

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 2020年8月7日提出

【発行者名】 大和アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 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】 グローバル・リート・インデックスファンド
（毎月決算型）
グローバル・リート・インデックスファンド
（資産形成型）

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 (1) 当初自己設定
各ファンドについて100万円とし、合計で200万円としま
す。
(2) 継続申込期間
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で20兆円を
上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年10月15日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

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】

< 訂正前 >

< 略 >

主な投資制限

- 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。
- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

主な投資制限

- 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。
- 株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

S&P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REIT指数（除く日本）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。

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

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	三井住友信託銀行 株式会社 再信託受託会社： 日本トラスティ・ サービス信託銀行株 式会社	信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。 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

< 略 >

< 委託会社の概況（2019年11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）

< 訂正後 >

< 略 >

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	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	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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

< 略 >

< 委託会社等の概況（2020年5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	<u>大和証券投資信託委託株式会社として設立</u>
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）
<u>2020年 4月 1日</u>	<u>大和アセットマネジメント株式会社に商号変更</u>

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

< 訂正前 >

< 略 >

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。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された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。

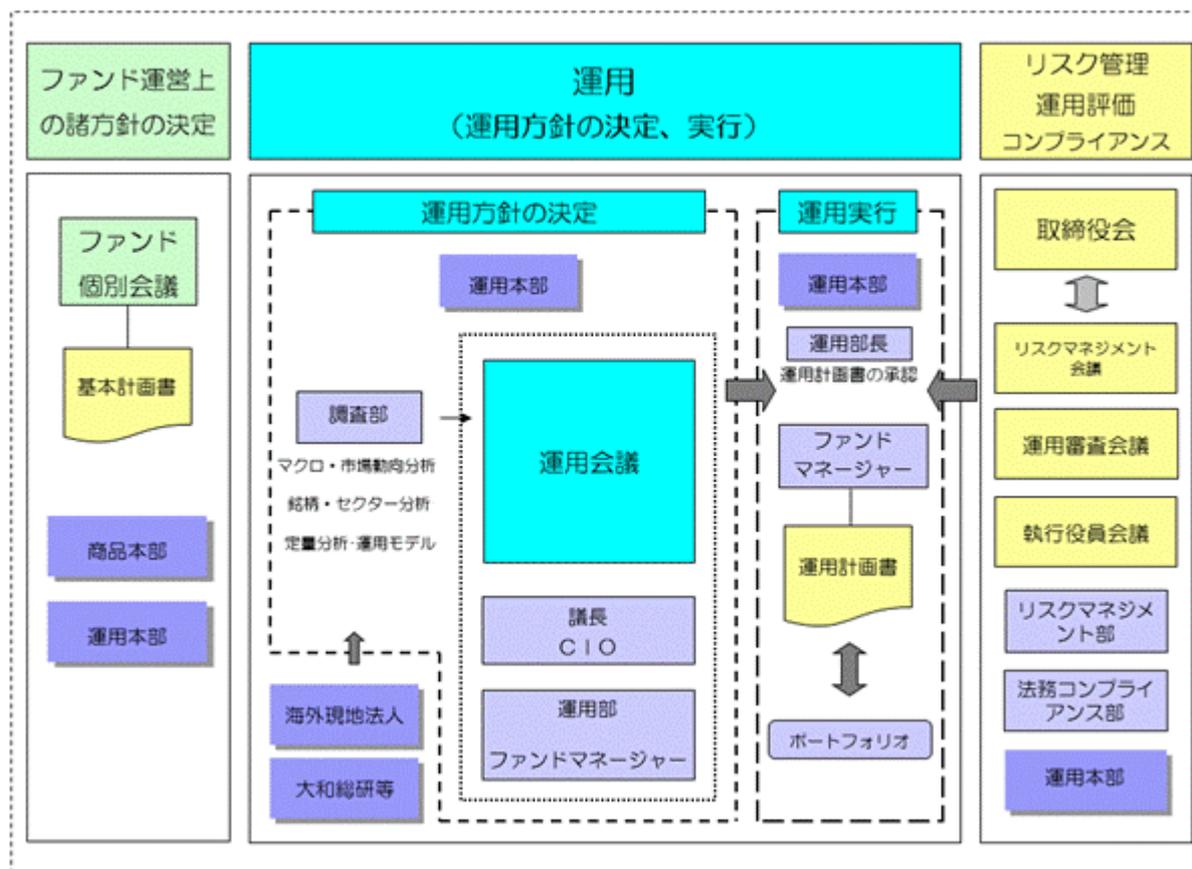
< 略 >

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

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

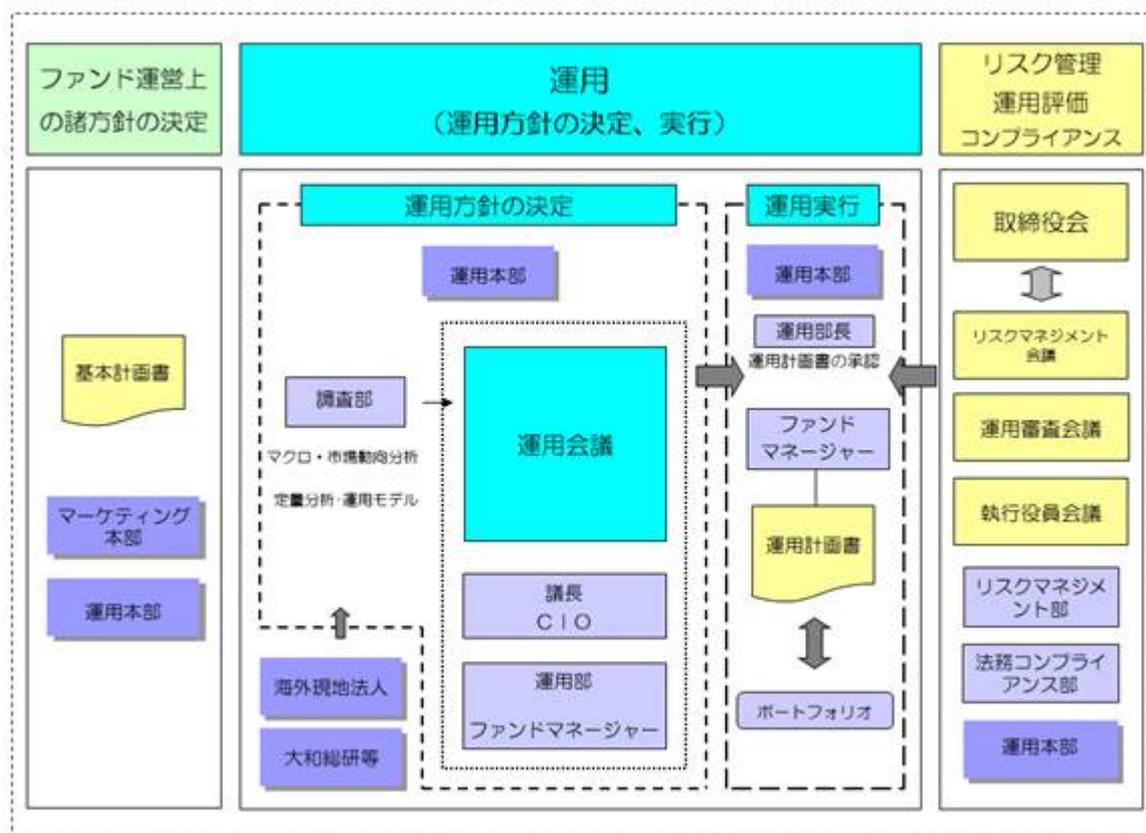
受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は2019年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (2名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO (0～5名程度)

CI0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）

CI0およびDeputy-CI0を補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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25～35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。

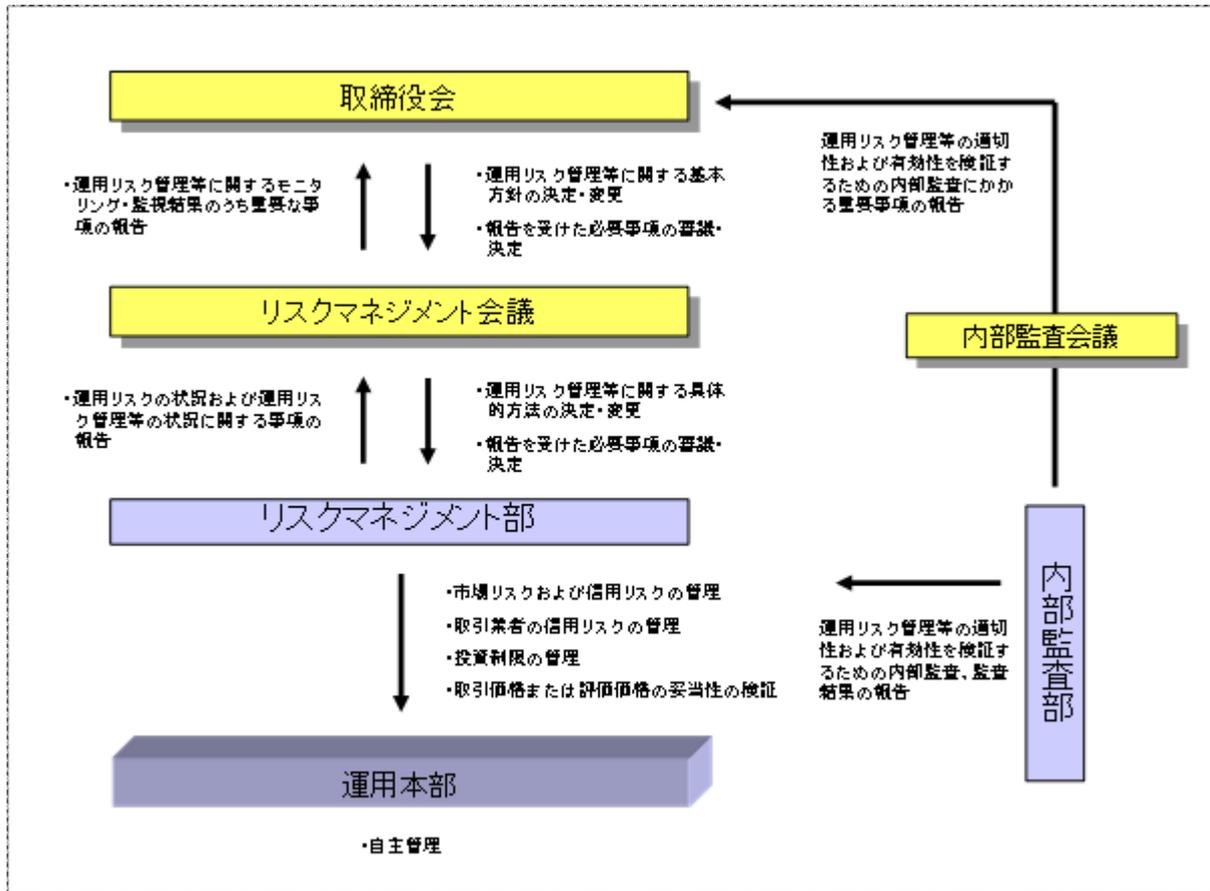
上記の運用体制は2020年5月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

3 【投資リスク】

(4) リスク管理体制

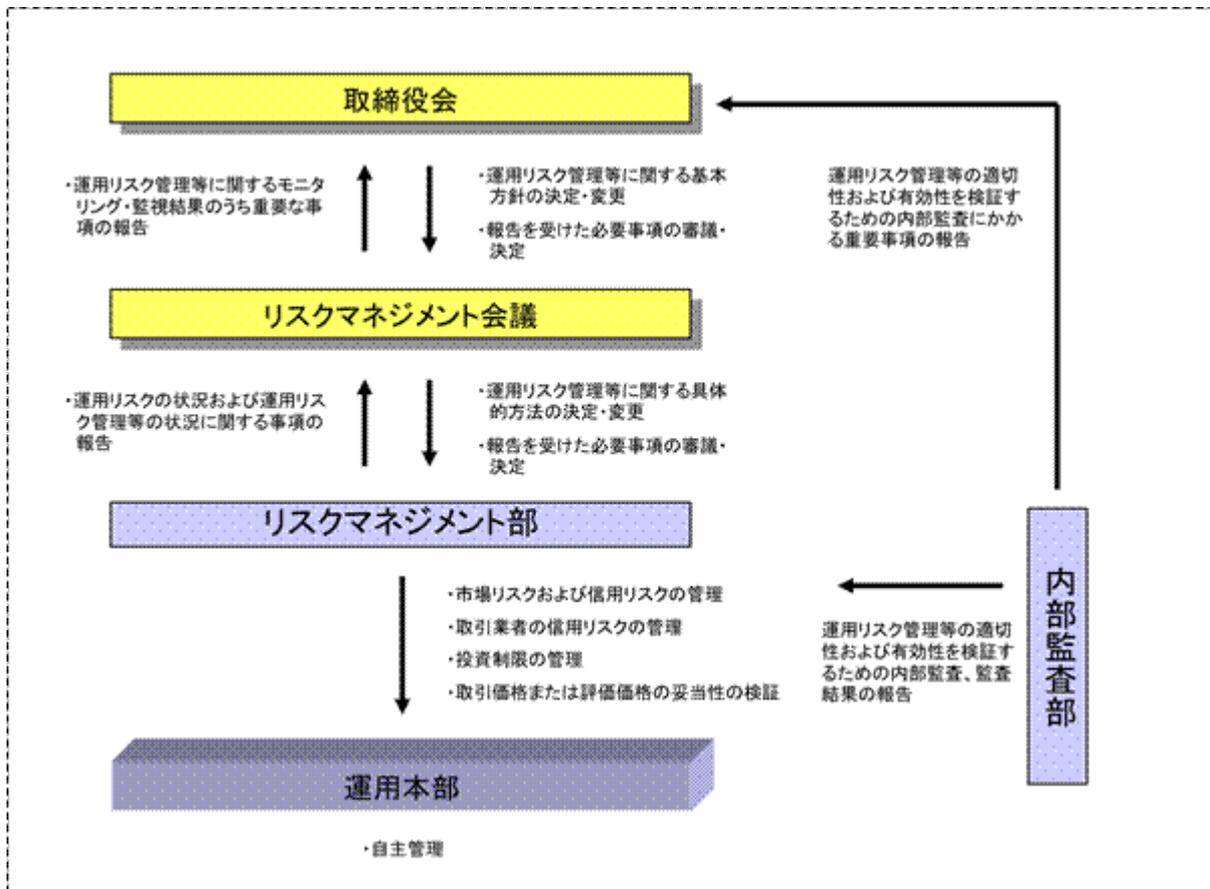
運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

<訂正前>



< 略 >

< 訂正後 >



< 略 >

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

() 上記は、2019年11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。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

() 上記は、2020年5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。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）】

(1) 【投資状況】（2020年5月29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	16,041,137	99.99
内 日本	16,041,137	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,357	0.01
純資産総額	16,042,494	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】（2020年5月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,068,171	1.7656 14,245,903	1.9882 16,041,137	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)
2019年10月末日	1,006,465	-	1.0065	-
第1特定期間末 (2019年11月14日)	972,788	972,788	0.9728	0.9728
11月末日	1,002,916	-	1.0029	-
12月末日	992,175	-	0.9922	-
2020年1月末日	1,009,560	-	1.0096	-
2月末日	949,203	-	0.9492	-
3月末日	710,314	-	0.7103	-
4月末日	14,310,379	-	0.7568	-
第2特定期間末 (2020年5月14日)	12,754,539	12,792,370	0.6743	0.6763
5月末日	16,042,494	-	0.7624	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0040

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.7
第2特定期間	30.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	0	0
第2特定期間	17,915,539	0

(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・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2020年5月29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	491,980,396	2.08
内 アメリカ	491,980,396	2.08
投資証券	22,469,761,655	94.82
内 ガーンジー	56,919,762	0.24
内 マン島	3,915,721	0.02
内 韓国	3,655,014	0.02
内 香港	398,388,426	1.68
内 シンガポール	990,197,764	4.18
内 イスラエル	13,383,133	0.06

内 イギリス	1,120,614,636	4.73
内 アイルランド	27,494,689	0.12
内 オランダ	39,160,551	0.17
内 ベルギー	247,266,942	1.04
内 フランス	452,750,604	1.91
内 ドイツ	55,586,832	0.23
内 スペイン	105,367,659	0.44
内 イタリア	2,415,956	0.01
内 カナダ	431,172,892	1.82
内 アメリカ	16,893,226,668	71.29
内 オーストラリア	1,526,755,958	6.44
内 ニュージーランド	101,488,448	0.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	735,944,612	3.11
純資産総額	23,697,686,663	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)	761,213,668	3.21
内 ドイツ	233,542,452	0.99
内 アメリカ	527,671,216	2.23
為替予約取引(買建)	427,254,400	1.80
内 日本	427,254,400	1.80

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

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

(注3) 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 (2020年5月29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	数 種類 は	株数、口 また 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	147,019	9,757.70 1,434,570,107	10,005.66 1,471,023,083	6.21
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	17,400	61,793.51 1,075,208,298	74,555.92 1,297,273,104	5.47
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	52,178	13,432.75 700,895,573	15,704.75 819,442,785	3.46
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	29,800	22,656.57 675,168,472	21,633.96 644,692,029	2.72
5	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	58,500	7,778.50 455,045,454	8,409.92 491,980,396	2.08
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	27,600	22,667.75 625,631,476	17,100.49 471,973,687	1.99
7	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	68,900	8,959.39 617,306,848	6,545.35 450,974,691	1.90

8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	80,000	8,825.52 706,045,744	5,520.59 441,647,216	1.86
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	67,517	7,977.22 538,604,685	5,989.42 404,387,738	1.71
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	24,200	17,292.97 418,492,157	16,682.20 403,709,342	1.70
11	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	60,347	15,599.69 941,397,124	6,424.91 387,724,496	1.64
12	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	333,730	1,041.85 347,714,689	1,099.50 366,937,303	1.55
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,967	33,028.05 428,275,673	26,759.91 346,995,828	1.46
14	LINK REIT	香港	投資証券	436,400	1,088.05 474,833,358	790.59 345,013,476	1.46
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	105,897	3,237.94 342,894,805	2,817.28 298,342,136	1.26
16	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	73,279	6,107.70 447,567,440	3,952.80 289,657,436	1.22
17	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	22,428	14,462.78 324,373,179	12,651.97 283,758,603	1.20
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	18,200	17,340.93 315,606,378	14,896.13 271,109,582	1.14
19	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	72,300	3,761.93 271,989,124	3,745.26 270,783,014	1.14
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	97,400	3,690.75 359,485,532	2,751.69 268,014,869	1.13
21	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	28,300	14,671.93 415,217,686	9,436.83 267,062,368	1.13
22	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	25,500	11,367.85 289,881,137	10,454.06 266,578,698	1.12
23	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	217,460	1,166.13 253,609,389	1,123.85 244,393,378	1.03
24	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	35,800	7,856.14 281,252,780	6,720.62 240,598,375	1.02
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	57,600	5,097.02 293,593,041	4,134.52 238,148,842	1.00
26	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	33,900	8,819.18 298,970,627	6,696.96 227,027,229	0.96
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	101,800	2,221.99 226,207,936	1,951.66 198,679,955	0.84
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	19,000	11,865.50 225,445,785	9,951.90 189,086,129	0.80
29	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	90,700	2,641.68 239,601,841	2,083.93 189,012,578	0.80
30	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,111,440	263.56 292,994,942	169.81 188,736,961	0.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	2.08%

投資証券	94.82%
合計	96.89%

(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6月	買建	160	466,026,418	527,671,216	2.23%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 2020年6月	買建	260	201,095,133	233,542,452	0.99%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2020年6月	買建	60,000	7,944,958	7,950,600	0.03%
		シンガポール・ドル買/円売 2020年6月	買建	20,000	1,516,924	1,517,600	0.01%
		米ドル買/円売 2020年6月	買建	2,560,000	273,921,464	275,228,600	1.16%
		ユーロ買/円売 2020年6月	買建	1,120,000	131,534,816	133,425,600	0.56%
		豪ドル買/円売 2020年6月	買建	100,000	7,136,440	7,134,000	0.03%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2020年6月	買建	30,000	1,995,396	1,998,000	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

【グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)】

(1) 【投資状況】(2020年5月29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	9,710,840	99.99
内 日本	9,710,840	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	774	0.01
純資産総額	9,711,614	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】(2020年5月29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	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,884,237	1.7798 8,693,049	1.9882 9,710,840	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)
2019年10月末日	1,006,465	-	1.0065	-
11月末日	1,002,916	-	1.0029	-
12月末日	992,175	-	0.9922	-
2020年1月末日	1,009,560	-	1.0096	-
2月末日	949,203	-	0.9492	-
3月末日	710,314	-	0.7103	-
4月末日	5,279,568	-	0.7589	-
第1計算期間末 (2020年5月14日)	5,749,554	5,749,554	0.6782	0.6782
5月末日	9,711,614	-	0.7668	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	32.2

(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	7,478,101	0
--------	-----------	---

(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・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)」の記載と同じ。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

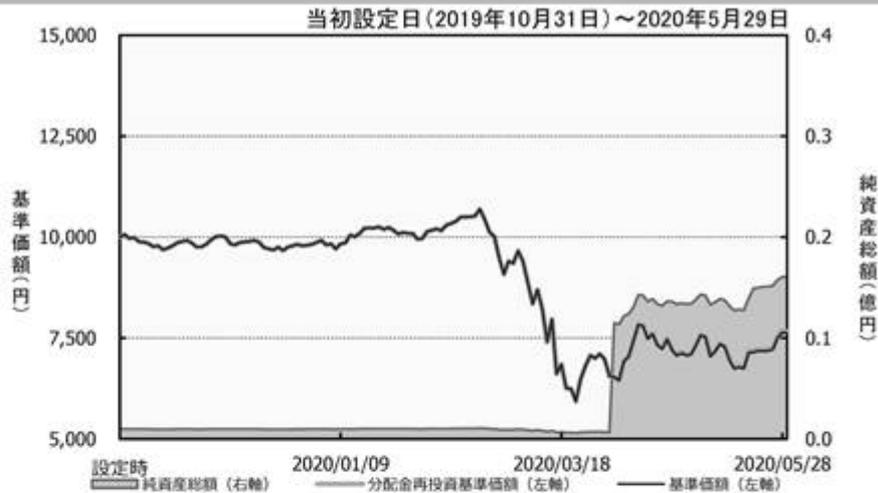
●グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)

2020年5月29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	7,624円
純資産総額	16百万円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.0%
3カ月間	-19.2%
6カ月間	-23.6%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	-23.3%

※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: 40円 設定来分配金合計額: 40円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	19年11月	19年12月	20年1月	20年2月	20年3月	20年4月	20年5月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	20円	20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。

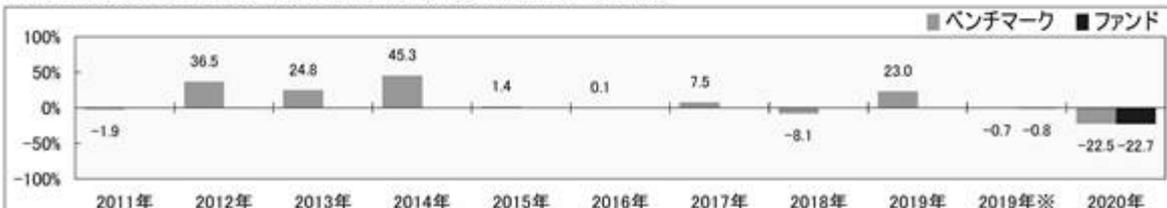
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	305	97.9%	米ドル	75.6%	産業施設	15.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.2%
外国投資信託等	3	2.2%	豪ドル	6.5%	住宅	14.9%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	5.5%
コール・ローン、その他		3.1%	英ポンド	5.0%	商業施設	14.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	3.5%
合計	308	-	ユーロ	4.9%	特殊用途施設	13.2%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.7%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.9%	オフィス	10.8%	DJ US REAL ESTATE 202006	-	アメリカ	2.2%
アメリカ		75.6%	カナダ・ドル	1.8%	各種不動産	8.9%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.1%
オーストラリア		6.4%	香港ドル	1.8%	ヘルスケア	8.9%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
イギリス		4.7%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.0%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.9%
シンガポール		4.2%	イスラエル・シケル	0.1%	ホテル/リゾート	2.5%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	1.9%
その他		9.2%	その他	-0.1%			REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
合計	100.1%	合計	100.0%	合計	94.7%	合計				29.6%

※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。

※2019年※は設定日(10月31日)から年末、2020年は5月29日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) 運用実績

●グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)

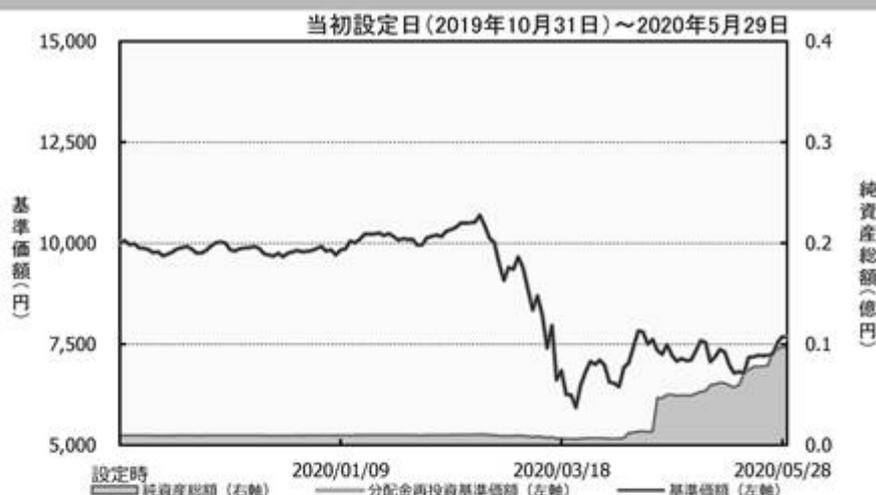
2020年5月29日現在

※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	7,668円
純資産総額	9百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.0%
3カ月間	-19.2%
6カ月間	-23.5%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	-23.3%



※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	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期
20年5月										
分配金	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	305	97.9%	米ドル	75.6%	産業施設	15.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.2%
外国投資信託等	3	2.2%	豪ドル	6.5%	住宅	14.9%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	5.5%
コール・ローン、その他		3.1%	英ポンド	5.0%	商業施設	14.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	3.5%
合計	308	-	ユーロ	4.9%	特殊用途施設	13.2%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.7%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.9%	オフィス	10.8%	DJ US REAL ESTATE 202006	-	アメリカ	2.2%
アメリカ		75.6%	カナダ・ドル	1.8%	各種不動産	8.9%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.1%
オーストラリア		6.4%	香港ドル	1.8%	ヘルスクエア	8.9%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
イギリス		4.7%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.0%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.9%
シンガポール		4.2%	イスラエル・シユケル	0.1%	ホテル/リゾート	2.5%	WELLTOWER INC	ヘルスクエア	アメリカ	1.9%
その他		9.2%	その他	-0.1%			REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	94.7%	合計			29.6%

※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。

・2019年※は設定日(10月31日)から年末、2020年は5月29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。

グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）

(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) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 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、当特定期間（2019年11月15日から2020年5月14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】

【グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	2019年11月14日現在 金 額（円）	2020年5月14日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	330	8,520
親投資信託受益証券	972,724	12,791,269
未収入金	-	500
流動資産合計	973,054	12,800,289
資産合計	973,054	12,800,289
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	-	37,831
未払受託者報酬	3	301
未払委託者報酬	249	7,406
その他未払費用	14	212
流動負債合計	266	45,750
負債合計	266	45,750
純資産の部		
元本等		
元本	1 1,000,000	18,915,539
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 27,212	6,161,000
（分配準備積立金）	2,773	1,255,361
元本等合計	972,788	12,754,539
純資産合計	972,788	12,754,539
負債純資産合計	973,054	12,800,289

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 2019年10月31日 至 2019年11月14日	自 2019年11月15日 至 2020年5月14日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
有価証券売買等損益	26,946	5,345
営業収益合計	26,946	5,345
営業費用		
受託者報酬	3	462
委託者報酬	249	12,324
その他費用	14	212
営業費用合計	266	12,998
営業損失 ()	27,212	18,343
経常損失 ()	27,212	18,343
当期純損失 ()	27,212	18,343
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-	27,212
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,041,114
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	-	6,041,114
分配金	1	74,331
期末剰余金又は期末欠損金 ()	27,212	6,161,000

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 2019年11月15日 至 2020年5月14日	
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	2019年11月14日現在	2020年5月14日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	17,915,539円
期中一部解約元本額	- 円	- 円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,000,000口	18,915,539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27,212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6,161,000円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 2019年10月31日 至 2019年11月14日	自 2019年11月15日 至 2020年5月14日
1 分配金の計算過程	(自2019年10月31日 至 2019年11月14日) 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(2,773円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は2,773円(1万口当たり27.73円)であり、分配を行っておりません。	(自2019年11月15日 至 2019年12月16日) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,903円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(2,773円)より分配対象額は4,676円(1万口当たり46.76円)であり、分配を行っておりません。

（自2019年12月17日 至
2020年1月14日）

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（3,979円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（4,676円）より分配対象額は8,655円（1万口当たり86.55円）であり、分配を行っておりません。

（自2020年1月15日 至
2020年2月14日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,957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（29,034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（8,655円）より分配対象額は39,646円（1万口当たり396.46円）であり、分配を行っておりません。

（自2020年2月15日 至
2020年3月16日）

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（2,303円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（39,646円）より分配対象額は41,949円（1万口当たり419.49円）であり、分配を行っておりません。

（自2020年3月17日 至
2020年4月14日）
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（15,434
円）、解約に伴う当期純
利益金額分配後の有価証
券売買等損益から費用を
控除し、繰越欠損金を補
填した額（1,253,308
円）、投資信託約款に規
定される収益調整金
（735,334円）及び分配準
備積立金（41,949円）よ
り分配対象額は2,046,025
円（1万口当たり1,121.09
円）であり、うち36,500
円（1万口当たり20円）を
分配金額としておりま
す。

（自2020年4月15日 至
2020年5月14日）
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（19,001
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（809,054円）及び
分配準備積立金
（1,274,191円）より分配
対象額は2,102,246円（1
万口当たり1,111.39円）
であり、うち37,831円（1
万口当たり20円）を分配
金額としております。

（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	当 期 自 2019年11月15日 至 2020年5月14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	当 期 2020年5月14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	前 期 2019年11月14日現在	当 期 2020年5月14日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,942	1,348,230
合計	26,942	1,348,230

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 2019年11月14日現在	当 期 2020年5月14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)

当 期 自 2019年11月15日 至 2020年5月14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）

	前 期 2019年11月14日現在	当 期 2020年5月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9728円 (9,728円)	0.6743円 (6,743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	7,276,035	12,791,269	
親投資信託受益証券 合計			12,791,269	
合計			12,791,269	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「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、当ファンドの特定期間末日（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。

[次へ](#)

「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11月14日現在	2020年5月14日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	69,778,900	41,465,281
コール・ローン	600,632,760	393,403,023
投資信託受益証券	472,553,669	180,252,349
投資証券	24,805,774,797	19,861,352,497
派生商品評価勘定	10,930,533	18,503,490
未収入金	4,190,652	1,374,542
未収配当金	43,063,724	39,585,885
差入委託証拠金	106,069,713	207,995,884
流動資産合計	26,112,994,748	20,743,932,951
資産合計	26,112,994,748	20,743,932,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,551,941	3,751,438
未払金	79,250,715	48,239,100
未払解約金	3,628,600	279,610
その他未払費用	366	525
流動負債合計	103,431,622	52,270,673
負債合計	103,431,622	52,270,673
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,349,955,417	11,769,785,948
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,659,607,709	8,921,876,330
元本等合計	26,009,563,126	20,691,662,278
純資産合計	26,009,563,126	20,691,662,278
負債純資産合計	26,112,994,748	20,743,932,951

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11月15日 至 2020年5月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年11月14日現在	2020年5月14日現在
1. 1 期首	2019年10月31日	2019年11月15日
期首元本額	10,250,825,390円	10,349,955,417円
期中追加設定元本額	143,870,159円	3,278,074,604円
期中一部解約元本額	44,740,132円	1,858,244,073円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	4,758,621,896円	5,779,957,519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)	711,893,196円	998,415,500円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	327,918,705円	364,614,132円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	229,570,088円	265,710,815円
D-I's グローバルREITインデックス	1,221,504円	2,283,338円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	233,283円	1,409,738円
iFree 外国REITインデックス	100,110,628円	118,132,050円
iFree 8資産バランス	834,046,158円	1,212,722,603円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	387,077円	3,270,216円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	387,077円	7,276,035円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,190,868,951円	2,431,117,434円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	2,660,920円	3,449,862円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,325,967円	6,789,786円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	1,953,546円	3,229,266円

	ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	242,076,128円	247,673,255円
	ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	34,468,179円	45,401,929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)	693,981,364円	65,557,601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)	213,230,750円	212,774,869円
	計	10,349,955,417円	11,769,785,948円
2.	期末日における受益権の総数	10,349,955,417口	11,769,785,948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 2019年11月15日 至 2020年5月14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	2020年5月14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ぬ。

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せん。</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	2019年11月14日現在	2020年5月14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	9,640,566	8,263,131
投資証券	1,988,530,791	8,404,170,471
合計	1,978,890,225	8,412,433,602

（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12月1日から2019年11月14日まで、及び2019年12月3日から2020年5月14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	2019年11月14日 現在				2020年5月14日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
不動産投信 指数先物 取引								
買 建	763,472,151	-	751,209,910	12,262,241	658,402,146	-	674,982,766	16,580,620
合計	763,472,151	-	751,209,910	12,262,241	658,402,146	-	674,982,766	16,580,620

（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11月14日 現在				2020年5月14日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
買建	632,407,167	-	635,048,000	2,640,833	416,970,768	-	415,142,200	1,828,568
アメリカ・ドル	482,296,122	-	485,800,400	3,504,278	310,098,184	-	309,873,400	224,784
イギリス・ポンド	6,990,040	-	6,986,000	4,040	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	8,914,309	-	8,881,200	33,109	-	-	-	-
カナダ・ドル	3,286,880	-	3,280,000	6,880	-	-	-	-
シンガポール・ドル	12,808,648	-	12,755,200	53,448	-	-	-	-
ユーロ	118,111,168	-	117,345,200	765,968	106,872,584	-	105,268,800	1,603,784
合計	632,407,167	-	635,048,000	2,640,833	416,970,768	-	415,142,200	1,828,568

(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11月14日現在	2020年5月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5130円 (25,130円)	1.7580円 (17,580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	24,500.000	1,686,335.000	
		小計		1,686,335.000 (180,252,349)	
投資信託受益証券 合計				180,252,349 [180,252,349]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,300	244,327.000	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	32,332.000	
URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	176,515.460	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,400	144,450.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,600	4,169,256.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	60,347	3,087,955.990	
BOSTON PROPERTIES INC	28,300	2,116,840.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	29,267	1,003,272.760	
VORNADO REALTY TRUST	31,164	1,006,597.200	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14,600	344,122.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,700	297,063.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,800	134,496.000	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11,400	722,760.000	
EQUITY RESIDENTIAL	68,900	4,038,918.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,800	328,062.000	
EPR PROPERTIES	16,100	383,985.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	19,845.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	79,422.000	
GLOBAL NET LEASE INC	17,433	219,655.800	
EQUINIX INC	17,400	11,811,120.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,829	238,135.380	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	37,592.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,100	47,357.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,300	264,081.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,700	183,416.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,200	138,096.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	9,171.990	
HOST HOTELS & RESORTS INC	141,100	1,333,395.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	50,108	1,160,000.200	
CORESITE REALTY CORP	8,100	981,153.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	30,500	622,505.000	
RLJ LODGING TRUST	35,871	271,902.180	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	18,009.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	38,800	582,776.000	
CYRUSONE INC	22,300	1,577,056.000	
KIMCO REALTY CORP	83,000	727,080.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,000	62,300.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	40,750	957,217.500	
WHITESTONE REIT	8,500	43,435.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,100	1,038,590.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	25,400	349,504.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	47,480	329,036.400	
COLONY CAPITAL INC	93,511	144,006.940	
INVITATION HOMES INC	105,897	2,538,351.090	
JBG SMITH PROPERTIES	23,232	662,808.960	
CLIPPER REALTY INC	1,400	7,882.000	

GLADSTONE LAND CORP	2,500	32,925.000
AMERICOLD REALTY TRUST	37,700	1,243,723.000
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12,300	197,046.000
VICI PROPERTIES INC	90,700	1,348,709.000
RETAIL VALUE INC	2,815	30,965.000
BROOKFIELD PROPERTY REIT I- A	12,500	106,125.000
BRT APARTMENTS CORP	1,300	11,219.000
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	68,983.000
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,400	240,652.000
SAFEHOLD INC	2,600	122,044.000
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	18,898.760
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22,400	141,344.000
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,500	199,150.000
CORECIVIC INC	25,224	260,563.920
COREPOINT LODGING INC	6,700	21,306.000
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	41,140.000
STORE CAPITAL CORP	43,500	784,305.000
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22,400	106,176.000
LIFE STORAGE INC	9,200	793,592.000
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,100	241,491.000
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	180,738.000
PREFERRED APARTMENT COMMUN- A	9,200	56,212.000
PARAMOUNT GROUP INC	40,700	298,331.000
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,200	199,144.000
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	23,300	879,808.000
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,700	267,099.000
STAG INDUSTRIAL INC	29,200	678,316.000
VENTAS INC	73,279	1,963,144.410
CARETRUST REIT INC	19,603	321,195.150
GEO GROUP INC/THE	24,100	255,460.000
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	60,800	561,792.000
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10,600	232,246.000
SABRA HEALTH CARE REIT INC	42,487	484,351.800
UMH PROPERTIES INC	5,600	63,392.000
IRON MOUNTAIN INC	56,500	1,289,330.000
TERRENO REALTY CORP	13,200	618,948.000
VEREIT INC	210,008	976,537.200
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,620	503,645.400
SUN COMMUNITIES INC	18,200	2,250,794.000
ACADIA REALTY TRUST	17,011	174,192.640
ALEXANDER'S INC	400	92,996.000
PROLOGIS INC	147,019	12,179,053.960
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,200	3,471,732.000
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,700	291,827.000
SAUL CENTERS INC	2,400	62,304.000

CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	5,119.020	
MACK-CALI REALTY CORP	17,700	239,835.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	19,000	1,593,910.000	
COUSINS PROPERTIES INC	28,906	703,282.980	
SITE CENTERS CORP	31,878	143,769.780	
DUKE REALTY CORP	72,300	2,198,643.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,600	749,740.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,967	2,992,524.260	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,000	833,750.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,800	941,298.000	
GETTY REALTY CORP	7,703	178,555.540	
WELLTOWER INC	80,000	3,036,800.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	97,400	2,098,970.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,400	652,800.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	31,700	150,575.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	26,300	748,235.000	
EQUITY COMMONWEALTH	23,975	760,726.750	
KILROY REALTY CORP	19,200	1,038,720.000	
LTC PROPERTIES INC	8,400	277,788.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	48,800	424,072.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,428	2,424,242.520	
MACERICH CO/THE	20,900	127,699.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35,800	2,016,256.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,800	420,112.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	33,800	932,880.000	
REALTY INCOME CORP	67,517	3,390,703.740	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	22,000	491,260.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	8,463.260	
PUBLIC STORAGE	29,800	5,262,680.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,900	434,265.000	
REGENCY CENTERS CORP	33,020	1,191,031.400	
RPT REALTY	17,800	93,094.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	98,208.000	
SL GREEN REALTY CORP	16,000	611,200.000	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49,000	129,360.000	
TAUBMAN CENTERS INC	12,000	455,400.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	65,880.000	
UDR INC	57,600	2,026,368.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600	215,800.000	
WP CAREY INC	33,900	1,880,094.000	
WASHINGTON REIT	15,900	302,736.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23,800	350,574.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	7,050.070	
AGREE REALTY CORP	9,900	578,952.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	42,948	1,074,129.480	
CUBESMART	38,100	915,924.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	320,503.040	
DIGITAL REALTY TRUST INC	52,178	6,961,588.760	

	CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	7,993.080	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	25,500	2,151,945.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	30,791.250	
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	124,671.200	
	KITE REALTY GROUP TRUST	15,650	127,391.000	
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21,000	243,810.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	30,448.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	27,000	723,600.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	89,586.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	181,647.180	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	101,800	1,668,502.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	94,710.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	32,400	861,192.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	40,200	168,840.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	279,462	201,212.640	
	ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	33,364.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	12,330.000	
	PRIME US REIT	62,000	45,260.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 138,401,662.040 (14,793,753,655)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	467,550	359,078.400	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	10,000	10,000.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129,570	78,778.560	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	97,740.500	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	67,821.600	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	59,031.060	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	35,427.630	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	166,290	237,794.700	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135,490	137,928.820	
	LXI REIT PLC	94,038	90,934.740	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75,200	72,192.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	16,339.180	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	150,000	82,200.000	
	RDI REIT PLC	41,036	19,081.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	145,791	793,686.200	
	SEGRO PLC	213,460	1,729,879.840	
	HAMMERSON PLC	159,920	70,860.550	
	UNITE GROUP PLC/THE	70,760	527,869.600	
	BRITISH LAND CO PLC	183,270	614,321.040	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	49,381	306,952.290	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	6,712.470	
	DERWENT LONDON PLC	20,490	588,472.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	236,370	366,846.240	

	WORKSPACE GROUP PLC	26,460	174,503.700
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	40,730	267,799.750
	SHAFTESBURY PLC	43,050	222,138.000
	BIG YELLOW GROUP PLC	30,170	293,101.550
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	171,340	331,371.560
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	39,337.600
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	332,260	423,631.500
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 8,121,833.620 (1,062,173,401)
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	28,840	イスラエル・シュケル 433,465.200
イスラエル・シュケル	小計		イスラエル・シュケル 433,465.200 (13,112,322)
オーストラリア・ドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47,520	オーストラリア・ドル 102,168.000
	CROMWELL PROPERTY GROUP	396,284	295,231.580
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	149,723.470
	VIVA ENERGY REIT	143,830	335,123.900
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	89,168	358,455.360
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	154,609.000
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	198,860	429,537.600
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57,547	166,886.300
	NATIONAL STORAGE REIT	206,195	330,942.970
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	63,091.200
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	128,242.400
	SCENTRE GROUP	1,086,440	2,303,252.800
	ARENA REIT	59,890	122,774.500
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	96,899.000
	BWP TRUST	105,550	368,369.500
	DEXUS	221,110	1,976,723.400
	GPT GROUP	393,130	1,580,382.600
	CHARTER HALL RETAIL REIT	95,400	289,062.000
	MIRVAC GROUP	807,570	1,695,897.000
	STOCKLAND	496,760	1,336,284.400
	ABACUS PROPERTY GROUP	81,120	197,121.600
	GOODMAN GROUP	331,030	4,713,867.200
	VICINITY CENTRES	655,710	924,551.100
	CHARTER HALL GROUP	94,460	689,558.000
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,220	161,887.600
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 18,970,642.480 (1,308,974,331)
カナダ・ドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	カナダ・ドル 93,010.000
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	24,738.000
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	165,546.000
	SLATE OFFICE REIT	5,100	16,677.000

	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	81,186.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,200	134,824.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,700	139,356.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	58,016.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,600	353,304.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,900	133,802.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,500	184,680.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	22,200	262,182.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	31,000	370,450.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	54,096.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	144,228.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,300	264,550.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,900	782,132.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	121,727.500	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	28,566	237,954.780	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,700	435,558.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	99,090.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	113,035.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	7,400	255,670.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	111,530.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,300	494,829.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 5,132,171.280 (389,223,870)	
シンガポール・ ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	249,483	566,326.410	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	103,484.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455,000	373,100.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	105,020.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	56,637.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	515,890	557,161.200	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	61,920.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	582,475	897,011.500	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	611,516	1,816,202.520	
	CAPITALAND MALL TRUST	579,500	1,043,100.000	
	SUNTEC REIT	474,300	654,534.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	612,000	1,119,960.000	
	KEPPEL REIT	388,400	396,168.000	

	ASCOTT RESIDENCE TRUST	377,456	320,837.600
	ESR-REIT	459,902	165,564.720
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,600	148,672.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	148,168	299,299.360
	STARHILL GLOBAL REIT	308,800	143,592.000
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	149,396	198,696.680
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,300	275,297.000
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	61,670.400
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	309,780	762,058.800
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244,500	125,917.500
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	438,484	811,195.400
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	85,587.000
	SPH REIT	166,600	131,614.000
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	76,798.000
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	71,305.000
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	205,603.940
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,634,334.030 (876,298,040)
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	164,860.800
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	320,920	288,828.000
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76,800	184,320.000
	GOODMAN PROPERTY TRUST	226,220	512,388.300
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	219,820	346,216.500
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 1,496,613.600 (95,873,068)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,210	347,471.700
	HAMBORNER REIT AG	11,980	95,241.000
	WERELDHAVE NV	6,470	42,475.550
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,730	1,030,356.600
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,230	76,785.900
	NSI NV	3,231	104,199.750
	VASTNED RETAIL NV	3,750	61,350.000
	ICADE	4,850	297,305.000
	ALTAREA	740	82,140.000
	GECINA SA	9,471	980,248.500
	KLEPIERRE	36,060	547,030.200
	COVIVIO	7,662	383,483.100
	MERCIALYS	4,030	24,784.500
	AEDIFICA	4,744	437,871.200
	COFINIMMO	4,240	538,480.000
	BEFIMMO	4,420	169,065.000
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,610	97,732.000
	RETAIL ESTATES	1,940	99,716.000
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,340	517,171.000

	MONTEA	2,150	180,600.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	20,342.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	38,381.850	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,053	325,910.750	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	63,200	442,716.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	95,998.500	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	120,889.600	
ユーロ	小計		ユーロ 7,157,746.100 (828,008,069)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 37,500,000.000	
韓国・ウォン	小計		韓国・ウォン 37,500,000.000 (3,273,750)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287,000	香港・ドル 1,064,770.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	746,910.000	
	FORTUNE REIT	311,000	2,329,390.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	720,000.000	
	LINK REIT	427,900	28,797,670.000	
	CHAMPION REIT	431,000	1,922,260.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 35,581,000.000 (490,661,991)	
投資証券	合計		19,861,352,497 [19,861,352,497]	
合計			20,041,604,846 [20,041,604,846]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額 に 対する比 率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 1銘柄 157銘柄	1.2%	98.8%	74.8%
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-%	100%	5.3%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	6.5%
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 29銘柄	-%	100%	4.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	4.1%

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%	2.4%

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。

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）

(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) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 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1期計算期間（2019年10月31日から2020年5月14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

【グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）】

(1) 【貸借対照表】

	第1期 2020年5月14日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		6,315
親投資信託受益証券		5,749,039
未収入金		110
流動資産合計		5,755,464
資産合計		5,755,464
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		168
未払委託者報酬		5,546
その他未払費用		196
流動負債合計		5,910
負債合計		5,910
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,478,101
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	2,728,547
元本等合計		5,749,554
純資産合計		5,749,554
負債純資産合計		5,755,464

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期	
	自 2019年10月31日 至 2020年5月14日	
	金額(円)	
営業収益		
有価証券売買等損益		866,771
営業収益合計		866,771
営業費用		
受託者報酬		168
委託者報酬		5,546
その他費用		196
営業費用合計		5,910
営業損失()		872,681
経常損失()		872,681
当期純損失()		872,681
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,855,866
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		1,855,866
分配金	1	-
期末剰余金又は期末欠損金()		2,728,547

(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1期 自 2019年10月31日 至 2020年5月14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 当ファンドの第1期計算期間は、2019年10月31日から2020年5月14日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 2020年5月14日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	7,478,101円
期中一部解約元本額	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	8,478,101口
3. 2元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,728,547円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年10月31日 至 2020年5月14日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は0円(1万口当たり0.00円)であり、分配を行っておりません。

(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1期 自 2019年10月31日 至 2020年5月14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1期 2020年5月14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1期 2020年5月14日現在 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	866,436
合計	866,436

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 2020年5月14日現在
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1期 自 2019年10月31日 至 2020年5月14日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期 2020年5月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6782円 (6,782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	3,270,216	5,749,039	
親投資信託受益証券 合計			5,749,039	
合計			5,749,039	

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。

[次へ](#)

「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

	2020年5月14日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		41,465,281
コール・ローン		393,403,023
投資信託受益証券		180,252,349
投資証券		19,861,352,497
派生商品評価勘定		18,503,490
未収入金		1,374,542
未収配当金		39,585,885
差入委託証拠金		207,995,884
流動資産合計		20,743,932,951
資産合計		20,743,932,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,751,438
未払金		48,239,100
未払解約金		279,610
その他未払費用		525
流動負債合計		52,270,673
負債合計		52,270,673
純資産の部		
元本等		
元本	1	11,769,785,948
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,921,876,330
元本等合計		20,691,662,278
純資産合計		20,691,662,278
負債純資産合計		20,743,932,951

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10月31日 至 2020年5月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年5月14日現在
1. 1 期首	2019年10月31日
期首元本額	10,250,825,390円
期中追加設定元本額	3,421,944,763円
期中一部解約元本額	1,902,984,205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)	5,779,957,519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)	998,415,500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)	364,614,132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)	265,710,815円
D-I's グローバルREITインデックス	2,283,338円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	1,409,738円
iFree 外国REITインデックス	118,132,050円
iFree 8資産バランス	1,212,722,603円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	3,270,216円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	7,276,035円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,431,117,434円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,449,862円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,789,786円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,229,266円

ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	247,673,255円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	45,401,929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)	65,557,601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)	212,774,869円
計	11,769,785,948円
2. 期末日における受益権の総数	11,769,785,948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 2019年10月31日 至 2020年5月14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	2020年5月14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いません。</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	2020年5月14日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		8,263,131
投資証券		8,404,170,471
合計		8,412,433,602

（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（2019年12月3日から2020年5月14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	2020年5月14日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				
不動産投信 指数先物 取引				
買 建	658,402,146	-	674,982,766	16,580,620
合計	658,402,146	-	674,982,766	16,580,620

（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	2020年5月14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	416,970,768	-	415,142,200	1,828,568
アメリカ・ドル	310,098,184	-	309,873,400	224,784
ユーロ	106,872,584	-	105,268,800	1,603,784
合計	416,970,768	-	415,142,200	1,828,568

(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)

	2020年5月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7580円 (17,580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	24,500.000	1,686,335.000	
		小計		1,686,335.000 (180,252,349)	
投資信託受益証券 合計				180,252,349 [180,252,349]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,300	244,327.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	32,332.000	

URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	176,515.460
XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,400	144,450.000
AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,600	4,169,256.000
SIMON PROPERTY GROUP INC	60,347	3,087,955.990
BOSTON PROPERTIES INC	28,300	2,116,840.000
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	29,267	1,003,272.760
VORNADO REALTY TRUST	31,164	1,006,597.200
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14,600	344,122.000
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,700	297,063.000
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,800	134,496.000
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11,400	722,760.000
EQUITY RESIDENTIAL	68,900	4,038,918.000
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,800	328,062.000
EPR PROPERTIES	16,100	383,985.000
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	19,845.000
CITY OFFICE REIT INC	9,300	79,422.000
GLOBAL NET LEASE INC	17,433	219,655.800
EQUINIX INC	17,400	11,811,120.000
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,829	238,135.380
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	37,592.000
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,100	47,357.000
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,300	264,081.000
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,700	183,416.000
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,200	138,096.000
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,113	9,171.990
HOST HOTELS & RESORTS INC	141,100	1,333,395.000
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	50,108	1,160,000.200
CORESITE REALTY CORP	8,100	981,153.000
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	30,500	622,505.000
RLJ LODGING TRUST	35,871	271,902.180
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	18,009.000
PHYSICIANS REALTY TRUST	38,800	582,776.000
CYRUSONE INC	22,300	1,577,056.000
KIMCO REALTY CORP	83,000	727,080.000
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,000	62,300.000
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	40,750	957,217.500
WHITESTONE REIT	8,500	43,435.000
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,100	1,038,590.000
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	25,400	349,504.000
PARK HOTELS & RESORTS INC	47,480	329,036.400
COLONY CAPITAL INC	93,511	144,006.940
INVITATION HOMES INC	105,897	2,538,351.090
JBG SMITH PROPERTIES	23,232	662,808.960
CLIPPER REALTY INC	1,400	7,882.000
GLADSTONE LAND CORP	2,500	32,925.000
AMERICOLD REALTY TRUST	37,700	1,243,723.000

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12,300	197,046.000	
VICI PROPERTIES INC	90,700	1,348,709.000	
RETAIL VALUE INC	2,815	30,965.000	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I- A	12,500	106,125.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,300	11,219.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	68,983.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,400	240,652.000	
SAFEHOLD INC	2,600	122,044.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	18,898.760	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22,400	141,344.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,500	199,150.000	
CORECIVIC INC	25,224	260,563.920	
COREPOINT LODGING INC	6,700	21,306.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	41,140.000	
STORE CAPITAL CORP	43,500	784,305.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22,400	106,176.000	
LIFE STORAGE INC	9,200	793,592.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,100	241,491.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	180,738.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUN- A	9,200	56,212.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,700	298,331.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,200	199,144.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	23,300	879,808.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,700	267,099.000	
STAG INDUSTRIAL INC	29,200	678,316.000	
VENTAS INC	73,279	1,963,144.410	
CARETRUST REIT INC	19,603	321,195.150	
GEO GROUP INC/THE	24,100	255,460.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	60,800	561,792.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10,600	232,246.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	42,487	484,351.800	
UMH PROPERTIES INC	5,600	63,392.000	
IRON MOUNTAIN INC	56,500	1,289,330.000	
TERRENO REALTY CORP	13,200	618,948.000	
VEREIT INC	210,008	976,537.200	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,620	503,645.400	
SUN COMMUNITIES INC	18,200	2,250,794.000	
ACADIA REALTY TRUST	17,011	174,192.640	
ALEXANDER'S INC	400	92,996.000	
PROLOGIS INC	147,019	12,179,053.960	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,200	3,471,732.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,700	291,827.000	
SAUL CENTERS INC	2,400	62,304.000	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	5,119.020	
MACK-CALI REALTY CORP	17,700	239,835.000	

CAMDEN PROPERTY TRUST	19,000	1,593,910.000
COUSINS PROPERTIES INC	28,906	703,282.980
SITE CENTERS CORP	31,878	143,769.780
DUKE REALTY CORP	72,300	2,198,643.000
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,600	749,740.000
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,967	2,992,524.260
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,000	833,750.000
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,800	941,298.000
GETTY REALTY CORP	7,703	178,555.540
WELLTOWER INC	80,000	3,036,800.000
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	97,400	2,098,970.000
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,400	652,800.000
SERVICE PROPERTIES TRUST	31,700	150,575.000
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	26,300	748,235.000
EQUITY COMMONWEALTH	23,975	760,726.750
KILROY REALTY CORP	19,200	1,038,720.000
LTC PROPERTIES INC	8,400	277,788.000
LEXINGTON REALTY TRUST	48,800	424,072.000
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,428	2,424,242.520
MACERICH CO/THE	20,900	127,699.000
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35,800	2,016,256.000
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,800	420,112.000
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	33,800	932,880.000
REALTY INCOME CORP	67,517	3,390,703.740
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	22,000	491,260.000
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,600	8,463.260
PUBLIC STORAGE	29,800	5,262,680.000
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,900	434,265.000
REGENCY CENTERS CORP	33,020	1,191,031.400
RPT REALTY	17,800	93,094.000
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	98,208.000
SL GREEN REALTY CORP	16,000	611,200.000
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49,000	129,360.000
TAUBMAN CENTERS INC	12,000	455,400.000
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	65,880.000
UDR INC	57,600	2,026,368.000
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600	215,800.000
WP CAREY INC	33,900	1,880,094.000
WASHINGTON REIT	15,900	302,736.000
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23,800	350,574.000
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,300	7,050.070
AGREE REALTY CORP	9,900	578,952.000
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	42,948	1,074,129.480
CUBESMART	38,100	915,924.000
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	320,503.040
DIGITAL REALTY TRUST INC	52,178	6,961,588.760
CEDAR REALTY TRUST INC	10,800	7,993.080
EXTRA SPACE STORAGE INC	25,500	2,151,945.000
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	30,791.250

	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,060	124,671.200	
	KITE REALTY GROUP TRUST	15,650	127,391.000	
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21,000	243,810.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	30,448.000	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	27,000	723,600.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	89,586.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	181,647.180	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	101,800	1,668,502.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	94,710.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	32,400	861,192.000	
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	40,200	168,840.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	279,462	201,212.640	
	ARA US HOSPITALITY TRUST	87,800	33,364.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	12,330.000	
	PRIME US REIT	62,000	45,260.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 138,401,662.040 (14,793,753,655)	
イギリス・ポ ンド			イギリス・ポ ンド	
	ASSURA PLC	467,550	359,078.400	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	10,000	10,000.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129,570	78,778.560	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	97,740.500	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	67,821.600	
	REGIONAL REIT LTD	81,310	59,031.060	
	NEWRIVER REIT PLC	69,330	35,427.630	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	166,290	237,794.700	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135,490	137,928.820	
	LXI REIT PLC	94,038	90,934.740	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75,200	72,192.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	16,339.180	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	150,000	82,200.000	
	RDI REIT PLC	41,036	19,081.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	145,791	793,686.200	
	SEGREO PLC	213,460	1,729,879.840	
	HAMMERSON PLC	159,920	70,860.550	
	UNITE GROUP PLC/THE	70,760	527,869.600	
	BRITISH LAND CO PLC	183,270	614,321.040	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	49,381	306,952.290	
	INTU PROPERTIES PLC	145,670	6,712.470	
	DERWENT LONDON PLC	20,490	588,472.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	236,370	366,846.240	
	WORKSPACE GROUP PLC	26,460	174,503.700	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	40,730	267,799.750	
	SHAFTESBURY PLC	43,050	222,138.000	

	BIG YELLOW GROUP PLC	30,170	293,101.550	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	171,340	331,371.560	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	39,337.600	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	332,260	423,631.500	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 8,121,833.620 (1,062,173,401)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	28,840	433,465.200	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 433,465.200 (13,112,322)	
オーストラリア・ドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47,520	102,168.000	オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	396,284	295,231.580	
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	149,723.470	
	VIVA ENERGY REIT	143,830	335,123.900	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	89,168	358,455.360	
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	154,609.000	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	198,860	429,537.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57,547	166,886.300	
	NATIONAL STORAGE REIT	206,195	330,942.970	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	63,091.200	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	128,242.400	
	SCENTRE GROUP	1,086,440	2,303,252.800	
	ARENA REIT	59,890	122,774.500	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	96,899.000	
	BWP TRUST	105,550	368,369.500	
	DEXUS	221,110	1,976,723.400	
	GPT GROUP	393,130	1,580,382.600	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	95,400	289,062.000	
	MIRVAC GROUP	807,570	1,695,897.000	
	STOCKLAND	496,760	1,336,284.400	
	ABACUS PROPERTY GROUP	81,120	197,121.600	
	GOODMAN GROUP	331,030	4,713,867.200	
	VICINITY CENTRES	655,710	924,551.100	
	CHARTER HALL GROUP	94,460	689,558.000	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,220	161,887.600	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 18,970,642.480 (1,308,974,331)	
カナダ・ドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	93,010.000	カナダ・ドル
	SLATE RETAIL REIT - U	3,100	24,738.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	165,546.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	16,677.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	81,186.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,200	134,824.000	

	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14,700	139,356.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	58,016.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,600	353,304.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,900	133,802.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,500	184,680.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	22,200	262,182.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	31,000	370,450.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	54,096.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	144,228.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,300	264,550.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,900	782,132.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,790	121,727.500	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	28,566	237,954.780	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,700	435,558.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	99,090.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	113,035.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	7,400	255,670.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	111,530.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,300	494,829.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 5,132,171.280 (389,223,870)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	249,483	566,326.410	
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126,200	103,484.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455,000	373,100.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	105,020.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	56,637.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	515,890	557,161.200	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	61,920.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	582,475	897,011.500	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	611,516	1,816,202.520	
	CAPITALAND MALL TRUST	579,500	1,043,100.000	
	SUNTEC REIT	474,300	654,534.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	612,000	1,119,960.000	
	KEPPEL REIT	388,400	396,168.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	377,456	320,837.600	
	ESR-REIT	459,902	165,564.720	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,600	148,672.000	

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	148,168	299,299.360	
	STARHILL GLOBAL REIT	308,800	143,592.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	149,396	198,696.680	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,300	275,297.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	61,670.400	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	309,780	762,058.800	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244,500	125,917.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	438,484	811,195.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	85,587.000	
	SPH REIT	166,600	131,614.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	76,798.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	71,305.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	205,603.940	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,634,334.030 (876,298,040)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	164,860.800	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	320,920	288,828.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76,800	184,320.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	226,220	512,388.300	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	219,820	346,216.500	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 1,496,613.600 (95,873,068)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,210	347,471.700	ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	11,980	95,241.000	
	WERELDHAVE NV	6,470	42,475.550	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,730	1,030,356.600	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	8,230	76,785.900	
	NSI NV	3,231	104,199.750	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	61,350.000	
	ICADE	4,850	297,305.000	
	ALTAREA	740	82,140.000	
	GECINA SA	9,471	980,248.500	
	KLEPIERRE	36,060	547,030.200	
	COVIVIO	7,662	383,483.100	
	MERCIALYS	4,030	24,784.500	
	AEDIFICA	4,744	437,871.200	
	COFINIMMO	4,240	538,480.000	
	BEFIMMO	4,420	169,065.000	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,610	97,732.000	
	RETAIL ESTATES	1,940	99,716.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,340	517,171.000	
	MONTEA	2,150	180,600.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	20,342.400	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	38,381.850	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,053	325,910.750	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	63,200	442,716.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	95,998.500	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	120,889.600	
ユーロ	小計		ユーロ 7,157,746.100 (828,008,069)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	韓国・ウォン 37,500,000.000	
韓国・ウォン	小計		韓国・ウォン 37,500,000.000 (3,273,750)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287,000	香港・ドル 1,064,770.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	746,910.000	
	FORTUNE REIT	311,000	2,329,390.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	720,000.000	
	LINK REIT	427,900	28,797,670.000	
	CHAMPION REIT	431,000	1,922,260.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 35,581,000.000 (490,661,991)	
投資証券	合計		19,861,352,497 [19,861,352,497]	
合計			20,041,604,846 [20,041,604,846]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額 に 対する比 率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 1銘柄 157銘柄	1.2%	98.8%	74.8%
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-%	100%	5.3%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	6.5%
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 29銘柄	-%	100%	4.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	4.1%
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%	2.4%

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。

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）

【純資産額計算書】

2020年5月29日

資産総額	16,046,566円
負債総額	4,072円
純資産総額（ - ）	16,042,494円
発行済数量	21,043,152口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7624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

2020年5月29日

資産総額	23,757,193,425円
負債総額	59,506,762円
純資産総額（ - ）	23,697,686,663円
発行済数量	11,919,251,442口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.9882円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）

純資産額計算書

2020年5月29日

資産総額	9,713,761円
負債総額	2,147円
純資産総額（ - ）	9,711,614円
発行済数量	12,665,847口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.7668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「グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）」の記載と同じ。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「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 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2020年5月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．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。

2020年5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	53	90,131
追加型株式投資信託	694	16,346,516
株式投資信託 合計	747	16,436,647
単位型公社債投資信託	27	93,365
追加型公社債投資信託	14	1,424,426
公社債投資信託 合計	41	1,517,790
総合計	788	17,954,437

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,489	2,741
有価証券	554	22,167
前払費用	214	205
未収委託者報酬	11,468	10,847
未収収益	98	63
その他	56	62
流動資産計	40,882	36,088
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	10	7
器具備品	195	209
無形固定資産	2,821	2,362
ソフトウェア	2,804	2,028
ソフトウェア仮勘定	17	333
投資その他の資産	12,799	15,844
投資有価証券	8,493	9,153
関係会社株式	1,836	3,972
出資金	183	183
長期差入保証金	1,070	1,069
繰延税金資産	1,183	1,431
その他	31	33
固定資産計	15,827	18,424

資産合計	56,709	54,512
------	--------	--------

(単位:百万円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	75	69
未払金	8,548	7,573
未払収益分配金	15	14
未払償還金	40	39
未払手数料	4,610	3,988
その他未払金	2	2
未払費用	3,735	3,830
未払法人税等	726	656
未払消費税等	255	590
賞与引当金	725	688
その他	2	5
流動負債計	14,070	13,414
固定負債		
退職給付引当金	2,389	2,574
役員退職慰労引当金	103	88
その他	2	5
固定負債計	2,496	2,667
負債合計	16,567	16,082
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	13,052	11,749
利益剰余金合計	13,426	12,123
株主資本合計	40,096	38,793

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	46	363
評価・換算差額等合計	46	363
純資産合計	40,142	38,430
負債・純資産合計	56,709	54,512

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,052	69,550
その他営業収益	673	583
営業収益計	76,725	70,134
営業費用		
支払手数料	35,789	31,120
広告宣伝費	694	745
調査費	9,066	8,858
調査費	1,057	1,188
委託調査費	8,009	7,670
委託計算費	1,351	1,410
営業雑経費	1,557	1,770
通信費	228	240
印刷費	513	524
協会費	55	56
諸会費	13	13
その他営業雑経費	746	936
営業費用計	48,459	43,906
一般管理費		
給料	5,755	5,793
役員報酬	373	374
給料・手当	4,145	4,335
賞与	510	395
賞与引当金繰入額	725	688
福利厚生費	796	838
交際費	64	62
旅費交通費	178	154
租税公課	472	451
不動産賃借料	1,291	1,299

退職給付費用	374	368
役員退職慰労引当金繰入額	34	37
固定資産減価償却費	907	925
諸経費	1,819	1,770
一般管理費計	11,693	11,702
営業利益	16,572	14,525

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31 日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	38	912
投資有価証券売却益	215	214
有価証券償還益	133	24
その他	134	78
営業外収益計	521	1,230
営業外費用		
有価証券償還損	32	71
投資有価証券売却損	40	1
その他	60	54
営業外費用計	132	127
経常利益	16,961	15,629
特別損失		
システム刷新関連費用	-	537
投資有価証券評価損	-	48
関係会社整理損失	29	-
特別損失計	29	585
税引前当期純利益	16,931	15,043
法人税、住民税及び事業税	5,076	4,555
法人税等調整額	15	78
法人税等合計	5,060	4,477
当期純利益	11,870	10,566

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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
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
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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

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 8～18年

器具備品 4～17年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、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。

6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018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 2018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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)

(1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

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)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
未払金	3,788百万円	3,397百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
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

(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

2020年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月24日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

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(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。

当事業年度(2020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		2,741	2,741	-
(2) 未収委託者報酬		10,847	10,847	-
(3) 有価証券及び投資有価証券				
有価証券		21,900	21,900	-
其他有価証券		8,754	8,754	-
資産計		44,243	44,243	-
(1) 未払手数料		(3,988)	(3,988)	-
(2) その他未払金		(3,530)	(3,530)	-
(3) 未払費用(*2)		(2,889)	(2,889)	-
負債計		(10,408)	(10,408)	-

(*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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	666	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	1,836	3,972
(3) 長期差入保証金	1,070	1,069

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(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

当事業年度(2020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	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	21,900 267	- 3,463	- 1,184	- -
合計	35,756	3,463	1,184	-

(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(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、記載していません。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がなく、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、記載していません。

2. 其他有価証券

前事業年度(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	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	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。

当事業年度(2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

(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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

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、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度(退職一時金制度であります)及び確定拠出制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,350百万円	2,389百万円
勤務費用	158	159
退職給付の支払額	171	183
その他	52	207
退職給付債務の期末残高	2,389	2,574

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,389百万円	2,574百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574
退職給付引当金	2,389	2,574
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,389	2,574

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

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174百万円、当事業年度181百万円であります。

(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 (2019年 3月31日)	当事業年度 (2020年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		788
	731	
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	164	173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
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	85	71
繰延税金負債合計	244	230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

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(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。

当事業年度（2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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)	1,603	-	-

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。

(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 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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
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)	1,052	未払費用	173
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)	1,063	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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
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)	1,031	未払費用	224
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)	1,061	長期差入保証金	1,054

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,389.06円	1株当たり純資産額	14,732.52円
1株当たり当期純利益	4,550.81円	1株当たり当期純利益	4,050.66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)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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,870	10,566
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

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2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 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】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」の記載事項のうち以下に記載した箇所を、＜訂正前＞の内容から＜訂正後＞の内容に訂正致します。

下線部が訂正部分です

＜訂正前＞

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (<u>2019</u> 年3月 末日現在)	事業の内容
農林中央金庫	4,040,198	(注1)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注2)

(注1) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注2) 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。

＜略＞

3 【資本関係】

＜略＞

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

< 訂正後 >

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2020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 (<u>2020</u> 年3月末日現在)	事業の内容
農林中央金庫	4,040,198	(注1)
三井住友信託銀行株式会社	342,037	(注2)

北海道信用農業協同組合連合会	*96,273
岩手県信用農業協同組合連合会	*19,463
茨城県信用農業協同組合連合会	*25,549
埼玉県信用農業協同組合連合会	*139,440
東京都信用農業協同組合連合会	*78,204
神奈川県信用農業協同組合連合会	*194,885
長野県信用農業協同組合連合会	*54,858
新潟県信用農業協同組合連合会	*56,296
石川県信用農業協同組合連合会	*17,468
岐阜県信用農業協同組合連合会	*70,118
静岡県信用農業協同組合連合会	*111,302
愛知県信用農業協同組合連合会	*198,402
三重県信用農業協同組合連合会	*39,124
福井県信用農業協同組合連合会	*23,372
滋賀県信用農業協同組合連合会	*34,697
京都府信用農業協同組合連合会	*32,681
大阪府信用農業協同組合連合会	*140,690
兵庫県信用農業協同組合連合会	*170,546
和歌山県信用農業協同組合連合会	*51,799
広島県信用農業協同組合連合会	*80,200
山口県信用農業協同組合連合会	*35,542
徳島県信用農業協同組合連合会	*32,546
香川県信用農業協同組合連合会	*27,537
佐賀県信用農業協同組合連合会	*28,130
大分県信用農業協同組合連合会	*15,599
岩手中央農業協同組合	*4,441
岩手江刺農業協同組合	*2,370
仙台農業協同組合	*3,434
みやぎ亘理農業協同組合	*1,554
みやぎ登米農業協同組合	*6,459
新みやぎ農業協同組合	*2,941
いしのまき農業協同組合	*4,497
みやぎ仙南農業協同組合	*4,041
秋田しんせい農業協同組合	*5,632
山形農業協同組合	*4,080
さがえ西村山農業協同組合	*3,757
山形おきたま農業協同組合	*4,965
鶴岡市農業協同組合	*1,488
庄内たがわ農業協同組合	*4,381
ふくしま未来農業協同組合	*15,932
福島さくら農業協同組合	*8,676
北つくば農業協同組合	*3,382
はが野農業協同組合	*3,648
那須南農業協同組合	*1,157

前橋市農業協同組合	*4,163
高崎市農業協同組合	*2,001
佐波伊勢崎農業協同組合	*2,545
邑楽館林農業協同組合	*2,814
さいたま農業協同組合	*8,181
あさか野農業協同組合	*871
いるま野農業協同組合	*5,963
埼玉中央農業協同組合	*2,335
ちちぶ農業協同組合	*1,603
埼玉ひびきの農業協同組合	*1,849
くまがや農業協同組合	*2,768
ほくさい農業協同組合	*3,181
越谷市農業協同組合	*1,568
南彩農業協同組合	*2,847
埼玉みずほ農業協同組合	*1,437
さいかつ農業協同組合	*1,864
ふかや農業協同組合	*1,613
君津市農業協同組合	*3,639
山武郡市農業協同組合	*4,778
千葉みらい農業協同組合	*2,289
市川市農業協同組合	*3,358
町田市農業協同組合	*1,033
マインズ農業協同組合	*1,795
横浜農業協同組合	*12,402
セレサ川崎農業協同組合	*2,516
よこすか葉山農業協同組合	*1,454
さがみ農業協同組合	*5,363
湘南農業協同組合	*1,998
秦野市農業協同組合	*1,775
かながわ西湘農業協同組合	*2,531
厚木市農業協同組合	*2,589
県央愛川農業協同組合	*510
相模原市農業協同組合	*881
神奈川つくい農業協同組合	*850
長野八ヶ岳農業協同組合	*4,279
佐久浅間農業協同組合	*6,627
信州うえだ農業協同組合	*4,273
信州諏訪農業協同組合	*6,454
上伊那農業協同組合	*8,124
みなみ信州農業協同組合	*4,519
松本ハイランド農業協同組合	*6,213
塩尻市農業協同組合	*1,568
洗馬農業協同組合	*890
あづみ農業協同組合	*4,238

農業協同組合法に基づき信用
事業等を営んでいます。

大北農業協同組合	*3,263
グリーン長野農業協同組合	*3,699
中野市農業協同組合	*2,504
ながの農業協同組合	*12,921
北越後農業協同組合	*3,088
胎内市農業協同組合	*1,330
新潟みらい農業協同組合	*4,830
新津さつき農業協同組合	*1,596
越後中央農業協同組合	*5,313
にいがた南蒲農業協同組合	*4,950
越後ながおか農業協同組合	*5,506
越後おぢや農業協同組合	*2,421
北魚沼農業協同組合	*2,744
十日町農業協同組合	*2,815
柏崎農業協同組合	*3,489
えちご上越農業協同組合	*7,920
ひすい農業協同組合	*1,264
にいがた岩船農業協同組合	*2,498
佐渡農業協同組合	*2,505
新潟市農業協同組合	*3,055
黒部市農業協同組合	*1,307
加賀農業協同組合	*1,966
小松市農業協同組合	*1,744
能美農業協同組合	*1,249
金沢中央農業協同組合	*1,058
金沢市農業協同組合	*3,158
石川かほく農業協同組合	*1,887
はくい農業協同組合	*1,340
能登わかば農業協同組合	*2,667
おおぞら農業協同組合	*1,217
ぎふ農業協同組合	*7,218
西美濃農業協同組合	*4,658
いび川農業協同組合	*2,073
めぐみの農業協同組合	*4,704
陶都信用農業協同組合	*1,607
東美濃農業協同組合	*2,624
飛騨農業協同組合	*6,368
伊豆太陽農業協同組合	*1,818
三島函南農業協同組合	*1,049
伊豆の国農業協同組合	*913
あいら伊豆農業協同組合	*915
南駿農業協同組合	*3,158
御殿場農業協同組合	*1,234
富士市農業協同組合	*1,492

富士宮農業協同組合	*945
清水農業協同組合	*2,981
静岡市農業協同組合	*1,902
大井川農業協同組合	*3,433
ハイナン農業協同組合	*857
掛川市農業協同組合	*746
遠州夢咲農業協同組合	*3,579
遠州中央農業協同組合	*3,301
とびあ浜松農業協同組合	*3,715
三ヶ日町農業協同組合	*297
なごや農業協同組合	*2,454
尾張中央農業協同組合	*2,118
西春日井農業協同組合	*157
あいち尾東農業協同組合	*1,192
愛知北農業協同組合	*747
愛知西農業協同組合	*1,617
あいち海部農業協同組合	*1,070
あいち知多農業協同組合	*7,183
あいち中央農業協同組合	*3,468
西三河農業協同組合	*1,301
あいち三河農業協同組合	*1,114
あいち豊田農業協同組合	*1,809
愛知東農業協同組合	*971
蒲郡市農業協同組合	*296
ひまわり農業協同組合	*1,410
愛知みなみ農業協同組合	*1,346
豊橋農業協同組合	*2,515
三重北農業協同組合	*6,208
鈴鹿農業協同組合	*1,628
津安芸農業協同組合	*2,189
伊勢農業協同組合	*4,367
伊賀ふるさと農業協同組合	*2,846
福井県農業協同組合	*17,420
越前たけふ農業協同組合	*2,762
おうみ富士農業協同組合	*2,470
甲賀農業協同組合	*2,478
グリーン近江農業協同組合	*4,432
東びわこ農業協同組合	*3,480
北びわこ農業協同組合	*1,934
北大阪農業協同組合	*1,887
茨木市農業協同組合	*1,237
大阪泉州農業協同組合	*2,009
いずみの農業協同組合	*2,884
堺市農業協同組合	*1,187

大阪南農業協同組合	*3,822
グリーン大阪農業協同組合	*1,507
大阪中河内農業協同組合	*4,263
北河内農業協同組合	*2,635
大阪市農業協同組合	*1,919
兵庫六甲農業協同組合	*5,831
あかし農業協同組合	*423
兵庫南農業協同組合	*3,763
みのり農業協同組合	*4,439
兵庫みらい農業協同組合	*3,483
加古川市南農業協同組合	*527
兵庫西農業協同組合	*12,416
相生市農業協同組合	*101
ハリマ農業協同組合	*968
たじま農業協同組合	*4,526
丹波ひかみ農業協同組合	*2,286
丹波ささやま農業協同組合	*2,200
淡路日の出農業協同組合	*1,879
あわじ島農業協同組合	*3,970
奈良県農業協同組合	*9,389
わかやま農業協同組合	*4,466
ながみね農業協同組合	*2,006
紀の里農業協同組合	*3,586
紀北川上農業協同組合	*4,269
ありだ農業協同組合	*2,098
紀州農業協同組合	*3,667
紀南農業協同組合	*4,717
みくまの農業協同組合	*1,002
鳥取いなば農業協同組合	*6,061
鳥取中央農業協同組合	*3,875
鳥取西部農業協同組合	*5,133
島根県農業協同組合	*22,681
晴れの国岡山農業協同組合	*25,314
広島市農業協同組合	*6,724
佐伯中央農業協同組合	*1,286
広島中央農業協同組合	*3,067
福山市農業協同組合	*5,798
三次農業協同組合	*1,879
山口県農業協同組合	*2,362
徳島市農業協同組合	*3,026
香川県農業協同組合	*26,469
越智今治農業協同組合	*6,417
佐賀県農業協同組合	*22,378
唐津農業協同組合	*4,543

伊万里市農業協同組合	*2,427
宮崎中央農業協同組合	*5,828
延岡農業協同組合	*1,469

（注1）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

（注2）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。

*出資金を記載しています。（2019年3月末日現在）

< 略 >

3 【資本関係】

< 略 >

< 再信託受託会社の概要 >

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27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】

<訂正前>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

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。

<略>

<訂正後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

<略>

独立監査人の監査報告書

2020年6月19日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 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**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2019年11月15日から2020年5月14日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)の2020年5月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財

務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記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。

(注) 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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年6月19日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 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**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)の2019年10月31日から2020年5月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)の2020年5月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財

務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記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。

(注) 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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。