口当たり純資産額）	（11,363円）

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		43,408,610
親投資信託受益証券		10,987,953,597
流動資産合計		11,031,362,207
資産合計		11,031,362,207
負債の部		
流動負債		
未払解約金		25,653,944
未払受託者報酬		1,011,805
未払委託者報酬		14,671,876
その他未払費用		255,396
流動負債合計		41,593,021
負債合計		41,593,021
純資産の部		
元本等		
元本		17,232,830,922
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,756,938,264
（分配準備積立金）		530,558,312
元本等合計		10,989,769,186
純資産合計		10,989,769,186
負債純資産合計		11,031,362,207

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	40
有価証券売買等損益	1,371,216,253
営業収益合計	1,371,216,293
営業費用	
支払利息	5,622
受託者報酬	1,011,805
委託者報酬	14,671,876
その他費用	255,792
営業費用合計	15,945,095
営業利益又は営業損失（ ）	1,355,271,198
経常利益又は経常損失（ ）	1,355,271,198
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,355,271,198
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	60,469,454
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,989,148,348
剰余金増加額又は欠損金減少額	776,891,338
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	776,891,338
剰余金減少額又は欠損金増加額	303,903,166
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	303,903,166
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,756,938,264

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	6,163,193,495円
期中追加設定元本額	2,000,296,568円
期中一部解約元本額	930,659,141円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	7,232,830,922口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5194円 (15,194円)

（参考）

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

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

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,991,074,483
株式	2 163,010,451,280
派生商品評価勘定	24,892,020
未収入金	4,004,487,716
流動資産合計	169,030,905,499

資産合計		169,030,905,499
負債の部		
流動負債		
前受金		17,198,280
未払解約金		3,549,763,200
流動負債合計		3,566,961,480
負債合計		3,566,961,480
純資産の部		
元本等		
元本	1	54,511,920,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		110,952,023,310
元本等合計		165,463,944,019
純資産合計		165,463,944,019
負債純資産合計		169,030,905,499

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	65,172,307,878円
期中追加設定元本額	4,213,558,798円
期中一部解約元本額	14,873,945,967円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファ ンド225	25,181,829,173円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・ストックインデックス ファンド225VA	579,671,085円
大和 スtock インデックス 225 ファンド	9,237,405,720円
D - I ' s 日経225イン デックス	176,277,043円
i F r e e 日経225イン デックス	2,184,913,578円
DC・ダイワ・ストックイン デックス225（確定拠出年 金専用ファンド）	5,431,443,285円
ダイワ・ノーロード 日経2 25ファンド	224,772,832円
ダイワファンドラップ 日経 225インデックス	3,619,935,955円
ダイワ日経225インデック ス（ダイワSMA専用）	9,544,948円
ダイワ・インデックスセレク ト 日経225	7,866,127,090円
計	54,511,920,709円
2. 期末日における受益権の総数	54,511,920,709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。

株式 2,566,450,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2019年12月17日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,424,071,880	-	2,449,020,000	24,948,120
合計	2,424,071,880	-	2,449,020,000	24,948,120

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	3.0354円
(1万口当たり純資産額)	(30,354円)

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		160,989,775
親投資信託受益証券		41,629,003,940
流動資産合計		41,789,993,715
資産合計		41,789,993,715
負債の部		
流動負債		
未払解約金		70,848,149
未払受託者報酬		4,154,897
未払委託者報酬		79,982,435
その他未払費用		1,049,297
流動負債合計		156,034,778
負債合計		156,034,778
純資産の部		
元本等		
元本		¹ 30,219,337,258
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		11,414,621,679
(分配準備積立金)		2,786,624,642
元本等合計		41,633,958,937
純資産合計		41,633,958,937
負債純資産合計		41,789,993,715

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	149
有価証券売買等損益	3,432,467,371
営業収益合計	3,432,467,520
営業費用	
支払利息	24,792
受託者報酬	4,154,897
委託者報酬	79,982,435
その他費用	1,049,555
営業費用合計	85,211,679
営業利益又は営業損失（ ）	3,347,255,841
経常利益又は経常損失（ ）	3,347,255,841
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,347,255,841
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	184,167,512
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,551,573,778
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,931,408,190
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,931,408,190
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,231,448,618
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,231,448,618
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	11,414,621,679

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	28,513,883,705円
期中追加設定元本額	6,306,527,363円
期中一部解約元本額	4,601,073,810円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	30,219,337,258口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3777円 (13,777円)

（参考）

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	183,817,143
コール・ローン	1,434,618,067
株式	48,452,668,074
投資証券	1,412,845,110
派生商品評価勘定	68,572,328

未収入金		201,043
未収配当金		61,075,814
差入委託証拠金		447,519,276
流動資産合計		52,061,316,855
資産合計		52,061,316,855
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		230,743,611
未払解約金		14,115,000
流動負債合計		244,858,611
負債合計		244,858,611
純資産の部		
元本等		
元本	1	24,465,094,347
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,351,363,897
元本等合計		51,816,458,244
純資産合計		51,816,458,244
負債純資産合計		52,061,316,855

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

	<p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	21,623,237,931円
期中追加設定元本額	5,962,534,627円
期中一部解約元本額	3,120,678,211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）	19,654,864,939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）	1,127,349,975円
i F r e e 外国株式イン デックス（為替ヘッジあり）	461,196,161円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジあり）（ダイワ S M A 専用）	3,221,683,272円
計	24,465,094,347円
2. 期末日における受益権の総数	24,465,094,347口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,310,076,933	-	2,378,079,910	68,002,977
合計	2,310,076,933	-	2,378,079,910	68,002,977

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	49,746,495,589	-	49,976,669,849	230,174,260
アメリカ・ドル	34,459,932,754	-	34,468,961,085	9,028,331
イギリス・ポンド	2,944,929,704	-	3,027,427,210	82,497,506

イスラエル・ シュケル	66,588,374	-	66,040,674	547,700
オーストラリ ア・ドル	1,253,805,486	-	1,272,711,054	18,905,568
カナダ・ドル	1,779,659,826	-	1,794,735,415	15,075,589
シンガポ ー ル・ドル	243,343,854	-	245,520,974	2,177,120
スイス・フラ ン	1,649,858,436	-	1,676,748,240	26,889,804
スウェーデ ン・クローナ	495,067,378	-	505,311,940	10,244,562
デンマーク・ クローネ	343,572,015	-	346,718,400	3,146,385
ニュージー ランド・ドル	55,227,406	-	56,676,369	1,448,963
ノルウェー・ クローネ	114,991,308	-	117,442,800	2,451,492
ユーロ	5,730,251,890	-	5,786,255,478	56,003,588
香港・ドル	609,267,158	-	612,120,210	2,853,052
合計	49,746,495,589	-	49,976,669,849	230,174,260

(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)

	2019年12月17日現在
--	---------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1180円 (21,180円)
---------------------------	----------------------

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		34,127,007
親投資信託受益証券		5,318,204,452
未収入金		22,939,900
流動資産合計		5,375,271,359
資産合計		5,375,271,359
負債の部		
流動負債		
未払解約金		46,048,493
未払受託者報酬		516,841
未払委託者報酬		9,950,183
その他未払費用		130,487
流動負債合計		56,646,004
負債合計		56,646,004
純資産の部		
元本等		
元本		1 3,412,362,424
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,906,262,931
（分配準備積立金）		240,342,254
元本等合計		5,318,625,355
純資産合計		5,318,625,355
負債純資産合計		5,375,271,359

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	22
有価証券売買等損益	530,507,319
営業収益合計	530,507,341
営業費用	
支払利息	1,960
受託者報酬	516,841
委託者報酬	9,950,183
その他費用	130,498
営業費用合計	10,599,482
営業利益又は営業損失（ ）	519,907,859
経常利益又は経常損失（ ）	519,907,859
中間純利益又は中間純損失（ ）	519,907,859
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	26,047,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,294,982,361
剰余金増加額又は欠損金減少額	409,043,238
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	409,043,238
剰余金減少額又は欠損金増加額	291,622,780
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	291,622,780
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,906,262,931

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	3,228,404,217円
期中追加設定元本額	906,691,959円
期中一部解約元本額	722,733,752円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,412,362,424口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5586円 (15,586円)

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	692,934,038
コール・ローン	3,814,952,130
株式	123,683,847,438
投資証券	3,569,478,873
派生商品評価勘定	341,370,447

未収入金		2,149,076
未収配当金		158,712,746
差入委託証拠金		1,590,579,373
流動資産合計		133,854,024,121
資産合計		133,854,024,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		360,000
未払金		20,849,385
未払解約金		46,469,300
流動負債合計		67,678,685
負債合計		67,678,685
純資産の部		
元本等		
元本	1	47,913,126,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		85,873,219,253
元本等合計		133,786,345,436
純資産合計		133,786,345,436
負債純資産合計		133,854,024,121

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	44,938,531,796円
期中追加設定元本額	7,567,657,401円
期中一部解約元本額	4,593,063,014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	460,242,642円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	12,135,579円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	134,058,978円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	18,713,870円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	459,765,228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)	9,107,704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)	543,057,737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)	1,904,596,373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)	535,638,952円
D-I's 外国株式インデッ クス	2,784,848円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	2,288,919円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,157,871,460円
iFree 8資産バランス	835,395,033円
iFree 年金バランス	26,977,520円
DCダイワ外国株式インデッ クス	29,524,521,029円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	573,669,834円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	873,279,649円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	678,322,151円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,502,624,902円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,984,064円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,587,930円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,930,998円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	163,126,351円
ダイワつみたてインデックス バランス30	314,604円
ダイワつみたてインデックス バランス50	121,712円
ダイワつみたてインデックス バランス70	530,015円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	178,064,087円

ダイワ世界バランスファンド 60VA	314,293,124円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,612,986,908円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	126,914,123円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	677,616,091円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	113,502,125円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	1,599,086,912円
ダイワ投信倶楽部外国株式 インデックス	2,708,114,156円
ダイワライフスタイル25	18,324,834円
ダイワライフスタイル50	67,237,430円
ダイワライフスタイル75	54,338,311円
計	47,913,126,183円
2. 期末日における受益権の総数	47,913,126,183口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	6,159,132,902	-	6,491,087,359	331,954,457
合計	6,159,132,902	-	6,491,087,359	331,954,457

(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	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	3,732,321,510	-	3,741,377,500	9,055,990
アメリカ・ドル	3,016,718,160	-	3,017,508,000	789,840
イギリス・ポンド	49,485,450	-	50,855,000	1,369,550

オーストラリア ・ドル	51,869,440	-	52,633,000	763,560
カナダ・ドル	127,720,310	-	128,727,500	1,007,190
スイス・フラン	87,713,600	-	89,120,000	1,406,400
ユーロ	398,814,550	-	402,534,000	3,719,450
合計	3,732,321,510	-	3,741,377,500	9,055,990

(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)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	2.7923円
(1万口当たり純資産額)	(27,923円)

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

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

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

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		19,113,844
親投資信託受益証券		1,902,542,882
流動資産合計		1,921,656,726
資産合計		1,921,656,726
負債の部		
流動負債		
未払解約金		45,672
未払受託者報酬		191,078
未払委託者報酬		3,774,704
その他未払費用		48,189
流動負債合計		4,059,643
負債合計		4,059,643
純資産の部		
元本等		
元本		1,258,799,807
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		658,797,276
(分配準備積立金)		114,126,482
元本等合計		1,917,597,083
純資産合計		1,917,597,083
負債純資産合計		1,921,656,726

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	24
有価証券売買等損益	183,434,564
営業収益合計	183,434,588
営業費用	
支払利息	4,654
受託者報酬	191,078
委託者報酬	3,774,704
その他費用	48,250
営業費用合計	4,018,686
営業利益又は営業損失（ ）	179,415,902
経常利益又は経常損失（ ）	179,415,902
中間純利益又は中間純損失（ ）	179,415,902
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	6,342,734
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	480,575,393
剰余金増加額又は欠損金減少額	72,058,644
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	72,058,644
剰余金減少額又は欠損金増加額	66,909,929
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	66,909,929
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	658,797,276

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	1,267,003,630円
期中追加設定元本額	167,674,624円
期中一部解約元本額	175,878,447円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,258,799,807口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5234円 (15,234円)

（参考）

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	61,331,251

コール・ローン		48,978,503
株式		7,988,961,421
投資証券		647,226,369
派生商品評価勘定		7,307,320
未収配当金		5,225,167
差入委託証拠金		24,969,799
流動資産合計		8,783,999,830
資産合計		8,783,999,830
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,870,000
流動負債合計		4,870,000
負債合計		4,870,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,310,651,762
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		3,468,478,068
元本等合計		8,779,129,830
純資産合計		8,779,129,830
負債純資産合計		8,783,999,830

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	4,567,104,546円
期中追加設定元本額	920,290,068円
期中一部解約元本額	176,742,852円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	12,552,028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)	233,599,155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)	230,524,962円
D-I's 新興国株式インデックス	104,862,998円
iFree 新興国株式インデックス	1,908,575,686円
iFree 8資産バランス	1,422,491,856円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	954,937,451円

ダイワ・インデックスセレクト ト 新興国株式	374,170,788円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	68,936,838円
計	5,310,651,762円
2. 期末日における受益権の総数	5,310,651,762口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2019年12月17日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	112,605,220	-	119,803,860	7,198,640
合計	112,605,220	-	119,803,860	7,198,640

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	10,824,320	-	10,933,000	108,680
アメリカ・ドル	10,824,320	-	10,933,000	108,680
合計	10,824,320	-	10,933,000	108,680

（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)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.6531円
(1万口当たり純資産額)	(16,531円)

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		117,318,365
親投資信託受益証券		30,629,088,120
流動資産合計		30,746,406,485
資産合計		30,746,406,485
負債の部		
流動負債		
未払解約金		64,630,239
未払受託者報酬		1,579,889
未払委託者報酬		19,749,223
その他未払費用		798,012
流動負債合計		86,757,363
負債合計		86,757,363
純資産の部		
元本等		
元本		1 30,431,153,192
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		228,495,930
（分配準備積立金）		582,446,317
元本等合計		30,659,649,122
純資産合計		30,659,649,122
負債純資産合計		30,746,406,485

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	622
有価証券売買等損益	211,454,556
営業収益合計	211,453,934
営業費用	
支払利息	18,105
受託者報酬	1,579,889
委託者報酬	19,749,223
その他費用	798,212
営業費用合計	22,145,429
営業損失（ ）	233,599,363
経常損失（ ）	233,599,363
中間純損失（ ）	233,599,363
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	892,574
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	402,050,225
剰余金増加額又は欠損金減少額	128,628,579
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	128,628,579
剰余金減少額又は欠損金増加額	67,690,937
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	67,690,937
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	228,495,930

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	26,970,241,880円
期中追加設定元本額	7,880,423,286円
期中一部解約元本額	4,419,511,974円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	30,431,153,192口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0075円 (10,075円)

（参考）

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	372,949,621
国債証券	72,323,405,890
地方債証券	4,242,631,300
特殊債券	3,013,080,000
社債券	2,990,762,700

未収利息		206,661,590
前払費用		14,917,449
流動資産合計		83,164,408,550
資産合計		83,164,408,550
負債の部		
流動負債		
未払解約金		37,141,647
流動負債合計		37,141,647
負債合計		37,141,647
純資産の部		
元本等		
元本	1	58,213,309,346
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		24,913,957,557
元本等合計		83,127,266,903
純資産合計		83,127,266,903
負債純資産合計		83,164,408,550

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
-----	---------------

1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	55,985,054,926円
期中追加設定元本額	15,272,494,838円
期中一部解約元本額	13,044,240,418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)	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)	587,863,024円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	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)	873,680,762円
DCダイワ日本債券インデッ クス	7,292,300,759円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	11,306,271,591円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,851,336,264円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	261,171,292円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	369,416,535円
ダイワ・ノーロード 日本債 券ファンド	83,444,709円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	21,448,941,261円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	3,371,363,330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	1,507,202,164円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,118,995,959円

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,867,927,401円
ダイワライフスタイル25	451,001,638円
ダイワライフスタイル50	492,945,485円
ダイワライフスタイル75	137,786,925円
計	58,213,309,346円
2. 期末日における受益権の総数	58,213,309,346口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.4280円
（1万口当たり純資産額）	（14,280円）

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		298,729,649
親投資信託受益証券		82,351,164,731
流動資産合計		82,649,894,380
資産合計		82,649,894,380
負債の部		
流動負債		
未払解約金		57,422,962
未払受託者報酬		8,537,184
未払委託者報酬		153,670,248
その他未払費用		1,092,994
流動負債合計		220,723,388
負債合計		220,723,388
純資産の部		
元本等		
元本		1 82,257,838,953
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		171,332,039
(分配準備積立金)		2,088,284,072
元本等合計		82,429,170,992
純資産合計		82,429,170,992
負債純資産合計		82,649,894,380

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	318
有価証券売買等損益	934,943,330
営業収益合計	934,943,648
営業費用	
支払利息	64,961
受託者報酬	8,537,184
委託者報酬	153,670,248
その他費用	1,093,740
営業費用合計	163,366,133
営業利益	771,577,515
経常利益	771,577,515
中間純利益	771,577,515
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	167,109,108
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	696,115,241
剰余金増加額又は欠損金減少額	262,978,873
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	74,178,677
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	188,800,196
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	171,332,039

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	73,543,593,762円
期中追加設定元本額	18,680,083,050円
期中一部解約元本額	9,965,837,859円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	82,257,838,953口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0021円 (10,021円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	299,294,928
コール・ローン	1,705,649,410
国債証券	90,391,733,355
派生商品評価勘定	181,870
未収利息	564,371,438

前払費用		58,066,192
差入委託証拠金		164,982,251
流動資産合計		93,184,279,444
資産合計		93,184,279,444
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		706,771,020
未払解約金		5,362,555
流動負債合計		712,133,575
負債合計		712,133,575
純資産の部		
元本等		
元本	1	91,070,538,518
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,401,607,351
元本等合計		92,472,145,869
純資産合計		92,472,145,869
負債純資産合計		93,184,279,444

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

<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>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>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	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	88,872,666,940円
期中追加設定元本額	28,296,403,992円
期中一部解約元本額	26,098,532,414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	81,102,190,990円
債券インデックス（為替ヘッジあり）	
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス	3,477,222,945円
（為替ヘッジあり）	
ダイワ外国債券インデックス	6,491,124,583円
（為替ヘッジあり）（ダイワ	
SMA専用）	

計	91,070,538,518円
2. 期末日における受益権の総数	91,070,538,518口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 債券関連

種 類	2019年12月17日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
債券先物取引				
買 建	1,412,853,925	-	1,410,564,111	2,289,814
合計	1,412,853,925	-	1,410,564,111	2,289,814

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	91,199,675,614	-	91,903,974,950	704,299,336
アメリカ・ドル	44,292,767,362	-	44,361,862,160	69,094,798
イギリス・ポ ンド	5,853,453,015	-	6,013,654,350	160,201,335
オーストラリ ア・ドル	1,797,008,342	-	1,828,187,200	31,178,858
カナダ・ドル	1,676,430,474	-	1,693,306,450	16,875,976
シンガポー ル・ドル	445,530,013	-	450,002,140	4,472,127
スウェーデン ・クローナ	382,371,395	-	390,983,740	8,612,345
デンマーク・ クローネ	463,853,022	-	468,416,640	4,563,618
ノルウェー・ クローネ	177,085,967	-	180,987,960	3,901,993
ポーランド・ ズロチ	502,320,600	-	514,800,000	12,479,400
マレーシア・ リングgit	295,468,320	-	297,792,000	2,323,680
メキシコ・ペ ソ	770,369,730	-	795,679,250	25,309,520
ユーロ	34,057,305,298	-	34,412,631,660	355,326,362
南アフリカ・ ランド	485,712,076	-	495,671,400	9,959,324
合計	91,199,675,614	-	91,903,974,950	704,299,336

（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）

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.0154円
（1万口当たり純資産額）	（10,154円）

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		43,118,347
親投資信託受益証券		4,316,190,890
流動資産合計		4,359,309,237
資産合計		4,359,309,237
負債の部		
流動負債		
未払解約金		31,084,619
未払受託者報酬		424,186
未払委託者報酬		7,636,093
その他未払費用		160,647
流動負債合計		39,305,545
負債合計		39,305,545
純資産の部		
元本等		
元本		1 3,819,650,420
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		500,353,272
(分配準備積立金)		54,159,568
元本等合計		4,320,003,692
純資産合計		4,320,003,692
負債純資産合計		4,359,309,237

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	28
有価証券売買等損益	127,107,182
営業収益合計	127,107,210
営業費用	
支払利息	2,410
受託者報酬	424,186
委託者報酬	7,636,093
その他費用	160,663
営業費用合計	8,223,352
営業利益	118,883,858
経常利益	118,883,858
中間純利益	118,883,858
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	8,788,526
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	327,672,653
剰余金増加額又は欠損金減少額	112,008,399
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	112,008,399
剰余金減少額又は欠損金増加額	49,423,112
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	49,423,112
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	500,353,272

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	3,348,730,912円
期中追加設定元本額	969,986,907円
期中一部解約元本額	499,067,399円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,819,650,420口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1310円 (11,310円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	268,974,101
コール・ローン	1,811,262,478
国債証券	188,410,472,936
派生商品評価勘定	16,567,490
未収入金	180,792

未収利息		1,272,321,727
前払費用		54,548,501
流動資産合計		191,834,328,025
資産合計		191,834,328,025
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		60,570
未払金		382,302
未払解約金		31,481,822
流動負債合計		31,924,694
負債合計		31,924,694
純資産の部		
元本等		
元本	1	66,506,206,725
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		125,296,196,606
元本等合計		191,802,403,331
純資産合計		191,802,403,331
負債純資産合計		191,834,328,025

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	62,737,394,108円
期中追加設定元本額	6,062,864,286円
期中一部解約元本額	2,294,051,669円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックス V A	652,317,354円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,093,366円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	125,838,485円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	41,489,203円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	436,984,397円
外国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	34,211,693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)	427,985,571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)	1,496,598,783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)	790,897,906円
D-I's 外国債券インデッ クス	2,461,899円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	339,166円
iFree 外国債券イン デックス	608,893,080円
iFree 8資産バランス	792,271,952円
iFree 年金バランス	15,351,291円
DCダイワ外国債券インデッ クス	45,585,854,335円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	787,764,479円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	410,037,566円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	257,305,876円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	419,282,302円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コ ース)	324,748,380円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	107,023,276円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	9,435,326円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	21,677,737円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,214,181円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	71,723,912円
ダイワつみたてインデックス バランス30	448,277円
ダイワつみたてインデックス バランス50	57,519円
ダイワつみたてインデックス バランス70	199,958円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	198,574,327円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	150,201,932円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,920,494,957円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専 用）	281,187,508円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,920,362円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	33,571,569円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ SMA専用）	1,467,592,324円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,749,450,554円
ダイワライフスタイル25	34,626,796円
ダイワライフスタイル50	61,883,870円
ダイワライフスタイル75	17,195,256円
計	66,506,206,725円
2. 期末日における受益権の総数	66,506,206,725口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,727,177,820	-	1,743,684,740	16,506,920
アメリカ・ドル	665,364,759	-	667,011,660	1,646,901
イギリス・ポンド	56,195,354	-	57,410,050	1,214,696
オーストラリア・ドル	6,661,404	-	6,768,000	106,596
カナダ・ドル	23,091,495	-	23,337,050	245,555
ノルウェー・クローネ	33,540,812	-	34,129,920	589,108
ポーランド・ズロチ	27,444,600	-	28,228,200	783,600
メキシコ・ペソ	42,179,712	-	43,596,500	1,416,788
ユーロ	833,615,152	-	843,135,360	9,520,208
南アフリカ・ランド	39,084,532	-	40,068,000	983,468
合計	1,727,177,820	-	1,743,684,740	16,506,920

（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）

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	2,8840円
（1万口当たり純資産額）	（28,840円）

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

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

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

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2019年12月17日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,488,065
親投資信託受益証券	1,546,177,740
流動資産合計	1,550,665,805
資産合計	1,550,665,805
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	153,165
未払委託者報酬	2,834,437
その他未払費用	57,954
流動負債合計	3,045,556
負債合計	3,045,556
純資産の部	
元本等	
元本	1,353,376,641
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	194,243,608
（分配準備積立金）	20,746,391
元本等合計	1,547,620,249
純資産合計	1,547,620,249
負債純資産合計	1,550,665,805

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	5
有価証券売買等損益	55,242,957
営業収益合計	55,242,962
営業費用	
支払利息	780
受託者報酬	153,165
委託者報酬	2,834,437
その他費用	57,962
営業費用合計	3,046,344
営業利益	52,196,618
経常利益	52,196,618
中間純利益	52,196,618
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	1,820,145
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	125,063,465
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,974,206
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,974,206
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,170,536
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,170,536
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	194,243,608

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	1,219,423,623円
期中追加設定元本額	261,343,269円
期中一部解約元本額	127,390,251円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,353,376,641口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1435円 (11,435円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	152,089,515

コール・ローン		250,240,327
国債証券		14,712,275,856
派生商品評価勘定		3,680,802
未収入金		6,074
未収利息		235,973,562
前払費用		13,734,525
流動資産合計		15,368,000,661
資産合計		15,368,000,661
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		548,601
未払解約金		5,904,745
流動負債合計		6,453,346
負債合計		6,453,346
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,639,347,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,722,200,207
元本等合計		15,361,547,315
純資産合計		15,361,547,315
負債純資産合計		15,368,000,661

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17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	2019年12月17日現在
<p>1. 1 期首</p> <p>期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p> <p>期末元本額の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>2019年6月18日</p> <p>9,313,186,541円</p> <p>1,621,481,530円</p> <p>295,320,963円</p>

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)	26,504,270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)	216,004,540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)	399,231,075円
D-I's 新興国債券イン デックス	54,125,552円
iFree 新興国債券イン デックス	2,480,087,150円
iFree 8資産バランス	1,599,507,295円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	5,658,975,554円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	171,091,691円
ダイワ・ノーロード 新興 国債券ファンド	33,819,981円
計	10,639,347,108円
2. 期末日における受益権の総数	10,639,347,108口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	216,167,859	-	219,300,060	3,132,201
チェコ・コルナ	9,121,710	-	9,101,000	20,710
トルコ・リラ	34,097,701	-	33,593,130	504,571
ハンガリー・ フォリント	5,547,750	-	5,563,500	15,750
ポーランド・ズ ロチ	49,517,792	-	50,439,430	921,638
メキシコ・ペソ	54,605,119	-	56,350,000	1,744,881
ルーマニア・レ イ	5,037,000	-	5,096,000	59,000
南アフリカ・ラ ンド	58,240,787	-	59,157,000	916,213
合計	216,167,859	-	219,300,060	3,132,201

(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)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.4438円
(1万口当たり純資産額)	(14,438円)

【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ J - REITインデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2019年12月17日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,918,275
親投資信託受益証券	4,103,033,484
流動資産合計	4,125,951,759
資産合計	4,125,951,759
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,323,854
未払受託者報酬	415,537
未払委託者報酬	6,025,955
その他未払費用	104,864
流動負債合計	20,870,210
負債合計	20,870,210
純資産の部	
元本等	
元本	1,314,316,523
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	964,765,026
（分配準備積立金）	366,234,326
元本等合計	4,105,081,549
純資産合計	4,105,081,549
負債純資産合計	4,125,951,759

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	38
有価証券売買等損益	365,775,180
営業収益合計	365,775,218
営業費用	
支払利息	2,636
受託者報酬	415,537
委託者報酬	6,025,955
その他費用	104,889
営業費用合計	6,549,017
営業利益	359,226,201
経常利益	359,226,201
中間純利益	359,226,201
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	65,742,297
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	500,710,377
剰余金増加額又は欠損金減少額	268,668,230
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	268,668,230
剰余金減少額又は欠損金増加額	98,097,485
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	98,097,485
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	964,765,026

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	2,753,769,433円
期中追加設定元本額	896,211,001円
期中一部解約元本額	509,663,911円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	3,140,316,523口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3072円 (13,072円)

（参考）

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

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

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在
	金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,423,323,676
投資証券	356,908,787,260
未収入金	1,390,970,044
未収配当金	1,590,940,005
前払金	177,050,000

流動資産合計		365,491,070,985
資産合計		365,491,070,985
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		178,947,100
未払金		1,401,908,937
未払解約金		234,149,000
流動負債合計		1,815,005,037
負債合計		1,815,005,037
純資産の部		
元本等		
元本	1	112,442,996,683
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		251,233,069,265
元本等合計		363,676,065,948
純資産合計		363,676,065,948
負債純資産合計		365,491,070,985

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	95,580,504,970円
期中追加設定元本額	21,491,047,245円
期中一部解約元本額	4,628,555,532円

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス		350,272,419円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT		1,139,029,472円
計		112,442,996,683円
2. 期末日における受益権の総数		112,442,996,683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 1,106,000,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2019年12月17日 現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		(円)	
市場取引		うち 1年超	

不動産投信 指数先物取引				
買 建	6,661,400,000	-	6,482,795,000	178,605,000
合計	6,661,400,000	-	6,482,795,000	178,605,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	3.2343円
(1万口当たり純資産額)	(32,343円)

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		50,400,438
親投資信託受益証券		12,213,355,421
派生商品評価勘定		99,576
未収入金		1,502,340
流動資産合計		12,265,357,775
資産合計		12,265,357,775
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		46,499,157
未払金		66,736
未払解約金		22,732,289
未払受託者報酬		1,264,373
未払委託者報酬		23,707,867
その他未払費用		319,246
流動負債合計		94,589,668
負債合計		94,589,668
純資産の部		
元本等		
元本		11,167,363,574
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,003,404,533
（分配準備積立金）		954,848,400
元本等合計		12,170,768,107
純資産合計		12,170,768,107
負債純資産合計		12,265,357,775

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	36
有価証券売買等損益	443,626,991
為替差損益	287,671,701
営業収益合計	155,955,326
営業費用	
支払利息	9,168
受託者報酬	1,264,373
委託者報酬	23,707,867
その他費用	330,119
営業費用合計	25,311,527
営業利益	130,643,799
経常利益	130,643,799
中間純利益	130,643,799
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	26,323,067
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	769,299,979
剰余金増加額又は欠損金減少額	237,379,170
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	237,379,170
剰余金減少額又は欠損金増加額	107,595,348
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	107,595,348
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,003,404,533

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末
	2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	10,126,367,998円
期中追加設定元本額	2,433,905,327円
期中一部解約元本額	1,392,909,751円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	11,167,363,574口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2019年6月18日	2019年12月17日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在	
	1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	当中間計算期間末 2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	12,569,628,151	-	12,616,027,732	46,399,581
アメリカ・ドル	9,319,103,660	-	9,320,076,376	972,716
イギリス・ポンド	669,822,782	-	688,140,800	18,318,018
イスラエル・シェケル	10,628,156	-	10,547,859	80,297
オーストラリア・ドル	824,523,050	-	836,586,497	12,063,447
カナダ・ドル	243,740,689	-	245,678,510	1,937,821
シンガポール・ドル	460,587,490	-	464,464,478	3,876,988

ニュージーランド・ドル	52,876,103	-	54,185,814	1,309,711
ユーロ	739,316,141	-	746,261,442	6,945,301
香港・ドル	249,030,080	-	250,085,956	1,055,876
合計	12,569,628,151	-	12,616,027,732	46,399,581

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0899円 (10,899円)

(参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		226,841,944
コール・ローン		570,659,688
投資証券		26,288,800,059
派生商品評価勘定		12,085,391
未収入金		262,082
未収配当金		36,890,604
差入委託証拠金		108,975,247
流動資産合計		27,244,515,015
資産合計		27,244,515,015
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		21,287,944
未払金		235,560,206
未払解約金		4,728,440
流動負債合計		261,576,590
負債合計		261,576,590
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,701,296,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		16,281,642,171
元本等合計		26,982,938,425
純資産合計		26,982,938,425
負債純資産合計		27,244,515,015

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年6月18日 至 2019年12月17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	(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月17日現在
1. 1 期首	2019年6月18日
期首元本額	9,341,984,740円
期中追加設定元本額	2,187,100,324円
期中一部解約元本額	827,788,810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	4,843,686,465円
REITインデックス(為替	
ヘッジあり)	

ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	775,677,299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)	325,437,020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)	231,344,174円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,374,584円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	385,683円
iFree 外国REITイ ンデックス	100,372,651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)	901,273,124円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	386,814円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	2,258,199,822円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,670,316円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,719,175円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	2,133,005円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	240,058,318円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	35,382,315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)	762,662,050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)	213,146,625円
計	10,701,296,254円

2. 期末日における受益権の総数	10,701,296,254口
------------------	-----------------

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2019年12月17日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	752,729,029	-	742,065,319	10,663,710
合計	752,729,029	-	742,065,319	10,663,710

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2019年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	13,980,204	-	13,975,920	4,284
カナダ・ドル	13,980,204	-	13,975,920	4,284
買 建	644,200,587	-	645,657,460	1,456,873
アメリカ・ドル	475,071,147	-	475,585,500	514,353
オーストラリア ・ドル	31,775,291	-	31,772,380	2,911
シンガポール ・ドル	16,320,489	-	16,319,580	909
ユーロ	121,033,660	-	121,980,000	946,340
合計	658,180,791	-	659,633,380	1,461,157

(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)

	2019年12月17日現在
1口当たり純資産額	2.5215円
(1万口当たり純資産額)	(25,215円)

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2019年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		13,965,757
親投資信託受益証券		1,955,870,309
流動資産合計		1,969,836,066
資産合計		1,969,836,066
負債の部		
流動負債		
未払解約金		9,848,495
未払受託者報酬		194,418
未払委託者報酬		3,646,071
その他未払費用		49,020
流動負債合計		13,738,004
負債合計		13,738,004
純資産の部		
元本等		
元本		1,581,981,430
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		374,116,632
(分配準備積立金)		125,969,675
元本等合計		1,956,098,062
純資産合計		1,956,098,062
負債純資産合計		1,969,836,066

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
営業収益	
受取利息	6
有価証券売買等損益	67,741,596
営業収益合計	67,741,602
営業費用	
支払利息	762
受託者報酬	194,418
委託者報酬	3,646,071
その他費用	49,027
営業費用合計	3,890,278
営業利益	63,851,324
経常利益	63,851,324
中間純利益	63,851,324
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	6,460,131
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	269,895,187
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,664,549
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	90,664,549
剰余金減少額又は欠損金増加額	43,834,297
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	43,834,297
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	374,116,632

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 1 期首元本額	1,397,806,976円
期中追加設定元本額	410,746,782円
期中一部解約元本額	226,572,328円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,581,981,430口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年6月18日 至 2019年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2365円 (12,365円)

（参考）

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 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 TOPIXインデックス

【純資産額計算書】

2019年12月30日

資産総額	11,335,468,353円
負債総額	56,478,510円
純資産総額(-)	11,278,989,843円
発行済数量	8,281,756,670口
1単位当たり純資産額(/)	1.3619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 日経225インデックス

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	11,036,335,660円
負債総額	36,849,945円
純資産総額(-)	10,999,485,715円
発行済数量	7,353,224,685口
1単位当たり純資産額(/)	1.4959円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	161,414,877,545円
負債総額	1,350,316,100円
純資産総額（ - ）	160,064,561,445円
発行済数量	53,557,223,322口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.9887円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	42,364,913,640円
負債総額	6,733,702円
純資産総額（ - ）	42,358,179,938円
発行済数量	30,375,656,823口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3945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 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	5,453,572,155円
負債総額	862,547円
純資産総額（ - ）	5,452,709,608円
発行済数量	3,450,633,973口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5802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

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

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	1,966,788,592円
負債総額	318,333円
純資産総額（ - ）	1,966,470,259円
発行済数量	1,269,425,093口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5491円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

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 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	31,269,078,918円
負債総額	251,401,781円
純資産総額(-)	31,017,677,137円
発行済数量	30,753,768,949口
1単位当たり純資産額(/)	1.0086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 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	83,190,563,140円
負債総額	12,373,629円
純資産総額(-)	83,178,189,511円
発行済数量	83,042,203,066口
1単位当たり純資産額(/)	1.0016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 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	4,391,166,809円
負債総額	657,683円
純資産総額(-)	4,390,509,126円
発行済数量	3,874,524,678口
1単位当たり純資産額(/)	1.1332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

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

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	1,578,686,734円
負債総額	242,507円
純資産総額(-)	1,578,444,227円
発行済数量	1,375,345,404口
1単位当たり純資産額(/)	1.1477円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

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 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	4,269,424,983円
負債総額	18,092,624円
純資産総額(-)	4,251,332,359円
発行済数量	3,187,484,255口
1単位当たり純資産額(/)	1.3338円

(参考) ダイワ J - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

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 外国 R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)

純資産額計算書

2019年12月30日

資産総額	12,567,659,648円
負債総額	74,972,314円
純資産総額(-)	12,492,687,334円
発行済数量	11,291,440,155口
1単位当たり純資産額(/)	1.1064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 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	2,011,971,296円
負債総額	309,370円
純資産総額(-)	2,011,661,926円
発行済数量	1,599,330,054口
1単位当たり純資産額(/)	1.2578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 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。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年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)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799

投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（3）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (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す。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 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ます。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に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 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 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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(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的主要原因別内訳

(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)
繰延税金資産		
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
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡 益)	159	159
その他有価証券評価差 額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引(譲渡益)は480百万円減少しております。

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2018年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2019年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 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 hands 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せん。
- (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せん。
- (注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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)	
資産の部		
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)

負債の部	
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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	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す。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 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 その他有価証券	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

<FW 日経225インデックス>

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（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。

<その他各ファンド>

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ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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ないます。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

<FW 日経225インデックス>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（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。

<その他各ファンド>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- 使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

次の事項を記載することがあります。

- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

UD FONTマークおよび説明文を記載することがあります。

次の事項を記載することがあります。

- ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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7月19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 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6月16日から2019年6月17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 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6月17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7月19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 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月17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7月19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 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月17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7月19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 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6月16日から2019年6月17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 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6月17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7月19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 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月17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7月19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 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月17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7月19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 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月17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7月19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 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2018年6月16日から2019年6月17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 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月17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7月19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 J - R E I T インデックスの2018年6月16日から2019年6月17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 J - R E I T インデックスの2019年6月17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7月19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TOPIXインデックスの2018年6月16日から2019年6月17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TOPIXインデックスの2019年6月17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7月19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 日経225インデックスの2018年6月16日から2019年6月17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 日経225インデックスの2019年6月17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7月19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 日本債券インデックスの2018年6月16日から2019年6月17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 日本債券インデックスの2019年6月17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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 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6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 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6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 J - R E I T インデックス」の2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、「ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス」の2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップTOPIXインデックスの2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップTOPIXインデックスの2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 日経225インデックスの2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年1月17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 日本債券インデックスの2019年6月18日から2019年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2019年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年6月18日から2019年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。