

## 【表紙】

|            |  |
|------------|--|
| 【提出書類】     | 有価証券報告書  |
| 【提出先】      | 関東財務局長 殿   |
| 【提出日】      | 2020年9月8日提出  |
| 【計算期間】     | 第4計算期間<br>(自 2019年6月18日 至 2020年6月15日)  |
| 【ファンド名】    | ダイワファンドラップ TOPIXインデックス<br>ダイワファンドラップ 日経225インデックス<br>ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)<br>ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)<br>ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)<br>ダイワファンドラップ 日本債券インデックス<br>ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)<br>ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)<br>ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)<br>ダイワファンドラップ J-REITインデックス<br>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)<br>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) |
| 【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   |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当ありません。   |

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

##### <FW TOPIXインデックス>

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

##### <FW 日経225インデックス>

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

##### <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

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

## &lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

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

## &lt;FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

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

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）&gt;

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

## &lt;FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）&gt;

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

## &lt;FW J - R E I Tインデックス&gt;

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

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

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

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

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

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

#### （注1）商品分類の定義

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

#### （注2）属性区分の定義

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

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

### <FW TOPIXインデックス>

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### <FW 日経225インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日本債券インデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW J - REITインデックス>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

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

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

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

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

### <ファンドの特色>

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

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

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

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

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

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

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

## ●各ファンドの運用方針

## FW TOPIXインデックス

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

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

## FW 日経225インデックス

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

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

**FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)**

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

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

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

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

**FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)**

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## FW 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

## FW 日本債券インデックス

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

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

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

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

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

## FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## FW J-REITインデックス

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

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

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

## FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

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

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

## FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

**●特定の指数について****◆東証株価指数(TOPIX)**

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

**◆日経平均株価(日経225)**

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

**◆MSCIコクサイ指数**

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

**◆FTSE RAFI エマージング インデックス**

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

**◆ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数**

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

**◆FTSE世界国債インデックス**

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

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

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

**◆東証REIT指数(配当込み)**

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

**◆S&P先進国REIT指数**

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

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

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

## 〈分配方針〉

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

## 主な投資制限

- FW TOPIXインデックス
- FW 日経225インデックス
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
  - ③外貨建資産への投資は、行ないません。
- FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)
- FW 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
  - ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- FW 日本債券インデックス
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
  - ③外貨建資産への投資は、行ないません。
- FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
  - ③投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
  - ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

**●FW 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)**

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

**●FW J-REITインデックス**

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

**●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり/なし)**

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

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

### FW TOPIXインデックス

### FW 日経225インデックス

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

### FW 日本債券インデックス

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

\*「FW 日本債券インデックス」を除きます。

### FW J-REITインデックス

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

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

### FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2016年9月26日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金(注)、償還金など お申込金( 3 )

|       |  |  |
|-------|--|--|
| お取扱窓口 | 販売会社<br>大和証券株式会社   | 受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約<br>( 1)に基づき、次の業務を行ないます。<br>受益権の募集の取扱い<br>一部解約請求に関する事務<br>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務<br>など  |
| 1     | 収益分配金、償還金など お申込金( 3)   |  |
| 委託会社  | 大和アセットマネ<br>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。<br>受益権の募集・発行<br>信託財産の運用指図<br>信託財産の計算<br>運用報告書の作成<br>など  |
| 運用指図  | 2  | 損益 信託金( 3)   |
| 受託会社  | <p>&lt;FW 日経225<br/>インデックス&gt;<br/>みずほ信託銀行<br/>株式会社</p> <p>再信託受託会社：<br/>株式会社日本カス<br/>トディ銀行</p> | <p>信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないます。<br/>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。<br/>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br/>信託財産の計算<br/>など</p> |
|       | <p>&lt;上記以外の各<br/>ファンド&gt;<br/>三井住友信託銀行<br/>株式会社</p> <p>再信託受託会社：<br/>株式会社日本カス<br/>トディ銀行</p>    | <p>信託契約( 2)の受託者であり、次の業務を行ないます。<br/>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。<br/>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分<br/>信託財産の計算<br/>など</p> |
|       |  | 損益 投資  |

## 投資対象

ファミリーファンド方式で運用を行いません。

<FW TOPIXインデックス>  
東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など

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

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

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

<FW 日本債券インデックス>  
わが国の公社債 など

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

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

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

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

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

<委託会社の概況（2020年6月末日現在）>

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

|             |  |
|-------------|--|
| 1959年12月12日 | 大和証券投資信託委託株式会社として設立  |
| 1960年 2月17日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得  |
| 1960年 4月 1日 | 営業開始   |
| 1985年11月 8日 | 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。   |
| 1995年 5月31日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。                                |
| 1995年 9月14日 | 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。                         |
| 2007年 9月30日 | 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。<br>（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号） |
| 2020年 4月 1日 | 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更  |

・大株主の状況

| 名称 | 住所 | 所有株式数 | 比率 |
|----|----|-------|----|
|    |    |       |    |

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

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

## 主要投資対象

| ファンド名                          | 主要投資対象  |
|--------------------------------|---|
| FW TOPIXインデックス                 | トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券                                     |
| FW 日経225インデックス                 | ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券                                    |
| FW 外国株式インデックス<br>(為替ヘッジあり)     | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券                                  |
| FW 外国株式インデックス<br>(為替ヘッジなし)     | 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券  |
| FW 外国株式インデックス<br>EM+ (為替ヘッジなし) | 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券およびダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券 |
| FW 日本債券インデックス                  | 日本債券インデックスマザーファンドの受益証券  |
| FW 外国債券インデックス<br>(為替ヘッジあり)     | 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券                               |
| FW 外国債券インデックス<br>(為替ヘッジなし)     | 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券  |
| FW 外国債券インデックス<br>EM+ (為替ヘッジなし) | 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券およびダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券          |
| FW J-REITインデックス                | ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券   |
| FW 外国REITインデックス<br>(為替ヘッジあり)   | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券                              |
| FW 外国REITインデックス<br>(為替ヘッジなし)   |   |

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

## 投資態度

## &lt;FW TOPIXインデックス&gt;

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

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

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

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

#### <FW 日経225インデックス>

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

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

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

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

#### <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

#### <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### <FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### <FW 日本債券インデックス>

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

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

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

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

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

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の20%程度

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

#### <FW J - REITインデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

#### <投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

|         |   |
|---------|---|
| 投資先ファンド | わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（「ダイワ」-REITマザーファンド）を通じて実質的に投資します。） |
| 選定の方針   | 投資成果を東証REIT指数の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は東証REIT指数の構成銘柄であること。                                  |

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

#### <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券に投資し、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

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

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

#### <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

#### (2) 【投資対象】

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

イ．有価証券

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

#### 八．約束手形

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

#### 2．次に掲げる特定資産以外の資産

##### イ．為替手形

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

##### 1．株券または新株引受権証書

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

##### 2．国債証券

##### 3．地方債証券

##### 4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

#### <FW J-REITインデックス>

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

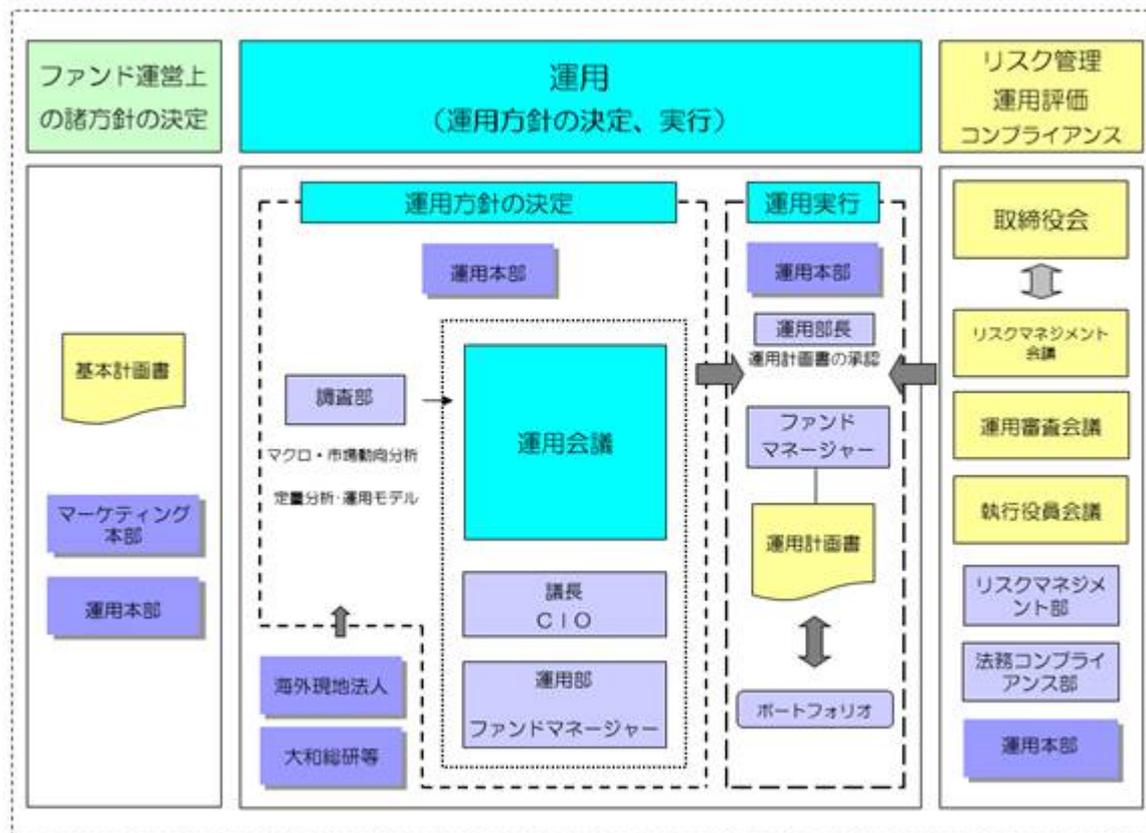
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、<ファンドの特色>をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

<各ファンド共通>

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー (0～5名程度)

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

#### ニ．運用部長 (各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

<各ファンド共通>

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

マザーファンドの受益証券(信託約款)

<各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FW J-REITインデックス>

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

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

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

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

- <上記以外の各ファンド>
- （規定なし）

#### 投資信託証券(信託約款)

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

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

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

- <FW J-REITインデックス>

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

#### 投資する株式等の範囲(信託約款)

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

<FW J-REITインデックス>

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

## 信用取引(信託約款)

&lt;FW TOPIXインデックス&gt;

&lt;FW 日経225インデックス&gt;

&lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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

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

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

&lt;上記以外の各ファンド&gt;

(規定なし)

## 先物取引等(信託約款)

&lt;FW TOPIXインデックス&gt;

&lt;FW 日経225インデックス&gt;

&lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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

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

&lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

&lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

&lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

&lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるも

のをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

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

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

#### <FW J-REITインデックス>

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

#### スワップ取引(信託約款)

#### <FW TOPIXインデックス>

#### <FW 日経225インデックス>

#### <FW 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

#### <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

#### <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

#### <FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

#### <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

#### <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

## &lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

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

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

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

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

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

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

## &lt;FW J-REITインデックス&gt;

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

## &lt;FW TOPIXインデックス&gt;

## &lt;FW 日経225インデックス&gt;

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。

なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ. 前八.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザー

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との

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

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

(規定なし)

直物為替先渡取引(信託約款)

#### <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

(規定なし)

デリバティブ取引等(信託約款)

#### <各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け(信託約款)

#### <FW TOPIXインデックス>

#### <FW 日経225インデックス>

#### <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

#### <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

<FW J - R E I Tインデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FW T O P I Xインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW J - R E I Tインデックス>

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

- <上記以外の各ファンド>
- (規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

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

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

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

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

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

- <上記以外の各ファンド>
- (規定なし)

信用リスク集中回避(信託約款)

- <各ファンド共通>

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

## 資金の借入れ(信託約款)

## &lt;各ファンド共通&gt;

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

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

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

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの概要

## トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

#### ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

#### 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

## 新株引受権証券等

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

## 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

## 同一銘柄の転換社債等

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

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

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

## 主な投資制限

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

### 外国株式インデックスマザーファンド

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

### ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

## 日本債券インデックスマザーファンド

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

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

#### 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

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

## 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

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

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

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

主な投資制限

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

#### 外国債券インデックスマザーファンド

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

#### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

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

## ダイワJ-REITマザーファンド

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

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

### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

#### <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

## <FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

### 外国証券への投資に伴うリスク

#### イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上記はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

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

#### ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

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

その他

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

<FW 日本債券インデックス>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

その他

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

<FW外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FW 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FW 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

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

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の と同内容）

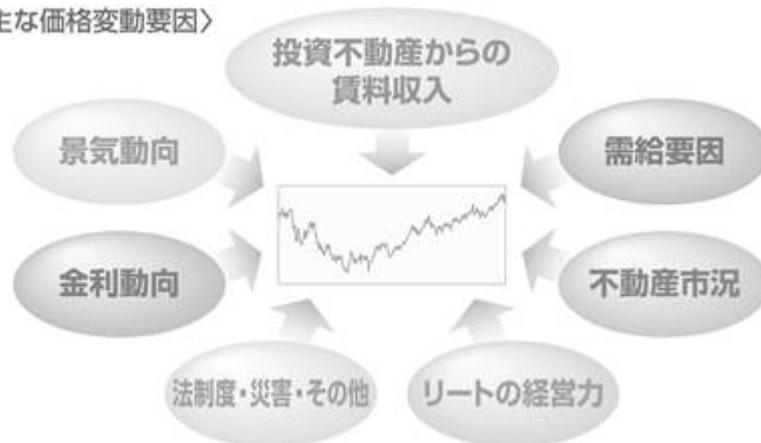
その他

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経 2 2 5インデックスの と同内容）

<FW J - R E I Tインデックス>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リーートの主な価格変動要因〉



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

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

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

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

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リーートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

その他

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

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リーートの主な価格変動要因〉



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

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

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

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

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

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

二．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

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

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

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

## (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

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

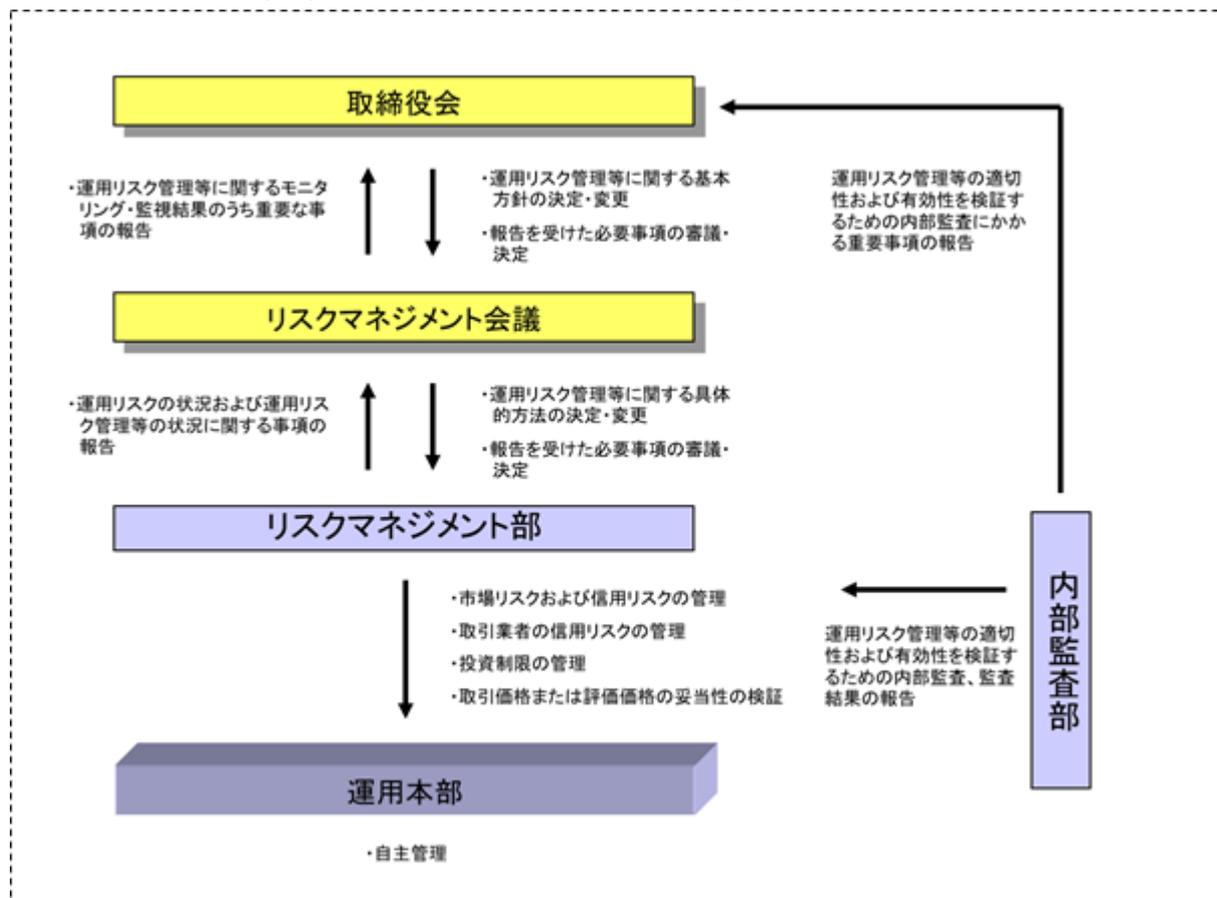
## (3) その他の留意点

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

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

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

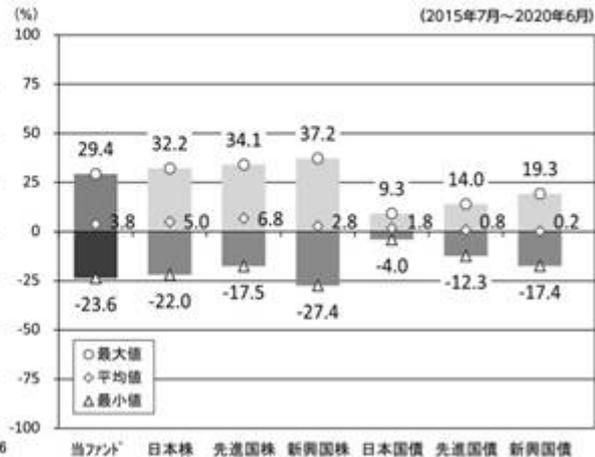
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

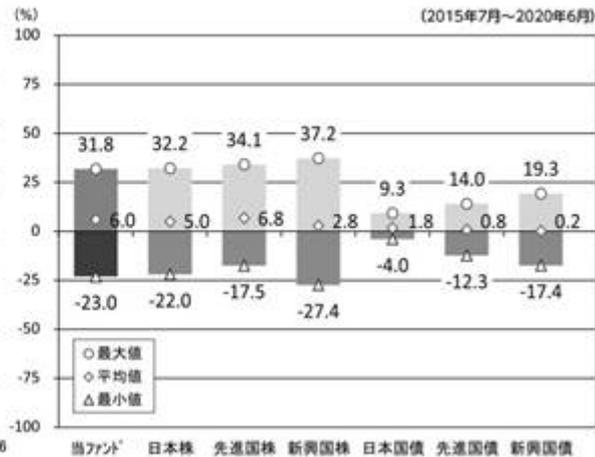
## [FW TOPIXインデックス]



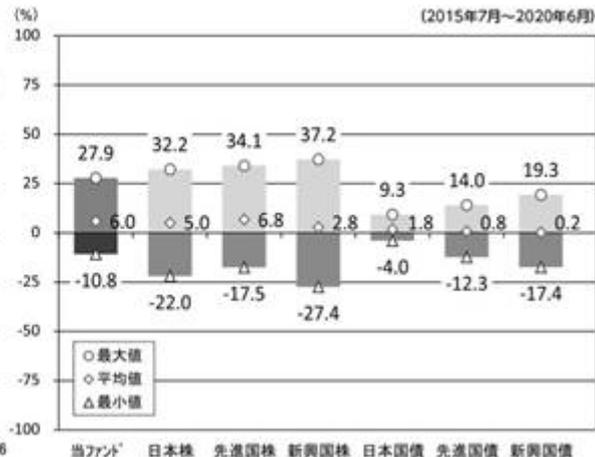
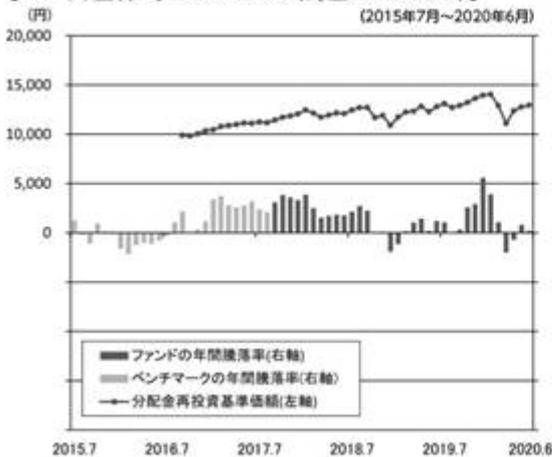
## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



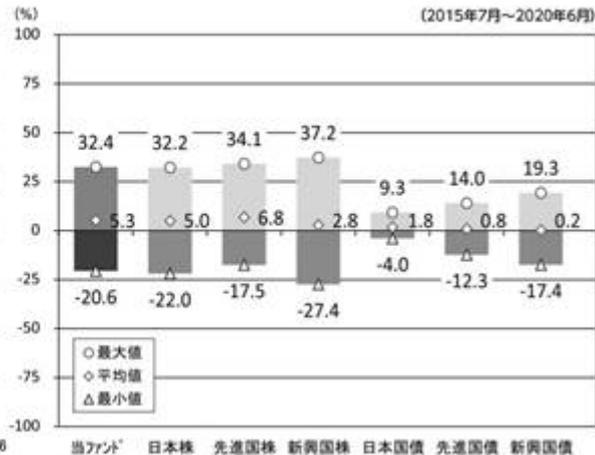
## [FW 日経225インデックス]



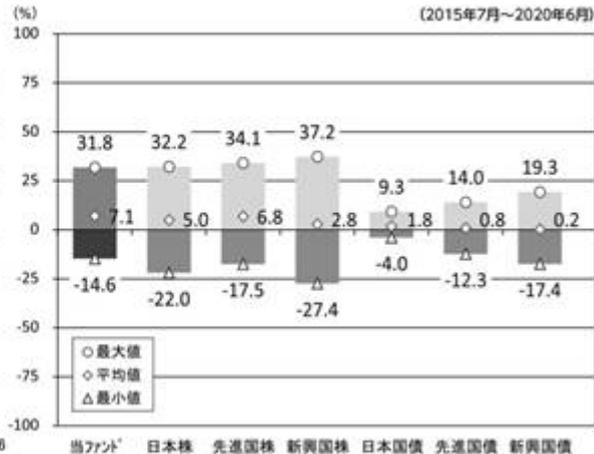
## [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



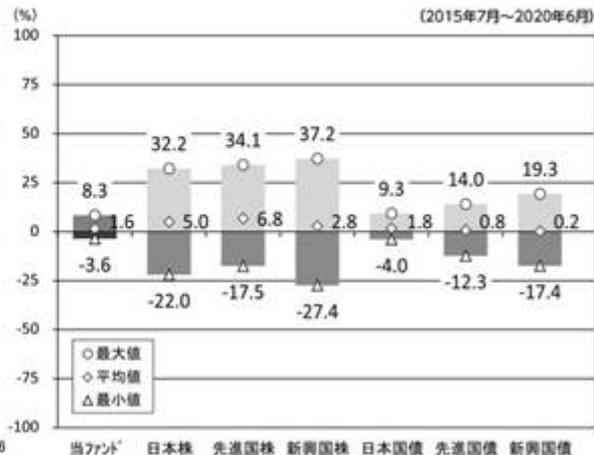
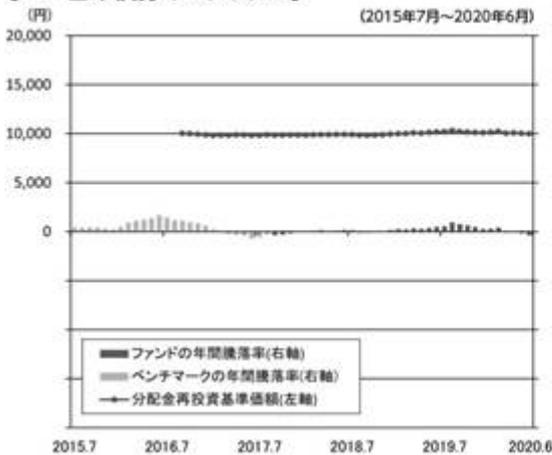
## [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]



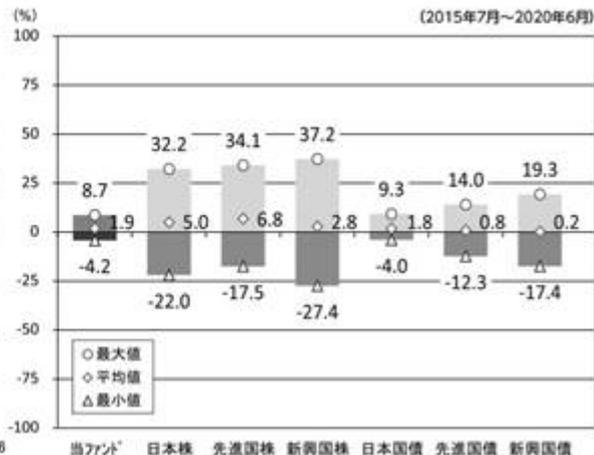
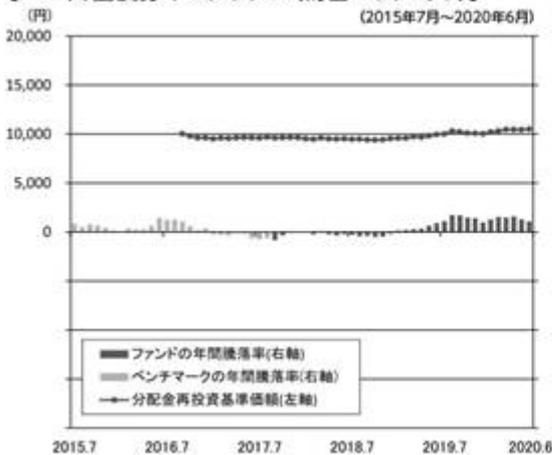
## [FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



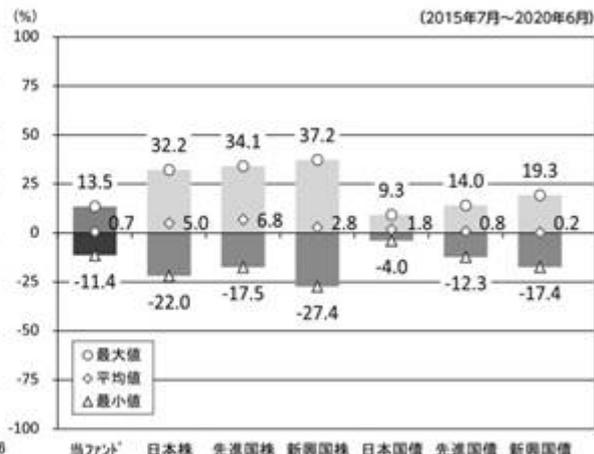
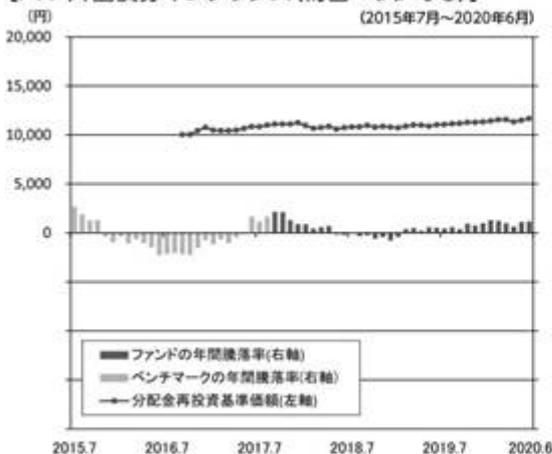
## [FW 日本債券インデックス]



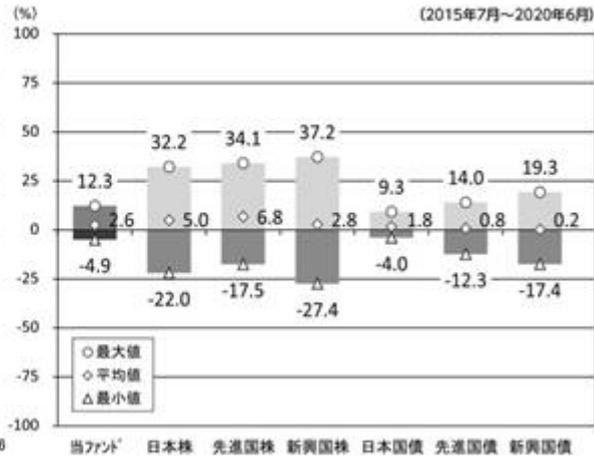
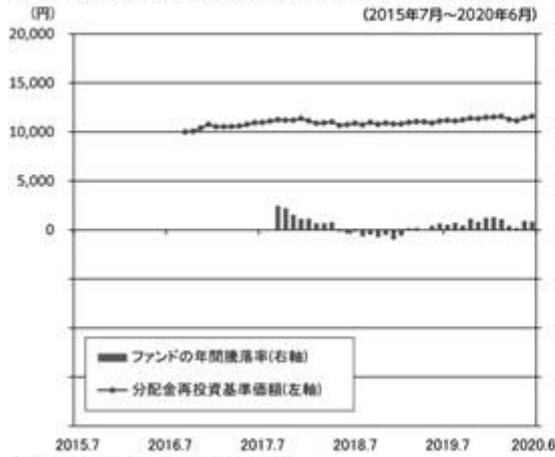
## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



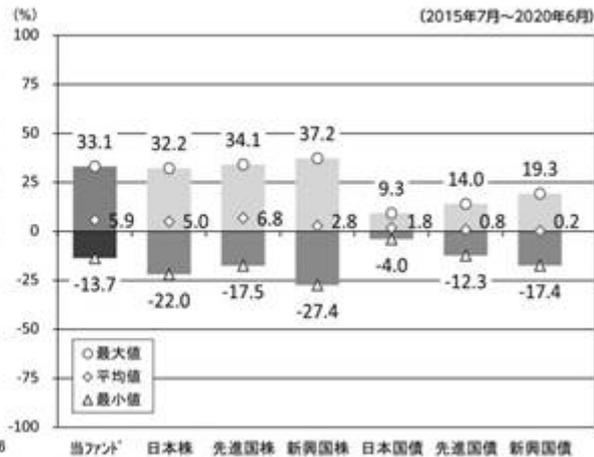
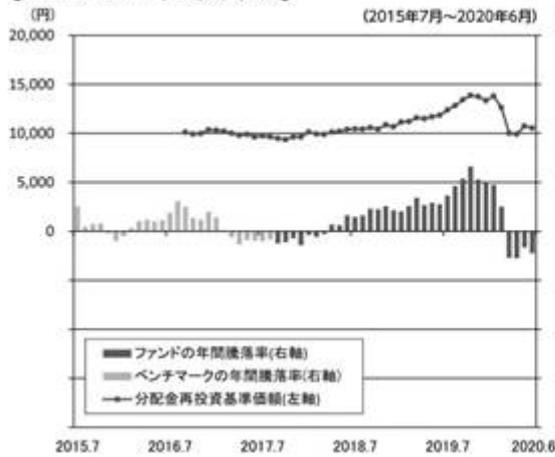
## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]



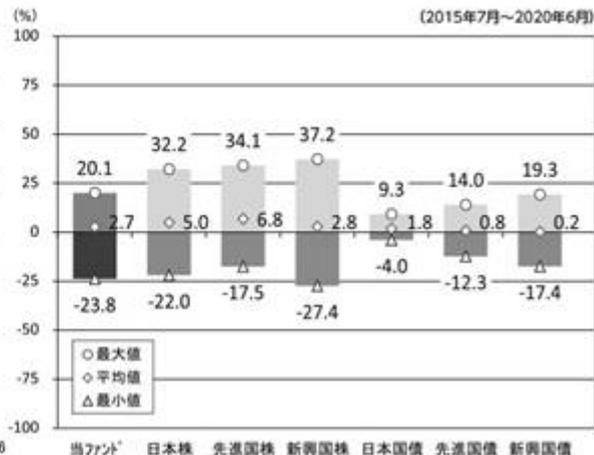
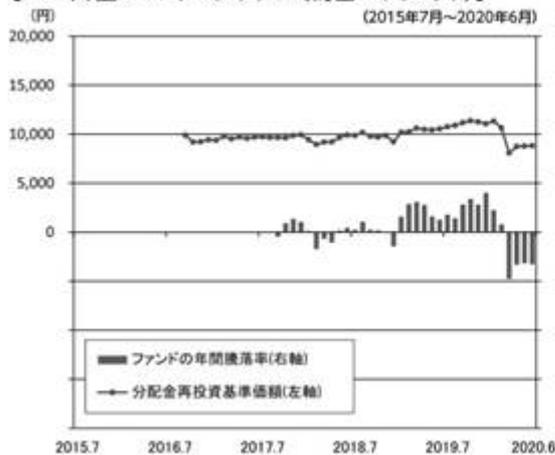
## [FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



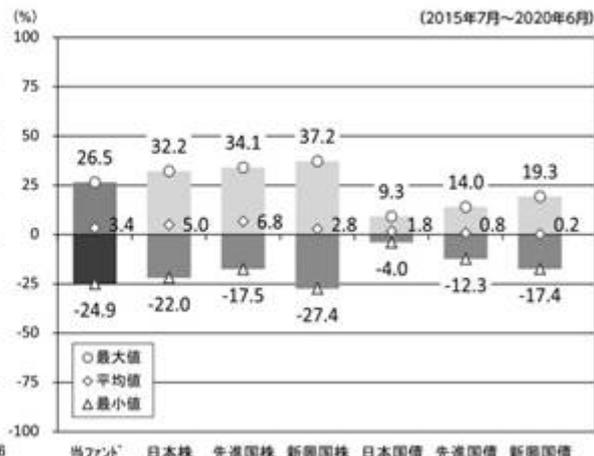
## [FW J-REITインデックス]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

##### (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

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

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

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.1485% (税抜0.135%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.3355% (税抜0.305%)

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

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.19%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

| 委託会社             | 販売会社            | 受託会社            |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.285%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

| 委託会社             | 販売会社            | 受託会社            |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.295%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

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

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.26%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

## &lt;FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）&gt;

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.26%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

## &lt;FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）&gt;

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.27%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

## &lt;FW J - R E I Tインデックス&gt;

| 委託会社            | 販売会社            | 受託会社            |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.19%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

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

| 委託会社             | 販売会社            | 受託会社            |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.275%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

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

| 委託会社             | 販売会社            | 受託会社            |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 年率0.275%<br>(税抜) | 年率0.10%<br>(税抜) | 年率0.02%<br>(税抜) |

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

##### < マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

##### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW TOPIXインデックス」および「FW 日経225インデックス」のみ。）。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

##### ロ．解約金および償還金に対する課税

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

##### ハ．損益通算について

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

譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

#### 法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### <注1> 個別元本について

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

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

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

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

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2020年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 11,465,864,178 | 99.99   |
| 内 日本                  | 11,465,864,178 | 99.99   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 799,692        | 0.01    |
| 純資産総額                 | 11,466,663,870 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                      | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|--------------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                          |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | トピックス・インデックス・マ<br>ザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 11,134,068,925  | 1.0099<br>11,244,704,731 | 1.0298<br>11,465,864,178 | 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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 4,959,328,847         | 4,959,328,847         | 1.1964                     | 1.1964                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 8,562,303,733         | 8,562,303,733         | 1.3726                     | 1.3726                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 8,839,299,537         | 8,839,299,537         | 1.2045                     | 1.2045                     |
| 2019年6月末日               | 9,029,709,656         | -                     | 1.2151                     | -                          |
| 7月末日                    | 9,529,420,804         | -                     | 1.2258                     | -                          |
| 8月末日                    | 9,275,177,665         | -                     | 1.1841                     | -                          |
| 9月末日                    | 9,937,905,533         | -                     | 1.2552                     | -                          |
| 10月末日                   | 10,713,008,133        | -                     | 1.3176                     | -                          |
| 11月末日                   | 11,136,012,115        | -                     | 1.3429                     | -                          |
| 12月末日                   | 11,278,989,843        | -                     | 1.3619                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 11,233,414,702        | -                     | 1.3325                     | -                          |
| 2月末日                    | 10,581,907,826        | -                     | 1.1952                     | -                          |
| 3月末日                    | 10,158,727,880        | -                     | 1.1236                     | -                          |
| 4月末日                    | 10,765,985,845        | -                     | 1.1718                     | -                          |
| 5月末日                    | 11,492,430,817        | -                     | 1.2512                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 11,171,069,655        | 11,171,069,655        | 1.2246                     | 1.2246                     |
| 6月末日                    | 11,466,663,870        | -                     | 1.2488                     | -                          |

【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 19.6   |
| 第2計算期間 | 14.7   |
| 第3計算期間 | 12.2   |
| 第4計算期間 | 1.7    |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)       |
|--------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 4,454,641,067 | 310,563,294   |
| 第2計算期間 | 4,087,459,929 | 1,994,650,943 |
| 第3計算期間 | 2,901,918,904 | 1,801,264,876 |
| 第4計算期間 | 4,061,789,160 | 2,278,428,042 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式                    | 143,078,737,510 | 97.81   |
| 内 日本                  | 143,078,737,510 | 97.81   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,209,998,665   | 2.19    |
| 純資産総額                 | 146,288,736,175 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 3,117,000,000 | 2.13    |
| 内 日本         | 3,117,000,000 | 2.13    |

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|    | 銘柄名               | 地域 | 種類 | 業種            | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------|----|----|---------------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | トヨタ自動車            | 日本 | 株式 | 輸送用<br>機器     | 729,700                  | 7,330.12<br>5,348,794,957  | 6,762.00<br>4,934,231,400  | 3.37            |
| 2  | ソニー               | 日本 | 株式 | 電気機<br>器      | 409,800                  | 6,380.14<br>2,614,581,478  | 7,384.00<br>3,025,963,200  | 2.07            |
| 3  | ソフトバンクグループ        | 日本 | 株式 | 情報・通<br>信業    | 510,100                  | 4,539.51<br>2,315,607,546  | 5,450.00<br>2,780,045,000  | 1.90            |
| 4  | キーエンス             | 日本 | 株式 | 電気機<br>器      | 59,300                   | 33,481.59<br>1,985,458,565 | 45,030.00<br>2,670,279,000 | 1.83            |
| 5  | 日本電信電話            | 日本 | 株式 | 情報・通<br>信業    | 858,100                  | 2,625.25<br>2,252,731,969  | 2,515.50<br>2,158,550,550  | 1.48            |
| 6  | 武田薬品              | 日本 | 株式 | 医薬品           | 544,100                  | 3,750.10<br>2,040,429,818  | 3,848.00<br>2,093,696,800  | 1.43            |
| 7  | 任天堂               | 日本 | 株式 | その他<br>製品     | 40,100                   | 41,698.66<br>1,672,116,355 | 48,010.00<br>1,925,201,000 | 1.32            |
| 8  | 三菱UFJフィナンシャル<br>G | 日本 | 株式 | 銀行業           | 4,409,700                | 557.70<br>2,459,304,712    | 421.60<br>1,859,129,520    | 1.27            |
| 9  | リクルートホールディン<br>グス | 日本 | 株式 | サービ<br>ス<br>業 | 448,900                  | 3,420.82<br>1,535,610,079  | 3,682.00<br>1,652,849,800  | 1.13            |
| 10 | 第一三共              | 日本 | 株式 | 医薬品           | 187,400                  | 7,064.75<br>1,323,935,920  | 8,806.00<br>1,650,244,400  | 1.13            |
| 11 | KDDI              | 日本 | 株式 | 情報・通<br>信業    | 468,300                  | 2,884.55<br>1,350,835,362  | 3,234.00<br>1,514,482,200  | 1.04            |
| 12 | ダイキン工業            | 日本 | 株式 | 機械            | 83,400                   | 14,426.65<br>1,203,183,223 | 17,335.00<br>1,445,739,000 | 0.99            |
| 13 | 本田技研              | 日本 | 株式 | 輸送用<br>機器     | 514,500                  | 2,864.95<br>1,474,020,613  | 2,755.50<br>1,417,704,750  | 0.97            |
| 14 | 信越化学              | 日本 | 株式 | 化学            | 109,900                  | 11,741.89<br>1,290,433,885 | 12,595.00<br>1,384,190,500 | 0.95            |
| 15 | 三井住友フィナンシャ<br>ルG  | 日本 | 株式 | 銀行業           | 446,100                  | 3,734.05<br>1,665,761,225  | 3,032.00<br>1,352,575,200  | 0.92            |
| 16 | 花王                | 日本 | 株式 | 化学            | 156,500                  | 7,988.98<br>1,250,275,828  | 8,540.00<br>1,336,510,000  | 0.91            |
| 17 | HOYA              | 日本 | 株式 | 精密機<br>器      | 130,000                  | 8,917.79<br>1,159,313,102  | 10,260.00<br>1,333,800,000 | 0.91            |

|    |             |    |    |        |           |                            |                            |      |
|----|-------------|----|----|--------|-----------|----------------------------|----------------------------|------|
| 18 | NTTドコモ      | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 458,400   | 2,832.04<br>1,298,210,069  | 2,882.00<br>1,321,108,800  | 0.90 |
| 19 | 村田製作所       | 日本 | 株式 | 電気機器   | 192,100   | 5,108.27<br>981,299,821    | 6,316.00<br>1,213,303,600  | 0.83 |
| 20 | ファナック       | 日本 | 株式 | 電気機器   | 61,600    | 20,168.18<br>1,242,360,299 | 19,260.00<br>1,186,416,000 | 0.81 |
| 21 | 中外製薬        | 日本 | 株式 | 医薬品    | 204,900   | 2,749.71<br>563,416,764    | 5,765.00<br>1,181,248,500  | 0.81 |
| 22 | みずほフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業    | 8,762,900 | 165.80<br>1,452,921,091    | 132.20<br>1,158,455,380    | 0.79 |
| 23 | 日本電産        | 日本 | 株式 | 電気機器   | 157,700   | 7,583.60<br>1,195,934,371  | 7,196.00<br>1,134,809,200  | 0.78 |
| 24 | SMC         | 日本 | 株式 | 機械     | 20,500    | 45,540.76<br>933,585,779   | 55,180.00<br>1,131,190,000 | 0.77 |
| 25 | 東京エレクトロン    | 日本 | 株式 | 電気機器   | 41,500    | 20,809.91<br>863,611,621   | 26,440.00<br>1,097,260,000 | 0.75 |
| 26 | 東京海上HD      | 日本 | 株式 | 保険業    | 228,200   | 5,827.20<br>1,329,768,685  | 4,698.00<br>1,072,083,600  | 0.73 |
| 27 | 日立          | 日本 | 株式 | 電気機器   | 314,200   | 4,027.26<br>1,265,365,439  | 3,403.00<br>1,069,222,600  | 0.73 |
| 28 | 伊藤忠         | 日本 | 株式 | 卸売業    | 450,300   | 2,294.79<br>1,033,345,381  | 2,321.50<br>1,045,371,450  | 0.71 |
| 29 | アステラス製薬     | 日本 | 株式 | 医薬品    | 566,700   | 1,543.55<br>874,731,263    | 1,799.50<br>1,019,776,650  | 0.70 |
| 30 | 三菱商事        | 日本 | 株式 | 卸売業    | 422,700   | 2,758.62<br>1,166,071,535  | 2,270.00<br>959,529,000    | 0.66 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 97.81% |
| 合計        | 97.81% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種     | 投資比率  |
|--------|-------|
| 水産・農林業 | 0.09% |
| 鉱業     | 0.19% |

|            |        |
|------------|--------|
| 建設業        | 2.52%  |
| 食料品        | 3.85%  |
| 繊維製品       | 0.50%  |
| パルプ・紙      | 0.23%  |
| 化学         | 7.15%  |
| 医薬品        | 6.75%  |
| 石油・石炭製品    | 0.41%  |
| ゴム製品       | 0.61%  |
| ガラス・土石製品   | 0.76%  |
| 鉄鋼         | 0.56%  |
| 非鉄金属       | 0.67%  |
| 金属製品       | 0.54%  |
| 機械         | 5.17%  |
| 電気機器       | 14.79% |
| 輸送用機器      | 7.11%  |
| 精密機器       | 2.59%  |
| その他製品      | 2.44%  |
| 電気・ガス業     | 1.52%  |
| 陸運業        | 3.93%  |
| 海運業        | 0.13%  |
| 空運業        | 0.34%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.18%  |
| 情報・通信業     | 9.75%  |
| 卸売業        | 4.37%  |
| 小売業        | 4.87%  |
| 銀行業        | 4.84%  |
| 証券、商品先物取引業 | 0.77%  |
| 保険業        | 1.96%  |
| その他金融業     | 1.12%  |
| 不動産業       | 1.96%  |
| サービス業      | 5.16%  |
| 合計         | 97.81% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域 | 資産名             | 買建/<br>売建 | 数量  | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------------|----|-----------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | 日本 | TOPIX先物 2020年9月 | 買建        | 200 | 3,160,217,800 | 3,117,000,000 | 2.13%    |

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●FW TOPIXインデックス

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,488円 |
| 純資産総額 | 114億円   |



| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | -0.2% |
| 3カ月間     | 11.1% |
| 6カ月間     | -8.3% |
| 1年間      | 2.8%  |
| 3年間      | 2.7%  |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 24.9% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

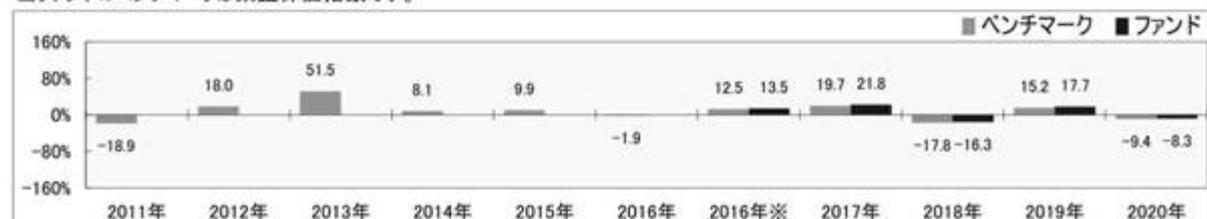
※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率    | 株式東証33業種別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄      | 業種名    | 比率    |
|-------------|-------|-------|-------------|-------|---------------|--------|-------|
| 国内株式        | 2,116 | 97.8% | 電気機器        | 14.8% | トヨタ自動車        | 輸送用機器  | 3.4%  |
| 国内株式先物      | 1     | 2.1%  | 情報・通信業      | 9.7%  | TOPIX先物 0209月 | -      | 2.1%  |
| 不動産投資信託等    | -     | -     | 化学          | 7.1%  | ソニー           | 電気機器   | 2.1%  |
| コール・ローン、その他 |       | 2.2%  | 輸送用機器       | 7.1%  | ソフトバンクグループ    | 情報・通信業 | 1.9%  |
| 合計          | 2,117 | -     | 医薬品         | 6.8%  | キーエンス         | 電気機器   | 1.8%  |
| 株式市場・上場別構成  |       |       | 機械          | 5.2%  | 日本電信電話        | 情報・通信業 | 1.5%  |
| 一部(東証・名証)   |       | 97.8% | サービス業       | 5.2%  | 武田薬品          | 医薬品    | 1.4%  |
| 二部(東証・名証)   |       | -     | 小売業         | 4.9%  | 任天堂           | その他製品  | 1.3%  |
| 新興市場他       |       | -     | 銀行業         | 4.8%  | 三菱UFJフィナンシャルG | 銀行業    | 1.3%  |
| その他         |       | -     | その他         | 32.2% | リクルートホールディングス | サービス業  | 1.1%  |
| 合計          |       | 97.8% | 合計          | 97.8% | 合計            |        | 17.9% |

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 11,611,174,339 | 99.98   |
| 内 日本                  | 11,611,174,339 | 99.98   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,920,793      | 0.02    |
| 純資産総額                 | 11,613,095,132 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                       | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                           |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | ストックインデックス225・マ<br>ザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 4,070,953,769   | 2.7521<br>11,203,799,808 | 2.8522<br>11,611,174,339 | 99.98           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 3,303,197,938         | 3,303,197,938         | 1.2007                     | 1.2007                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 6,623,555,793         | 6,623,555,793         | 1.4057                     | 1.4057                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 8,152,341,843         | 8,152,341,843         | 1.3227                     | 1.3227                     |
| 2019年6月末日               | 8,246,780,624         | -                     | 1.3341                     | -                          |
| 7月末日                    | 8,773,536,674         | -                     | 1.3491                     | -                          |
| 8月末日                    | 8,886,316,508         | -                     | 1.2985                     | -                          |
| 9月末日                    | 9,666,936,878         | -                     | 1.3741                     | -                          |
| 10月末日                   | 9,895,982,657         | -                     | 1.4480                     | -                          |
| 11月末日                   | 10,313,065,741        | -                     | 1.4709                     | -                          |
| 12月末日                   | 10,999,485,715        | -                     | 1.4959                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 11,084,132,677        | -                     | 1.4668                     | -                          |
| 2月末日                    | 10,584,910,014        | -                     | 1.3377                     | -                          |
| 3月末日                    | 9,730,386,102         | -                     | 1.2093                     | -                          |
| 4月末日                    | 10,649,366,771        | -                     | 1.2902                     | -                          |
| 5月末日                    | 11,531,485,463        | -                     | 1.3972                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 11,210,563,802        | 11,210,563,802        | 1.3749                     | 1.3749                     |
| 6月末日                    | 11,613,095,132        | -                     | 1.4251                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 20.1   |
| 第2計算期間 | 17.1   |
| 第3計算期間 | 5.9    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第4計算期間 | 3.9 |
|--------|-----|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)       |
|--------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 2,867,193,216 | 117,139,415   |
| 第2計算期間 | 2,980,382,583 | 1,019,368,476 |
| 第3計算期間 | 2,731,635,338 | 1,280,509,751 |
| 第4計算期間 | 3,775,885,438 | 1,785,574,418 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式                    | 162,104,336,080 | 98.13   |
| 内 日本                  | 162,104,336,080 | 98.13   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,087,355,219   | 1.87    |
| 純資産総額                 | 165,191,691,299 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 3,095,530,000 | 1.87    |
| 内 日本         | 3,095,530,000 | 1.87    |

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

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

|    |                   |    |    |            |           |                             |                             |      |
|----|-------------------|----|----|------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 1  | ファーストリテイリング       | 日本 | 株式 | 小売業        | 262,000   | 63,175.03<br>16,551,859,640 | 61,700.00<br>16,165,400,000 | 9.79 |
| 2  | ソフトバンクグループ        | 日本 | 株式 | 情報・通<br>信業 | 1,572,000 | 4,566.86<br>7,179,112,080   | 5,450.00<br>8,567,400,000   | 5.19 |
| 3  | 東京エレクトロン          | 日本 | 株式 | 電気機<br>器   | 262,000   | 20,765.58<br>5,440,583,040  | 26,440.00<br>6,927,280,000  | 4.19 |
| 4  | KDDI              | 日本 | 株式 | 情報・通<br>信業 | 1,572,000 | 2,891.14<br>4,544,875,920   | 3,234.00<br>5,083,848,000   | 3.08 |
| 5  | ファナック             | 日本 | 株式 | 電気機<br>器   | 262,000   | 19,855.94<br>5,202,258,720  | 19,260.00<br>5,046,120,000  | 3.05 |
| 6  | ダイキン工業            | 日本 | 株式 | 機械         | 262,000   | 14,372.99<br>3,765,724,120  | 17,335.00<br>4,541,770,000  | 2.75 |
| 7  | 中外製薬              | 日本 | 株式 | 医薬品        | 786,000   | 2,809.96<br>2,208,631,320   | 5,765.00<br>4,531,290,000   | 2.74 |
| 8  | テルモ               | 日本 | 株式 | 精密機<br>器   | 1,048,000 | 3,322.94<br>3,482,450,880   | 4,081.00<br>4,276,888,000   | 2.59 |
| 9  | 信越化学              | 日本 | 株式 | 化学         | 262,000   | 11,695.32<br>3,064,174,160  | 12,595.00<br>3,299,890,000  | 2.00 |
| 10 | アドバンテスト           | 日本 | 株式 | 電気機<br>器   | 524,000   | 4,680.51<br>2,452,587,760   | 6,120.00<br>3,206,880,000   | 1.94 |
| 11 | 京セラ               | 日本 | 株式 | 電気機<br>器   | 524,000   | 6,720.38<br>3,521,482,880   | 5,865.00<br>3,073,260,000   | 1.86 |
| 12 | リクルートホールディ<br>ングス | 日本 | 株式 | サービ<br>ス業  | 786,000   | 3,409.10<br>2,679,557,400   | 3,682.00<br>2,894,052,000   | 1.75 |
| 13 | エムスリー             | 日本 | 株式 | サービ<br>ス業  | 628,800   | 2,624.42<br>1,650,241,474   | 4,585.00<br>2,883,048,000   | 1.75 |
| 14 | T D K             | 日本 | 株式 | 電気機<br>器   | 262,000   | 9,490.00<br>2,486,380,000   | 10,680.00<br>2,798,160,000  | 1.69 |
| 15 | セコム               | 日本 | 株式 | サービ<br>ス業  | 262,000   | 9,581.62<br>2,510,384,560   | 9,423.00<br>2,468,826,000   | 1.49 |
| 16 | アステラス製薬           | 日本 | 株式 | 医薬品        | 1,310,000 | 1,535.12<br>2,011,007,800   | 1,799.50<br>2,357,345,000   | 1.43 |
| 17 | 第一三共              | 日本 | 株式 | 医薬品        | 262,000   | 7,059.43<br>1,849,572,840   | 8,806.00<br>2,307,172,000   | 1.40 |
| 18 | エーザイ              | 日本 | 株式 | 医薬品        | 262,000   | 5,669.40<br>1,485,385,200   | 8,546.00<br>2,239,052,000   | 1.36 |
| 19 | 花王                | 日本 | 株式 | 化学         | 262,000   | 7,954.51<br>2,084,081,880   | 8,540.00<br>2,237,480,000   | 1.35 |
| 20 | オリンパス             | 日本 | 株式 | 精密機<br>器   | 1,048,000 | 1,439.92<br>1,509,039,840   | 2,075.50<br>2,175,124,000   | 1.32 |

|    |              |    |    |        |           |                           |                           |      |
|----|--------------|----|----|--------|-----------|---------------------------|---------------------------|------|
| 21 | ファミリーマート     | 日本 | 株式 | 小売業    | 1,048,000 | 2,611.05<br>2,736,389,600 | 1,849.00<br>1,937,752,000 | 1.17 |
| 22 | ソニー          | 日本 | 株式 | 電気機器   | 262,000   | 6,383.48<br>1,672,474,240 | 7,384.00<br>1,934,608,000 | 1.17 |
| 23 | オムロン         | 日本 | 株式 | 電気機器   | 262,000   | 5,783.72<br>1,515,335,360 | 7,220.00<br>1,891,640,000 | 1.15 |
| 24 | 資生堂          | 日本 | 株式 | 化学     | 262,000   | 8,413.18<br>2,204,253,840 | 6,835.00<br>1,790,770,000 | 1.08 |
| 25 | トヨタ自動車       | 日本 | 株式 | 輸送用機器  | 262,000   | 7,290.81<br>1,910,192,280 | 6,762.00<br>1,771,644,000 | 1.07 |
| 26 | 塩野義製薬        | 日本 | 株式 | 医薬品    | 262,000   | 5,776.81<br>1,513,524,280 | 6,750.00<br>1,768,500,000 | 1.07 |
| 27 | 日東電工         | 日本 | 株式 | 化学     | 262,000   | 5,308.10<br>1,390,722,800 | 6,100.00<br>1,598,200,000 | 0.97 |
| 28 | トレンドマイクロ     | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 262,000   | 5,227.04<br>1,369,485,520 | 6,020.00<br>1,577,240,000 | 0.95 |
| 29 | NTTデータ       | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 1,310,000 | 1,388.75<br>1,819,275,000 | 1,199.00<br>1,570,690,000 | 0.95 |
| 30 | バンダイナムコHLDGS | 日本 | 株式 | その他製品  | 262,000   | 6,245.03<br>1,636,199,640 | 5,667.00<br>1,484,754,000 | 0.90 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 98.13% |
| 合計        | 98.13% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種     | 投資比率  |
|--------|-------|
| 水産・農林業 | 0.11% |
| 鉱業     | 0.04% |
| 建設業    | 1.98% |
| 食料品    | 3.72% |
| 繊維製品   | 0.16% |
| パルプ・紙  | 0.10% |
| 化学     | 8.07% |

|            |        |
|------------|--------|
| 医薬品        | 10.03% |
| 石油・石炭製品    | 0.21%  |
| ゴム製品       | 0.67%  |
| ガラス・土石製品   | 1.01%  |
| 鉄鋼         | 0.06%  |
| 非鉄金属       | 0.75%  |
| 金属製品       | 0.22%  |
| 機械         | 4.69%  |
| 電気機器       | 19.57% |
| 輸送用機器      | 4.13%  |
| 精密機器       | 4.10%  |
| その他製品      | 2.04%  |
| 電気・ガス業     | 0.19%  |
| 陸運業        | 1.84%  |
| 海運業        | 0.07%  |
| 空運業        | 0.04%  |
| 倉庫・運輸関連業   | 0.22%  |
| 情報・通信業     | 11.05% |
| 卸売業        | 1.69%  |
| 小売業        | 12.45% |
| 銀行業        | 0.54%  |
| 証券、商品先物取引業 | 0.28%  |
| 保険業        | 0.79%  |
| その他金融業     | 0.20%  |
| 不動産業       | 1.20%  |
| サービス業      | 5.90%  |
| 合計         | 98.13% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域 | 資産名            | 買建/<br>売建 | 数量  | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------------|----|----------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | 日本 | 日経平均先物 2020年9月 | 買建        | 139 | 3,156,635,330 | 3,095,530,000 | 1.87%    |

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●FW 日経225インデックス

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 14,251円 |
| 純資産総額 | 116億円   |



| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 2.0%  |
| 3カ月間     | 17.8% |
| 6カ月間     | -4.7% |
| 1年間      | 6.8%  |
| 3年間      | 17.4% |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 42.5% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

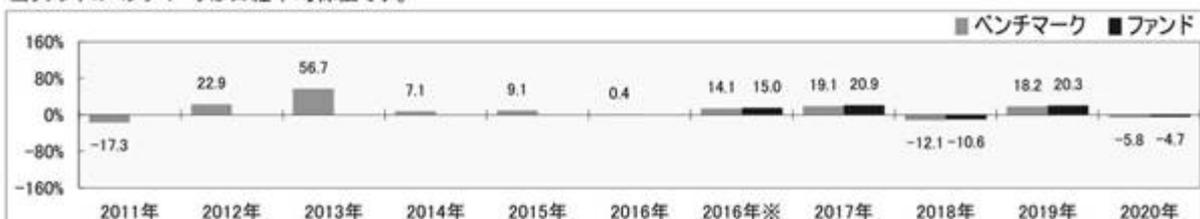
※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率    | 株式東証33業種別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄    | 業種名    | 比率    |
|-------------|-----|-------|-------------|-------|-------------|--------|-------|
| 国内株式        | 225 | 98.1% | 電気機器        | 19.6% | ファーストリテイリング | 小売業    | 9.8%  |
| 国内株式先物      | 1   | 1.9%  | 小売業         | 12.4% | ソフトバンクグループ  | 情報・通信業 | 5.2%  |
| 不動産投資信託等    | -   | -     | 情報・通信業      | 11.0% | 東京エレクトロン    | 電気機器   | 4.2%  |
| コール・ローン、その他 |     | 1.9%  | 医薬品         | 10.0% | KDDI        | 情報・通信業 | 3.1%  |
| 合計          | 226 | -     | 化学          | 8.1%  | ファナック       | 電気機器   | 3.1%  |
| 株式市場・上場別構成  |     |       | サービス業       | 5.9%  | ダイキン工業      | 機械     | 2.7%  |
| 一部(東証・名証)   |     | 98.1% | 機械          | 4.7%  | 中外製薬        | 医薬品    | 2.7%  |
| 二部(東証・名証)   |     | -     | 輸送用機器       | 4.1%  | テルモ         | 精密機器   | 2.6%  |
| 新興市場他       |     | -     | 精密機器        | 4.1%  | 信越化学        | 化学     | 2.0%  |
| その他         |     | -     | その他         | 18.1% | アドバンテスト     | 電気機器   | 1.9%  |
| 合計          |     | 98.1% | 合計          | 98.1% | 合計          |        | 37.3% |

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均株価です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 42,938,373,722 | 99.99   |
| 内 日本                  | 42,938,373,722 | 99.99   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 6,339,434      | 0.01    |
| 純資産総額                 | 42,944,713,156 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                         | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                             |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | 外国株式インデックス為替<br>ヘッジ型マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 21,527,310,600  | 1.9761<br>42,540,997,491 | 1.9946<br>42,938,373,722 | 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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 16,740,001,185        | 16,740,001,185        | 1.1194                     | 1.1194                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 31,820,531,530        | 31,820,531,530        | 1.2400                     | 1.2400                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 36,065,457,483        | 36,065,457,483        | 1.2648                     | 1.2648                     |
| 2019年6月末日               | 36,877,246,774        | -                     | 1.2804                     | -                          |
| 7月末日                    | 37,374,205,229        | -                     | 1.3100                     | -                          |
| 8月末日                    | 37,125,101,516        | -                     | 1.2715                     | -                          |
| 9月末日                    | 38,061,831,995        | -                     | 1.2930                     | -                          |
| 10月末日                   | 39,404,451,236        | -                     | 1.3217                     | -                          |
| 11月末日                   | 41,429,253,681        | -                     | 1.3640                     | -                          |
| 12月末日                   | 42,358,179,938        | -                     | 1.3945                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 43,199,291,225        | -                     | 1.4045                     | -                          |
| 2月末日                    | 40,648,041,213        | -                     | 1.2903                     | -                          |
| 3月末日                    | 35,257,599,184        | -                     | 1.1094                     | -                          |
| 4月末日                    | 40,984,108,941        | -                     | 1.2364                     | -                          |
| 5月末日                    | 42,135,341,699        | -                     | 1.2773                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 42,369,088,321        | 42,369,088,321        | 1.2825                     | 1.2825                     |
| 6月末日                    | 42,944,713,156        | -                     | 1.2944                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 11.9   |
| 第2計算期間 | 10.8   |
| 第3計算期間 | 2.0    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第4計算期間 | 1.4 |
|--------|-----|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)        | 解約数量(口)       |
|--------|----------------|---------------|
| 第1計算期間 | 15,911,823,542 | 958,970,794   |
| 第2計算期間 | 15,243,885,793 | 4,536,508,120 |
| 第3計算期間 | 9,938,067,643  | 7,085,414,359 |
| 第4計算期間 | 12,720,408,945 | 8,198,873,384 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類   | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------|----------------|---------|
| 株式        | 52,712,587,601 | 95.50   |
| 内 香港      | 604,868,210    | 1.10    |
| 内 シンガポール  | 178,589,618    | 0.32    |
| 内 イスラエル   | 120,585,863    | 0.22    |
| 内 ノルウェー   | 104,918,351    | 0.19    |
| 内 スウェーデン  | 580,077,196    | 1.05    |
| 内 デンマーク   | 456,698,993    | 0.83    |
| 内 イギリス    | 2,588,429,417  | 4.69    |
| 内 アイルランド  | 122,026,497    | 0.22    |
| 内 オランダ    | 794,337,693    | 1.44    |
| 内 ベルギー    | 164,662,498    | 0.30    |
| 内 フランス    | 1,989,065,467  | 3.60    |
| 内 ドイツ     | 1,716,290,910  | 3.11    |
| 内 スイス     | 1,902,900,520  | 3.45    |
| 内 ポルトガル   | 28,787,068     | 0.05    |
| 内 スペイン    | 450,524,887    | 0.82    |
| 内 イタリア    | 430,664,302    | 0.78    |
| 内 フィンランド  | 191,665,826    | 0.35    |
| 内 オーストリア  | 33,664,166     | 0.06    |
| 内 カナダ     | 1,835,992,765  | 3.33    |
| 内 アメリカ    | 37,287,263,111 | 67.55   |
| 内 オーストラリア | 1,066,441,599  | 1.93    |

|                       |            |                |        |
|-----------------------|------------|----------------|--------|
|                       | 内 ニュージーランド | 64,132,644     | 0.12   |
| 投資証券                  |            | 1,435,283,502  | 2.60   |
|                       | 内 香港       | 39,503,800     | 0.07   |
|                       | 内 シンガポール   | 31,304,133     | 0.06   |
|                       | 内 イギリス     | 30,716,509     | 0.06   |
|                       | 内 フランス     | 29,163,250     | 0.05   |
|                       | 内 カナダ      | 16,625,066     | 0.03   |
|                       | 内 アメリカ     | 1,156,987,350  | 2.10   |
|                       | 内 オーストラリア  | 130,983,394    | 0.24   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |            | 1,051,431,822  | 1.90   |
| 純資産総額                 |            | 55,199,302,925 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      |           | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|--------------|-----------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) |           | 1,208,561,718  | 2.19    |
|              | 内 イギリス    | 65,751,462     | 0.12    |
|              | 内 ドイツ     | 228,449,507    | 0.41    |
|              | 内 カナダ     | 29,096,112     | 0.05    |
|              | 内 アメリカ    | 820,911,463    | 1.49    |
|              | 内 オーストラリア | 64,353,174     | 0.12    |
| 為替予約取引(売建)   |           | 53,850,085,969 | 97.56   |
|              | 内 日本      | 53,850,085,969 | 97.56   |

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名       | 地域   | 種類 | 業種   | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------|------|----|------|-----------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
|   |           |      |    |      | また<br>は<br>額面金額 |                            |                            |                 |
| 1 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 57,864          | 32,859.40<br>1,901,381,286 | 38,978.17<br>2,255,433,246 | 4.09            |

|    |                              |      |    |                |        |                             |                             |      |
|----|------------------------------|------|----|----------------|--------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 2  | MICROSOFT CORP               | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 95,607 | 17,516.04<br>1,674,661,545  | 21,379.92<br>2,044,070,547  | 3.70 |
| 3  | AMAZON.COM INC               | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス     | 5,594  | 208,165.63<br>1,164,478,883 | 288,784.14<br>1,615,458,486 | 2.93 |
| 4  | FACEBOOK INC-CLASS A         | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 31,769 | 22,905.84<br>727,698,065    | 23,771.75<br>755,204,840    | 1.37 |
| 5  | ALPHABET INC-CL C            | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 4,037  | 149,499.26<br>603,528,648   | 150,294.06<br>606,737,152   | 1.10 |
| 6  | ALPHABET INC-CL A            | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 3,989  | 150,853.77<br>601,756,021   | 150,531.09<br>600,468,541   | 1.09 |
| 7  | JOHNSON & JOHNSON            | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 34,816 | 15,640.29<br>544,535,640    | 14,980.16<br>521,549,585    | 0.94 |
| 8  | NESTLE SA-REG                | スイス  | 株式 | 生活必需品          | 39,217 | 11,683.28<br>458,187,121    | 11,879.04<br>465,860,406    | 0.84 |
| 9  | VISA INC-CLASS A SHARES      | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 22,553 | 20,494.19<br>462,207,088    | 20,619.28<br>465,026,649    | 0.84 |
| 10 | PROCTER & GAMBLE CO/THE      | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 33,011 | 13,246.09<br>437,268,483    | 12,676.68<br>418,470,161    | 0.76 |
| 11 | JPMORGAN CHASE & CO          | アメリカ | 株式 | 金融             | 40,457 | 14,265.42<br>577,138,684    | 10,019.82<br>405,371,858    | 0.73 |
| 12 | UNITEDHEALTH GROUP INC       | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 12,499 | 31,196.44<br>389,925,402    | 31,218.74<br>390,203,061    | 0.71 |
| 13 | HOME DEPOT INC               | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス     | 14,403 | 23,824.33<br>343,143,157    | 26,516.96<br>381,923,902    | 0.69 |
| 14 | MASTERCARD INC - A           | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 11,821 | 32,570.01<br>385,010,328    | 31,560.27<br>373,074,049    | 0.68 |
| 15 | INTEL CORP                   | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 56,300 | 6,368.51<br>358,550,483     | 6,278.00<br>353,451,952     | 0.64 |
| 16 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | スイス  | 株式 | ヘルスケア          | 9,391  | 36,238.09<br>340,312,466    | 37,526.76<br>352,413,888    | 0.64 |

|    |                                |      |    |                |         |                          |                          |      |
|----|--------------------------------|------|----|----------------|---------|--------------------------|--------------------------|------|
| 17 | BERKSHIRE HATHAWAY<br>INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融             | 18,048  | 23,898.99<br>431,329,160 | 19,090.45<br>344,544,452 | 0.62 |
| 18 | NVIDIA CORP                    | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 8,107   | 26,855.81<br>217,720,349 | 39,648.32<br>321,428,930 | 0.58 |
| 19 | VERIZON<br>COMMUNICATIONS INC  | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 54,342  | 6,297.72<br>342,235,854  | 5,892.30<br>320,199,399  | 0.58 |
| 20 | AT&T INC                       | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 94,268  | 4,063.73<br>383,082,405  | 3,222.50<br>303,778,951  | 0.55 |
| 21 | ADOBE INC                      | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 6,341   | 36,364.40<br>230,587,082 | 45,703.30<br>289,804,676 | 0.53 |
| 22 | WALT DISNEY CO/THE             | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 23,998  | 14,974.02<br>359,347,711 | 12,015.16<br>288,339,925 | 0.52 |
| 23 | NETFLIX INC                    | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 5,814   | 36,945.66<br>214,802,488 | 48,185.63<br>280,151,297 | 0.51 |
| 24 | CISCO SYSTEMS INC              | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 55,739  | 5,012.92<br>279,415,973  | 4,972.20<br>277,145,512  | 0.50 |
| 25 | MERCK & CO. INC.               | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 33,538  | 9,466.25<br>317,479,978  | 8,201.16<br>275,050,799  | 0.50 |
| 26 | EXXON MOBIL CORP               | アメリカ | 株式 | エネルギー          | 56,834  | 7,087.46<br>402,811,806  | 4,775.03<br>271,384,441  | 0.49 |
| 27 | PAYPAL HOLDINGS INC            | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 14,645  | 11,935.11<br>174,790,544 | 18,138.02<br>265,631,435 | 0.48 |
| 28 | NOVARTIS AG-REG                | スイス  | 株式 | ヘルスケア          | 28,050  | 10,369.36<br>290,861,338 | 9,439.15<br>264,768,197  | 0.48 |
| 29 | BANK OF AMERICA<br>CORP        | アメリカ | 株式 | 金融             | 103,493 | 3,644.09<br>377,147,426  | 2,520.03<br>260,806,355  | 0.47 |
| 30 | PEPSICO INC                    | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 18,309  | 14,422.29<br>264,059,097 | 14,122.55<br>258,569,936 | 0.47 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|------|
|-----------|------|

|      |        |
|------|--------|
| 株式   | 95.50% |
| 投資証券 | 2.60%  |
| 合計   | 98.10% |

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

| 業種             | 投資比率   |
|----------------|--------|
| エネルギー          | 3.37%  |
| 素材             | 4.16%  |
| 資本財・サービス       | 9.02%  |
| 一般消費財・サービス     | 10.22% |
| 生活必需品          | 8.17%  |
| ヘルスケア          | 14.02% |
| 金融             | 12.73% |
| 情報技術           | 21.45% |
| コミュニケーション・サービス | 8.49%  |
| 公益事業           | 3.43%  |
| 不動産            | 0.42%  |
| 合計             | 95.50% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域      | 資産名                             | 買建/<br>売建 | 数量 | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------------|---------|---------------------------------|-----------|----|-------------|-------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ    | S&P500 E-MINI FUTURE<br>2020年9月 | 買建        | 50 | 823,893,167 | 820,911,463 | 1.49%    |
|              | イギリス    | FT 100 2020年9月                  | 買建        | 8  | 65,329,020  | 65,751,462  | 0.12%    |
|              | オーストラリア | SPI 200 INDEX 2020年9<br>月       | 買建        | 6  | 65,262,046  | 64,353,174  | 0.12%    |
|              | カナダ     | S&P/TSE 60 INDEX 2020<br>年9月    | 買建        | 2  | 28,930,396  | 29,096,112  | 0.05%    |
|              | ドイツ     | SMI 2020年9月                     | 買建        | 5  | 56,477,108  | 56,796,813  | 0.10%    |
|              |         | EURO STOXX 50 2020年9<br>月       | 買建        | 44 | 168,963,992 | 171,652,694 | 0.31%    |

|        |    |                         |    |             |                |                |        |
|--------|----|-------------------------|----|-------------|----------------|----------------|--------|
| 為替予約取引 | 日本 | 香港ドル売/円買 2020年7月        | 売建 | 40,771,300  | 566,011,649    | 566,313,357    | 1.03%  |
|        |    | イスラエル・シケル売/円買 2020年7月   | 売建 | 1,972,200   | 60,529,579     | 61,512,918     | 0.11%  |
|        |    | ノルウェー・クローネ売/円買 2020年7月  | 売建 | 9,748,800   | 108,169,760    | 108,504,144    | 0.20%  |
|        |    | ニュージーランド・ドル売/円買 2020年7月 | 売建 | 885,100     | 59,327,456     | 61,142,708     | 0.11%  |
|        |    | スウェーデン・クローネ売/円買 2020年7月 | 売建 | 49,616,600  | 568,963,476    | 573,071,730    | 1.04%  |
|        |    | シンガポール・ドル売/円買 2020年7月   | 売建 | 2,700,900   | 206,327,963    | 208,779,570    | 0.38%  |
|        |    | 英ポンド売/円買 2020年7月        | 売建 | 20,108,800  | 2,680,408,529  | 2,664,416,000  | 4.83%  |
|        |    | ユーロ売/円買 2020年7月         | 売建 | 48,056,100  | 5,759,200,721  | 5,818,632,588  | 10.54% |
|        |    | 米ドル売/円買 2020年7月         | 売建 | 356,081,400 | 38,344,096,024 | 38,360,649,222 | 69.49% |
|        |    | スイス・フラン売/円買 2020年7月     | 売建 | 16,755,500  | 1,880,163,140  | 1,897,057,710  | 3.44%  |
|        |    | カナダ・ドル売/円買 2020年7月      | 売建 | 23,598,900  | 1,850,809,809  | 1,859,357,331  | 3.37%  |
|        |    | 豪ドル売/円買 2020年7月         | 売建 | 16,494,300  | 1,188,494,961  | 1,218,433,941  | 2.21%  |
|        |    | デンマーク・クローネ売/円買 2020年7月  | 売建 | 27,828,600  | 447,553,459    | 452,214,750    | 0.82%  |

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,944円 |
| 純資産総額 | 429億円   |

| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 1.3%  |
| 3カ月間     | 16.7% |
| 6カ月間     | -7.2% |
| 1年間      | 1.1%  |
| 3年間      | 16.7% |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 29.4% |



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | 株式業種別構成        | 比率    | 組入上位10銘柄                | 国・地域名 | 比率    |
|-------------|-------|--------|-------------|--------|----------------|-------|-------------------------|-------|-------|
| 外国株式・先物     | 1,204 | 97.7%  | 日本円         | 98.8%  | 情報技術           | 21.4% | APPLE INC               | アメリカ  | 4.1%  |
| 外国リート       | 65    | 2.5%   | 米ドル         | 0.7%   | ヘルスケア          | 14.0% | MICROSOFT CORP          | アメリカ  | 3.7%  |
| 外国投資証券      | 6     | 0.1%   | ユーロ         | 0.3%   | 金融             | 12.7% | AMAZON.COM INC          | アメリカ  | 2.9%  |
|             |       |        | 香港ドル        | 0.1%   | 一般消費財・サービス     | 10.2% | S&P500 EMINI FUT 202009 | アメリカ  | 1.5%  |
| コール・ローン、その他 |       | 1.9%   | スイス・フラン     | 0.0%   | 資本財・サービス       | 9.0%  | FACEBOOK INC-CLASS A    | アメリカ  | 1.4%  |
| 合計          | 1,275 | -      | カナダ・ドル      | 0.0%   | コミュニケーション・サービス | 8.5%  | ALPHABET INC-CL C       | アメリカ  | 1.1%  |
| 国・地域別構成     |       |        | スウェーデン・クローネ | 0.0%   | 生活必需品          | 8.2%  | ALPHABET INC-CL A       | アメリカ  | 1.1%  |
| アメリカ        |       | 71.1%  | デンマーク・クローネ  | 0.0%   | 素材             | 4.2%  | JOHNSON & JOHNSON       | アメリカ  | 0.9%  |
| イギリス        |       | 4.9%   | シンガポール・ドル   | 0.0%   | 公益事業           | 3.4%  | NESTLE SA-REG           | スイス   | 0.8%  |
| その他         |       | 24.3%  | その他         | -0.0%  | エネルギー、他        | 3.8%  | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ  | 0.8%  |
| 合計          |       | 100.3% | 合計          | 100.0% | 合計             | 95.5% | 合計                      |       | 18.4% |

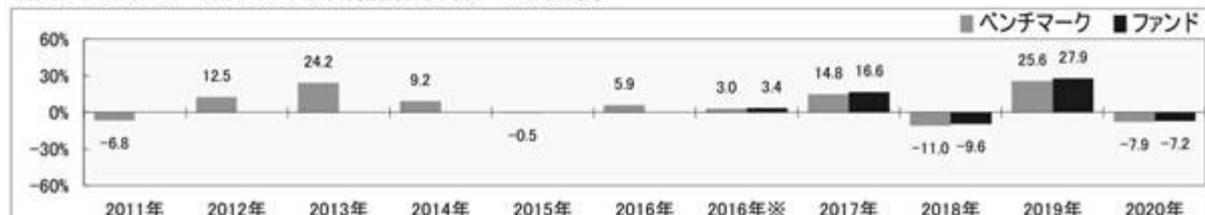
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表示しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 5,870,106,994 | 99.99   |
| 内 日本                  | 5,870,106,994 | 99.99   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 324,067       | 0.01    |
| 純資産総額                 | 5,870,431,061 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                   | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------|----|-------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
|   |                       |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                         |                         |                 |
| 1 | 外国株式インデックスマザー<br>ファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 2,266,800,662   | 2.5555<br>5,792,862,354 | 2.5896<br>5,870,106,994 | 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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 1,719,851,096         | 1,719,851,096         | 1.2232                     | 1.2232                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 3,307,440,968         | 3,307,440,968         | 1.3931                     | 1.3931                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 4,523,386,578         | 4,523,386,578         | 1.4011                     | 1.4011                     |
| 2019年6月末日               | 4,647,181,323         | -                     | 1.4147                     | -                          |
| 7月末日                    | 4,723,517,050         | -                     | 1.4526                     | -                          |
| 8月末日                    | 4,632,247,692         | -                     | 1.3801                     | -                          |
| 9月末日                    | 4,880,923,076         | -                     | 1.4238                     | -                          |
| 10月末日                   | 4,763,763,662         | -                     | 1.4800                     | -                          |
| 11月末日                   | 5,120,619,426         | -                     | 1.5344                     | -                          |
| 12月末日                   | 5,452,709,608         | -                     | 1.5802                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 5,644,050,129         | -                     | 1.5814                     | -                          |
| 2月末日                    | 5,381,555,969         | -                     | 1.4561                     | -                          |
| 3月末日                    | 4,777,284,477         | -                     | 1.2367                     | -                          |
| 4月末日                    | 5,437,256,179         | -                     | 1.3576                     | -                          |
| 5月末日                    | 5,683,015,350         | -                     | 1.4153                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 5,717,881,883         | 5,717,881,883         | 1.4231                     | 1.4231                     |
| 6月末日                    | 5,870,431,061         | -                     | 1.4420                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 22.3   |
| 第2計算期間 | 13.9   |
| 第3計算期間 | 0.6    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第4計算期間 | 1.6 |
|--------|-----|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)       |
|--------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 1,475,674,063 | 70,680,538    |
| 第2計算期間 | 1,380,206,909 | 412,026,062   |
| 第3計算期間 | 1,523,438,524 | 669,208,679   |
| 第4計算期間 | 1,946,108,703 | 1,156,513,875 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類   | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------|-----------------|---------|
| 株式        | 127,350,238,702 | 96.33   |
| 内 香港      | 1,456,992,458   | 1.10    |
| 内 シンガポール  | 427,671,980     | 0.32    |
| 内 イスラエル   | 288,246,284     | 0.22    |
| 内 ノルウェー   | 241,112,922     | 0.18    |
| 内 スウェーデン  | 1,396,258,433   | 1.06    |
| 内 デンマーク   | 1,073,325,267   | 0.81    |
| 内 イギリス    | 6,330,180,902   | 4.79    |
| 内 アイルランド  | 284,418,796     | 0.22    |
| 内 オランダ    | 1,939,330,875   | 1.47    |
| 内 ベルギー    | 406,600,632     | 0.31    |
| 内 フランス    | 4,852,834,480   | 3.67    |
| 内 ドイツ     | 4,152,984,560   | 3.14    |
| 内 スイス     | 4,666,430,221   | 3.53    |
| 内 ポルトガル   | 76,230,624      | 0.06    |
| 内 スペイン    | 1,088,949,249   | 0.82    |
| 内 イタリア    | 1,035,755,987   | 0.78    |
| 内 フィンランド  | 445,960,240     | 0.34    |
| 内 オーストリア  | 76,539,421      | 0.06    |
| 内 カナダ     | 4,436,389,078   | 3.36    |
| 内 アメリカ    | 89,906,431,958  | 68.00   |
| 内 オーストラリア | 2,621,834,490   | 1.98    |

|                       |            |                 |        |
|-----------------------|------------|-----------------|--------|
|                       | 内 ニュージーランド | 145,759,845     | 0.11   |
| 投資証券                  |            | 3,390,720,443   | 2.56   |
|                       | 内 香港       | 86,920,592      | 0.07   |
|                       | 内 シンガポール   | 74,129,468      | 0.06   |
|                       | 内 イギリス     | 70,627,511      | 0.05   |
|                       | 内 フランス     | 76,104,562      | 0.06   |
|                       | 内 カナダ      | 23,178,311      | 0.02   |
|                       | 内 アメリカ     | 2,733,504,466   | 2.07   |
|                       | 内 オーストラリア  | 326,255,533     | 0.25   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |            | 1,465,991,389   | 1.11   |
| 純資産総額                 |            | 132,206,950,534 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      |           | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|--------------|-----------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) |           | 1,660,419,699 | 1.26    |
|              | 内 イギリス    | 57,532,529    | 0.04    |
|              | 内 ドイツ     | 194,027,190   | 0.15    |
|              | 内 カナダ     | 58,192,224    | 0.04    |
|              | 内 アメリカ    | 1,297,040,111 | 0.98    |
|              | 内 オーストラリア | 53,627,645    | 0.04    |
| 為替予約取引(買建)   |           | 886,688,890   | 0.67    |
|              | 内 日本      | 886,688,890   | 0.67    |

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名       | 地域   | 種類 | 業種   | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------|------|----|------|-----------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
|   |           |      |    |      | また<br>は<br>額面金額 |                            |                            |                 |
| 1 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 139,200         | 28,909.01<br>4,024,137,214 | 38,978.17<br>5,425,762,266 | 4.10            |

|    |                              |      |    |                |         |                             |                             |      |
|----|------------------------------|------|----|----------------|---------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 2  | MICROSOFT CORP               | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 230,000 | 16,534.53<br>3,802,960,957  | 21,379.92<br>4,917,382,888  | 3.72 |
| 3  | AMAZON.COM INC               | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス     | 13,460  | 197,797.06<br>2,662,349,332 | 288,784.14<br>3,887,034,541 | 2.94 |
| 4  | FACEBOOK INC-CLASS A         | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 76,600  | 21,604.13<br>1,654,879,612  | 23,771.75<br>1,820,916,326  | 1.38 |
| 5  | ALPHABET INC-CL C            | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 9,787   | 140,917.99<br>1,379,165,337 | 150,294.06<br>1,470,928,042 | 1.11 |
| 6  | ALPHABET INC-CL A            | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 9,560   | 140,884.27<br>1,346,854,012 | 150,531.09<br>1,439,077,276 | 1.09 |
| 7  | JOHNSON & JOHNSON            | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 84,000  | 14,869.19<br>1,249,014,844  | 14,980.16<br>1,258,334,246  | 0.95 |
| 8  | NESTLE SA-REG                | スイス  | 株式 | 生活必需品          | 95,900  | 11,763.55<br>1,128,134,264  | 11,879.04<br>1,139,200,166  | 0.86 |
| 9  | VISA INC-CLASS A SHARES      | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 54,400  | 19,890.63<br>1,082,052,644  | 20,619.28<br>1,121,688,897  | 0.85 |
| 10 | PROCTER & GAMBLE CO/THE      | アメリカ | 株式 | 生活必需品          | 78,717  | 13,118.20<br>1,032,633,547  | 12,676.68<br>997,870,881    | 0.75 |
| 11 | JPMORGAN CHASE & CO          | アメリカ | 株式 | 金融             | 98,070  | 14,008.35<br>1,373,805,259  | 10,019.82<br>982,643,747    | 0.74 |
| 12 | UNITEDHEALTH GROUP INC       | アメリカ | 株式 | ヘルスケア          | 30,226  | 30,050.94<br>908,320,129    | 31,218.74<br>943,617,708    | 0.71 |
| 13 | HOME DEPOT INC               | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス     | 34,800  | 23,806.44<br>828,468,023    | 26,516.96<br>922,790,514    | 0.70 |
| 14 | MASTERCARD INC - A           | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 28,550  | 31,504.14<br>899,444,388    | 31,560.27<br>901,045,943    | 0.68 |
| 15 | INTEL CORP                   | アメリカ | 株式 | 情報技術           | 136,400 | 6,262.60<br>854,229,896     | 6,278.00<br>856,320,537     | 0.65 |
| 16 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | スイス  | 株式 | ヘルスケア          | 22,630  | 35,143.48<br>795,298,726    | 37,526.76<br>849,230,782    | 0.64 |

|    |                                |      |    |                            |         |                            |                          |      |
|----|--------------------------------|------|----|----------------------------|---------|----------------------------|--------------------------|------|
| 17 | BERKSHIRE HATHAWAY<br>INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融                         | 44,150  | 23,313.21<br>1,029,280,569 | 19,090.45<br>842,843,394 | 0.64 |
| 18 | VERIZON<br>COMMUNICATIONS INC  | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 131,704 | 6,448.02<br>849,241,583    | 5,892.30<br>776,039,558  | 0.59 |
| 19 | NVIDIA CORP                    | アメリカ | 株式 | 情報技<br>術                   | 19,500  | 24,900.86<br>485,568,773   | 39,648.32<br>773,142,240 | 0.58 |
| 20 | AT&T INC                       | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 228,791 | 3,991.98<br>913,335,207    | 3,222.50<br>737,279,775  | 0.56 |
| 21 | ADOBE INC                      | アメリカ | 株式 | 情報技<br>術                   | 15,350  | 33,805.25<br>518,911,502   | 45,703.30<br>701,545,778 | 0.53 |
| 22 | WALT DISNEY CO/THE             | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 57,562  | 15,910.82<br>915,862,990   | 12,015.16<br>691,616,916 | 0.52 |
| 23 | NETFLIX INC                    | アメリカ | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 13,970  | 34,778.04<br>485,850,373   | 48,185.63<br>673,153,357 | 0.51 |
| 24 | CISCO SYSTEMS INC              | アメリカ | 株式 | 情報技<br>術                   | 135,250 | 4,862.84<br>657,704,271    | 4,972.20<br>672,490,185  | 0.51 |
| 25 | MERCK & CO. INC.               | アメリカ | 株式 | ヘルス<br>ケア                  | 80,821  | 9,328.02<br>753,902,654    | 8,201.16<br>662,826,664  | 0.50 |
| 26 | NOVARTIS AG-REG                | スイス  | 株式 | ヘルス<br>ケア                  | 69,200  | 10,328.60<br>714,741,355   | 9,439.15<br>653,189,277  | 0.49 |
| 27 | EXXON MOBIL CORP               | アメリカ | 株式 | エネル<br>ギー                  | 135,005 | 7,101.25<br>958,711,154    | 4,775.03<br>644,653,843  | 0.49 |
| 28 | PAYPAL HOLDINGS INC            | アメリカ | 株式 | 情報技<br>術                   | 35,450  | 11,750.77<br>416,568,360   | 18,138.02<br>642,993,128 | 0.49 |
| 29 | BANK OF AMERICA<br>CORP        | アメリカ | 株式 | 金融                         | 250,101 | 3,549.38<br>887,725,510    | 2,520.03<br>630,264,174  | 0.48 |
| 30 | PEPSICO INC                    | アメリカ | 株式 | 生活必<br>需品                  | 44,300  | 14,624.19<br>647,852,310   | 14,122.55<br>625,629,373 | 0.47 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|------|
|-----------|------|

|      |        |
|------|--------|
| 株式   | 96.33% |
| 投資証券 | 2.56%  |
| 合計   | 98.89% |

(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

| 業種             | 投資比率   |
|----------------|--------|
| エネルギー          | 3.42%  |
| 素材             | 4.26%  |
| 資本財・サービス       | 9.08%  |
| 一般消費財・サービス     | 10.23% |
| 生活必需品          | 8.25%  |
| ヘルスケア          | 14.17% |
| 金融             | 12.80% |
| 情報技術           | 21.62% |
| コミュニケーション・サービス | 8.60%  |
| 公益事業           | 3.44%  |
| 不動産            | 0.46%  |
| 合計             | 96.33% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域      | 資産名                             | 買建/<br>売建 | 数量 | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------------|---------|---------------------------------|-----------|----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ    | S&P500 E-MINI FUTURE<br>2020年9月 | 買建        | 79 | 1,288,215,720 | 1,297,040,111 | 0.98%    |
|              | イギリス    | FT 100 2020年9月                  | 買建        | 7  | 56,705,567    | 57,532,529    | 0.04%    |
|              | オーストラリア | SPI 200 INDEX 2020年9<br>月       | 買建        | 5  | 53,481,547    | 53,627,645    | 0.04%    |
|              | カナダ     | S&P/TSE 60 INDEX 2020<br>年9月    | 買建        | 4  | 57,816,506    | 58,192,224    | 0.04%    |
|              | ドイツ     | SMI 2020年9月                     | 買建        | 3  | 33,744,740    | 34,078,088    | 0.03%    |
|              |         | EURO STOXX 50 2020年9<br>月       | 買建        | 41 | 157,732,248   | 159,949,102   | 0.12%    |

|        |    |                       |    |           |             |             |       |
|--------|----|-----------------------|----|-----------|-------------|-------------|-------|
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2020年7月       | 買建 | 7,080,000 | 759,626,940 | 762,728,400 | 0.58% |
|        |    | カナダ・ドル買/円売<br>2020年7月 | 買建 | 227,000   | 17,886,970  | 17,885,330  | 0.01% |
|        |    | ユーロ買/円売 2020年7月       | 買建 | 852,000   | 103,103,958 | 103,160,160 | 0.08% |
|        |    | 英ポンド買/円売 2020年7月      | 買建 | 22,000    | 2,915,195   | 2,915,000   | 0.00% |

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 14,420円 |
| 純資産総額 | 58億円    |



| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 1.9%  |
| 3カ月間     | 16.6% |
| 6カ月間     | -8.7% |
| 1年間      | 1.9%  |
| 3年間      | 15.8% |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 44.2% |

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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<br>17年6月 | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |  |  |  |  |  |
|-----|--------------|--------------|--------------|--------------|--|--|--|--|--|
| 分配金 | 0円           | 0円           | 0円           | 0円           |  |  |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | 株式業種別構成        | 比率    | 組入上位10銘柄                | 国・地域名 | 比率    |
|-------------|-------|--------|-------------|--------|----------------|-------|-------------------------|-------|-------|
| 外国株式・先物     | 1,219 | 97.6%  | 米ドル         | 71.3%  | 情報技術           | 21.6% | APPLE INC               | アメリカ  | 4.1%  |
| 外国リート       | 65    | 2.4%   | ユーロ         | 11.0%  | ヘルスケア          | 14.2% | MICROSOFT CORP          | アメリカ  | 3.7%  |
| 外国投資証券      | 6     | 0.1%   | 英ポンド        | 4.9%   | 金融             | 12.8% | AMAZON.COM INC          | アメリカ  | 2.9%  |
|             |       |        | スイス・フラン     | 3.5%   | 一般消費財・サービス     | 10.2% | FACEBOOK INC-CLASS A    | アメリカ  | 1.4%  |
| コール・ローン、その他 |       | 1.1%   | カナダ・ドル      | 3.4%   | 資本財・サービス       | 9.1%  | ALPHABET INC-CL C       | アメリカ  | 1.1%  |
| 合計          | 1,290 | -      | 豪ドル         | 2.3%   | コミュニケーション・サービス | 8.6%  | ALPHABET INC-CL A       | アメリカ  | 1.1%  |
|             |       |        | 香港ドル        | 1.1%   | 生活必需品          | 8.2%  | S&P500 EMINI FUT 202009 | アメリカ  | 1.0%  |
| 国・地域別構成     |       | 比率     | スウェーデン・クローネ | 1.1%   | 素材             | 4.3%  | JOHNSON & JOHNSON       | アメリカ  | 1.0%  |
| アメリカ        |       | 71.0%  | デンマーク・クローネ  | 0.8%   | 公益事業           | 3.4%  | NESTLE SA-REG           | スイス   | 0.9%  |
| イギリス        |       | 4.9%   | その他         | 0.6%   | エネルギー、他        | 3.9%  | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ  | 0.8%  |
| その他         |       | 24.2%  | 合計          | 100.0% | 合計             | 96.3% | 合計                      |       | 18.0% |
| 合計          |       | 100.1% |             |        |                |       |                         |       |       |

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

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

## (1) 【投資状況】(2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 1,810,770,605 | 99.21   |
| 内 日本                  | 1,810,770,605 | 99.21   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 14,375,467    | 0.79    |
| 純資産総額                 | 1,825,146,072 | 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6月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                                     | 地域 | 種類                | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---|----|-------------------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 1 | 外国株式インデックスマザー<br>ファンド                   | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 555,767,054              | 2.5551<br>1,420,067,010 | 2.5896<br>1,439,214,363 | 78.85           |
| 2 | ダイワ新興国株式ファンダメン<br>タル・インデックス・マザーファ<br>ンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 278,715,957              | 1.3308<br>370,940,205   | 1.3331<br>371,556,242   | 20.36           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 826,097,593           | 826,097,593           | 1.2158                     | 1.2158                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 1,697,993,255         | 1,697,993,255         | 1.3778                     | 1.3778                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 1,747,579,023         | 1,747,579,023         | 1.3793                     | 1.3793                     |
| 2019年6月末日               | 1,770,969,434         | -                     | 1.3990                     | -                          |
| 7月末日                    | 1,808,665,512         | -                     | 1.4270                     | -                          |
| 8月末日                    | 1,666,428,319         | -                     | 1.3432                     | -                          |
| 9月末日                    | 1,713,775,039         | -                     | 1.3911                     | -                          |
| 10月末日                   | 1,802,723,233         | -                     | 1.4500                     | -                          |
| 11月末日                   | 1,852,209,191         | -                     | 1.4942                     | -                          |
| 12月末日                   | 1,966,470,259         | -                     | 1.5491                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 1,952,892,795         | -                     | 1.5309                     | -                          |
| 2月末日                    | 1,825,194,351         | -                     | 1.4174                     | -                          |
| 3月末日                    | 1,536,863,122         | -                     | 1.1825                     | -                          |
| 4月末日                    | 1,752,991,688         | -                     | 1.2918                     | -                          |
| 5月末日                    | 1,816,200,517         | -                     | 1.3375                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 1,800,845,481         | 1,800,845,481         | 1.3573                     | 1.3573                     |
| 6月末日                    | 1,825,146,072         | -                     | 1.3719                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 21.6   |
| 第2計算期間 | 13.3   |

|        |     |
|--------|-----|
| 第3計算期間 | 0.1 |
| 第4計算期間 | 1.6 |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)     | 解約数量(口)     |
|--------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 702,644,049 | 33,190,572  |
| 第2計算期間 | 695,338,362 | 142,407,106 |
| 第3計算期間 | 339,152,791 | 304,533,894 |
| 第4計算期間 | 415,919,823 | 356,157,946 |

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

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

## ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類   | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------|---------------|---------|
| 株式        | 7,402,355,576 | 84.25   |
| 内 中国      | 2,935,710,088 | 33.41   |
| 内 台湾      | 1,119,510,319 | 12.74   |
| 内 タイ      | 285,980,495   | 3.26    |
| 内 シンガポール  | 6,343,092     | 0.07    |
| 内 マレーシア   | 51,712,653    | 0.59    |
| 内 インドネシア  | 81,628,678    | 0.93    |
| 内 インド     | 576,985,642   | 6.57    |
| 内 サウジアラビア | 188,091,243   | 2.14    |
| 内 ロシア     | 712,743,839   | 8.11    |
| 内 トルコ     | 145,754,060   | 1.66    |
| 内 カナダ     | 5,740,818     | 0.07    |
| 内 メキシコ    | 196,829,062   | 2.24    |
| 内 チリ      | 48,135,112    | 0.55    |
| 内 ブラジル    | 690,930,954   | 7.86    |
| 内 南アフリカ   | 356,259,521   | 4.06    |

|                       |         |               |        |
|-----------------------|---------|---------------|--------|
| 投資証券                  |         | 1,212,318,464 | 13.80  |
|                       | 内 アメリカ  | 1,198,792,813 | 13.64  |
|                       | 内 メキシコ  | 6,820,609     | 0.08   |
|                       | 内 南アフリカ | 6,705,042     | 0.08   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |         | 170,983,286   | 1.95   |
| 純資産総額                 |         | 8,785,657,326 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類      | 時価(円)       | 投資比率(%) |
|--------------|-------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 117,317,009 | 1.34    |
| 内 アメリカ       | 117,317,009 | 1.34    |
| 為替予約取引(買建)   | 26,932,000  | 0.31    |
| 内 日本         | 26,932,000  | 0.31    |

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                                | 地域   | 種類       | 業種        | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)         | 評価単価<br>時価<br>(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|------------------------------------|------|----------|-----------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|-----------------|
| 1 | INVESCO FTSE RAFI<br>EMERGING M    | アメリカ | 投資<br>証券 | -         | 638,000                  | 1,826.83<br>1,165,561,401 | 1,878.98<br>1,198,792,813 | 13.64           |
| 2 | CHINA CONSTRUCTION<br>BANK-H       | 中国   | 株式       | 金融        | 3,811,000                | 86.27<br>328,852,316      | 86.59<br>330,021,167      | 3.76            |
| 3 | TAIWAN<br>SEMICONDUCTOR<br>MANUFAC | 台湾   | 株式       | 情報技<br>術  | 266,000                  | 896.33<br>238,425,822     | 1,138.80<br>302,920,800   | 3.45            |
| 4 | IND & COMM BK OF<br>CHINA-H        | 中国   | 株式       | 金融        | 3,083,000                | 75.74<br>233,539,660      | 66.02<br>203,555,075      | 2.32            |
| 5 | GAZPROM PJSC-SPON<br>ADR           | ロシア  | 株式       | エネル<br>ギー | 327,290                  | 731.33<br>239,377,238     | 597.52<br>195,564,298     | 2.23            |

|    |                                  |          |    |                            |           |                          |                          |      |
|----|----------------------------------|----------|----|----------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|------|
| 6  | CHINA MOBILE LTD                 | 中国       | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 215,000   | 914.16<br>196,546,237    | 720.02<br>154,804,300    | 1.76 |
| 7  | ALIBABA GROUP<br>HOLDING-SP ADR  | 中国       | 株式 | 一般消<br>費財・<br>サービ<br>ス     | 6,400     | 18,712.39<br>119,759,728 | 23,166.25<br>148,264,031 | 1.69 |
| 8  | LUKOIL PJSC-SPON ADR             | ロシア      | 株式 | エネル<br>ギー                  | 16,830    | 9,091.10<br>153,005,245  | 8,117.13<br>136,611,325  | 1.55 |
| 9  | BANK OF CHINA LTD-H              | 中国       | 株式 | 金融                         | 3,386,000 | 45.07<br>152,670,558     | 40.17<br>136,019,006     | 1.55 |
| 10 | TENCENT HOLDINGS<br>LTD          | 中国       | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 18,200    | 4,915.37<br>89,459,873   | 6,755.40<br>122,948,280  | 1.40 |
| 11 | VALE SA                          | ブラジ<br>ル | 株式 | 素材                         | 103,590   | 980.91<br>101,613,230    | 1,108.70<br>114,850,844  | 1.31 |
| 12 | HON HAI PRECISION<br>INDUSTRY    | 台湾       | 株式 | 情報技<br>術                   | 367,902   | 272.89<br>100,400,811    | 310.98<br>114,410,164    | 1.30 |
| 13 | SBERBANK PJSC -<br>SPONSORED ADR | ロシア      | 株式 | 金融                         | 81,100    | 1,639.15<br>132,939,016  | 1,249.24<br>101,313,794  | 1.15 |
| 14 | RELIANCE INDUSTRIES<br>LTD       | インド      | 株式 | エネル<br>ギー                  | 40,040    | 1,818.19<br>72,800,527   | 2,481.33<br>99,352,693   | 1.13 |
| 15 | PING AN INSURANCE<br>GROUP CO-H  | 中国       | 株式 | 金融                         | 91,500    | 1,269.59<br>116,168,913  | 1,081.42<br>98,949,930   | 1.13 |
| 16 | ITAU UNIBANCO<br>HOLDING S-PREF  | ブラジ<br>ル | 株式 | 金融                         | 183,336   | 649.23<br>119,029,992    | 527.74<br>96,754,914     | 1.10 |
| 17 | CHINA PETROLEUM &<br>CHEMICAL-H  | 中国       | 株式 | エネル<br>ギー                  | 1,743,800 | 68.56<br>119,588,172     | 45.45<br>79,260,941      | 0.90 |
| 18 | PTT PCL-NVDR                     | タイ       | 株式 | エネル<br>ギー                  | 590,200   | 149.45<br>88,206,822     | 130.00<br>76,727,476     | 0.87 |
| 19 | CNOOC LTD                        | 中国       | 株式 | エネル<br>ギー                  | 593,000   | 163.36<br>96,876,930     | 119.40<br>70,804,793     | 0.81 |
| 20 | AGRICULTURAL BANK<br>OF CHINA-H  | 中国       | 株式 | 金融                         | 1,467,000 | 43.65<br>64,063,260      | 43.78<br>64,232,595      | 0.73 |
| 21 | BANCO BRADESCO SA-<br>PREF       | ブラジ<br>ル | 株式 | 金融                         | 143,726   | 605.59<br>87,041,046     | 426.70<br>61,328,071     | 0.70 |
| 22 | MEDIATEK INC                     | 台湾       | 株式 | 情報技<br>術                   | 28,003    | 1,186.25<br>33,218,646   | 2,062.25<br>57,749,187   | 0.66 |

|    |                                 |                 |    |                            |           |                         |                         |      |
|----|---------------------------------|-----------------|----|----------------------------|-----------|-------------------------|-------------------------|------|
| 23 | BAIDU INC - SPON ADR            | 中国              | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 4,400     | 11,212.17<br>49,333,780 | 13,067.78<br>57,498,252 | 0.65 |
| 24 | PETROBRAS -<br>PETROLEO BRAS-PR | ブラジ<br>ル        | 株式 | エネル<br>ギー                  | 130,000   | 480.75<br>62,497,915    | 431.68<br>56,118,894    | 0.64 |
| 25 | SAUDI BASIC<br>INDUSTRIES CORP  | サウジ<br>アラビ<br>ア | 株式 | 素材                         | 21,460    | 1,972.06<br>42,320,645  | 2,554.77<br>54,825,493  | 0.62 |
| 26 | AMERICA MOVIL SAB<br>DE C-SER L | メキシ<br>コ        | 株式 | コミュニ<br>ケーショ<br>ン・サー<br>ビス | 776,600   | 65.75<br>51,066,511     | 69.52<br>53,994,824     | 0.61 |
| 27 | JD.COM INC-ADR                  | 中国              | 株式 | 一般消<br>費財・<br>サービ<br>ス     | 8,200     | 3,362.34<br>27,571,761  | 6,419.14<br>52,637,023  | 0.60 |
| 28 | INFOSYS LTD                     | インド             | 株式 | 情報技<br>術                   | 47,240    | 1,058.37<br>49,997,585  | 1,053.72<br>49,777,733  | 0.57 |
| 29 | CHINA MERCHANTS<br>BANK-H       | 中国              | 株式 | 金融                         | 91,500    | 526.67<br>48,190,513    | 497.62<br>45,532,230    | 0.52 |
| 30 | PETROCHINA CO LTD-H             | 中国              | 株式 | エネル<br>ギー                  | 1,258,000 | 49.03<br>61,702,569     | 35.72<br>44,939,534     | 0.51 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 株式        | 84.25% |
| 投資証券      | 13.80% |
| 合計        | 98.05% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

| 業種         | 投資比率   |
|------------|--------|
| エネルギー      | 13.00% |
| 素材         | 8.14%  |
| 資本財・サービス   | 2.78%  |
| 一般消費財・サービス | 5.59%  |
| 生活必需品      | 3.73%  |
| ヘルスケア      | 0.73%  |

|                |        |
|----------------|--------|
| 金融             | 26.73% |
| 情報技術           | 10.24% |
| コミュニケーション・サービス | 8.49%  |
| 公益事業           | 2.18%  |
| 不動産            | 2.66%  |
| 合計             | 84.25% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類           | 地域   | 資産名                 | 買建/<br>売建 | 数量      | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------------|------|---------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 株価指数先物<br>取引 | アメリカ | MSCI EMGMKT 2020年9月 | 買建        | 22      | 116,771,736 | 117,317,009 | 1.34%    |
| 為替予約取引       | 日本   | 米ドル買/円売 2020年7<br>月 | 買建        | 250,000 | 26,931,655  | 26,932,000  | 0.31%    |

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 13,719円 |
| 純資産総額 | 18億円    |



| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | 2.6%   |
| 3カ月間     | 16.0%  |
| 6カ月間     | -11.4% |
| 1年間      | -1.9%  |
| 3年間      | 10.8%  |
| 5年間      | -      |
| 設定来      | 37.2%  |

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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<br>17年6月 | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |  |  |  |  |  |
|-----|--------------|--------------|--------------|--------------|--|--|--|--|--|
| 分配金 | 0円           | 0円           | 0円           | 0円           |  |  |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

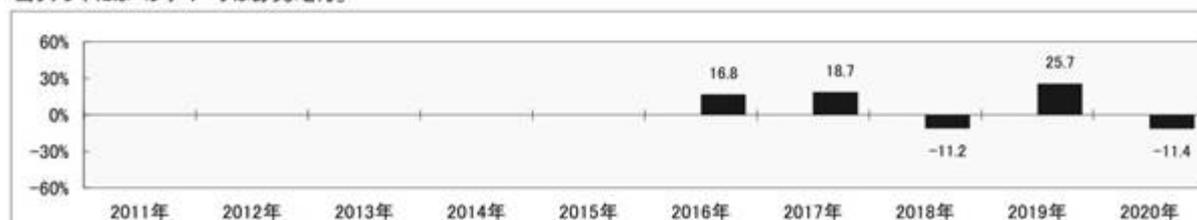
※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率    | 通貨別構成    | 比率     | 株式業種別構成        | 比率    | 組入上位10銘柄                     | 国・地域名 | 比率    |
|-------------|-------|-------|----------|--------|----------------|-------|------------------------------|-------|-------|
| 外国株式・先物     | 1,617 | 94.4% | 米ドル      | 61.6%  | 情報技術           | 19.1% | APPLE INC                    | アメリカ  | 3.2%  |
| 外国投資証券      | 7     | 2.9%  | ユーロ      | 8.7%   | 金融             | 15.5% | MICROSOFT CORP               | アメリカ  | 2.9%  |
| 外国リート       | 67    | 1.9%  | 香港ドル     | 6.3%   | ヘルスケア          | 11.3% | INVESCO FTSE RAFI EMERGING M | アメリカ  | 2.8%  |
|             |       |       | 英ポンド     | 3.9%   | 一般消費財・サービス     | 9.2%  | AMAZON.COM INC               | アメリカ  | 2.3%  |
| コール・ローン、その他 |       | 2.1%  | スイス・フラン  | 2.8%   | コミュニケーション・サービス | 8.5%  | FACEBOOK INC-CLASS A         | アメリカ  | 1.1%  |
| 合計          | 1,691 | -     | カナダ・ドル   | 2.7%   | 資本財・サービス       | 7.7%  | ALPHABET INC-CL C            | アメリカ  | 0.9%  |
| 国・地域別構成     |       |       | 台湾ドル     | 2.6%   | 生活必需品          | 7.3%  | ALPHABET INC-CL A            | アメリカ  | 0.9%  |
| アメリカ        |       | 59.1% | 豪ドル      | 1.8%   | エネルギー          | 5.3%  | S&P500 EMINI FUT 202009      | アメリカ  | 0.8%  |
| 中国          |       | 6.8%  | ブラジル・レアル | 1.6%   | 素材             | 5.0%  | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 中国    | 0.8%  |
| その他         |       | 33.3% | その他      | 8.0%   | 公益事業、他         | 4.1%  | JOHNSON & JOHNSON            | アメリカ  | 0.8%  |
| 合計          |       | 99.2% | 合計       | 100.0% | 合計             | 93.1% | 合計                           |       | 16.4% |

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

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
 ・2016年は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】(2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 33,248,484,527 | 99.90   |
| 内 日本                  | 33,248,484,527 | 99.90   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 33,188,040     | 0.10    |
| 純資産総額                 | 33,281,672,567 | 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6月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                   | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                       |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | 日本債券インデックスマ<br>ザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 23,470,622,990  | 1.4218<br>33,372,528,405 | 1.4166<br>33,248,484,527 | 99.90           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 14,248,194,432        | 14,248,194,432        | 0.9858                     | 0.9858                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 25,120,930,051        | 25,120,930,051        | 0.9915                     | 0.9915                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 27,372,292,105        | 27,372,292,105        | 1.0149                     | 1.0149                     |
| 2019年6月末日               | 27,665,414,904        | -                     | 1.0166                     | -                          |
| 7月末日                    | 28,021,938,198        | -                     | 1.0176                     | -                          |
| 8月末日                    | 29,132,604,570        | -                     | 1.0317                     | -                          |
| 9月末日                    | 29,267,044,639        | -                     | 1.0202                     | -                          |
| 10月末日                   | 29,791,220,135        | -                     | 1.0155                     | -                          |
| 11月末日                   | 30,514,988,610        | -                     | 1.0118                     | -                          |
| 12月末日                   | 31,017,677,137        | -                     | 1.0086                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 32,552,663,441        | -                     | 1.0130                     | -                          |
| 2月末日                    | 34,373,247,463        | -                     | 1.0212                     | -                          |
| 3月末日                    | 33,979,202,029        | -                     | 1.0045                     | -                          |
| 4月末日                    | 33,264,274,318        | -                     | 1.0076                     | -                          |
| 5月末日                    | 33,168,628,410        | -                     | 1.0029                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 33,339,891,042        | 33,339,891,042        | 1.0024                     | 1.0024                     |
| 6月末日                    | 33,281,672,567        | -                     | 0.9986                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 1.4    |
| 第2計算期間 | 0.6    |
| 第3計算期間 | 2.4    |
| 第4計算期間 | 1.2    |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)        | 解約数量(口)       |
|--------|----------------|---------------|
| 第1計算期間 | 15,709,737,796 | 1,257,184,902 |
| 第2計算期間 | 17,894,969,975 | 7,012,636,355 |
| 第3計算期間 | 9,926,740,515  | 8,292,385,149 |
| 第4計算期間 | 14,370,293,804 | 8,081,979,073 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 国債証券                  | 87,468,871,680 | 88.99   |
| 内 日本                  | 87,468,871,680 | 88.99   |
| 地方債証券                 | 4,335,934,800  | 4.41    |
| 内 日本                  | 4,335,934,800  | 4.41    |
| 特殊債券                  | 3,300,204,000  | 3.36    |
| 内 日本                  | 3,300,204,000  | 3.36    |
| 社債券                   | 2,674,206,100  | 2.72    |
| 内 日本                  | 2,674,206,100  | 2.72    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 507,703,663    | 0.52    |
| 純資産総額                 | 98,286,920,243 | 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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名      | 地域 | 種類   | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----------|----|------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | 135 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 2,820,000,000            | 100.78<br>2,842,163,700 | 100.66<br>2,838,837,600 | 0.100000<br>2023/03/20   | 2.89            |
| 2 | 410 2年国債 | 日本 | 国債証券 | 2,000,000,000            | 100.44<br>2,008,960,000 | 100.42<br>2,008,500,000 | 0.100000<br>2022/03/01   | 2.04            |

|    |     |       |    |      |               |                         |                         |                        |      |
|----|-----|-------|----|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|------|
| 3  | 142 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 1,750,000,000 | 101.04<br>1,768,370,500 | 100.96<br>1,766,905,000 | 0.100000<br>2024/12/20 | 1.80 |
| 4  | 341 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,500,000,000 | 102.42<br>1,536,371,200 | 102.25<br>1,533,840,000 | 0.300000<br>2025/12/20 | 1.56 |
| 5  | 131 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 1,170,000,000 | 100.64<br>1,177,534,800 | 100.43<br>1,175,031,000 | 0.100000<br>2022/03/20 | 1.20 |
| 6  | 409 | 2年国債  | 日本 | 国債証券 | 1,100,000,000 | 100.69<br>1,107,601,000 | 100.41<br>1,104,554,000 | 0.100000<br>2022/02/01 | 1.12 |
| 7  | 342 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,080,000,000 | 101.58<br>1,097,131,600 | 101.20<br>1,093,046,400 | 0.100000<br>2026/03/20 | 1.11 |
| 8  | 117 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 900,000,000   | 120.94<br>1,088,510,800 | 120.11<br>1,081,035,000 | 2.100000<br>2030/03/20 | 1.10 |
| 9  | 349 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,050,000,000 | 101.99<br>1,070,937,000 | 101.39<br>1,064,605,500 | 0.100000<br>2027/12/20 | 1.08 |
| 10 | 357 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,000,000,000 | 101.06<br>1,010,643,400 | 100.80<br>1,008,030,000 | 0.100000<br>2029/12/20 | 1.03 |
| 11 | 347 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 950,000,000   | 101.62<br>965,449,500   | 101.36<br>962,996,000   | 0.100000<br>2027/06/20 | 0.98 |
| 12 | 136 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 950,000,000   | 101.13<br>960,814,000   | 100.73<br>956,935,000   | 0.100000<br>2023/06/20 | 0.97 |
| 13 | 343 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 920,000,000   | 101.85<br>937,045,400   | 101.26<br>931,601,200   | 0.100000<br>2026/06/20 | 0.95 |
| 14 | 141 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 920,000,000   | 101.18<br>930,904,500   | 100.95<br>928,776,800   | 0.100000<br>2024/09/20 | 0.94 |
| 15 | 334 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 900,000,000   | 103.50<br>931,527,000   | 102.91<br>926,217,000   | 0.600000<br>2024/06/20 | 0.94 |
| 16 | 138 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 900,000,000   | 101.03<br>909,351,600   | 100.80<br>907,218,000   | 0.100000<br>2023/12/20 | 0.92 |
| 17 | 132 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 880,000,000   | 100.71<br>886,292,000   | 100.48<br>884,250,400   | 0.100000<br>2022/06/20 | 0.90 |
| 18 | 345 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 850,000,000   | 101.79<br>865,235,500   | 101.30<br>861,067,000   | 0.100000<br>2026/12/20 | 0.88 |
| 19 | 139 | 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 850,000,000   | 101.12<br>859,523,500   | 100.85<br>857,301,500   | 0.100000<br>2024/03/20 | 0.87 |
| 20 | 344 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 820,000,000   | 101.72<br>834,166,600   | 101.28<br>830,520,600   | 0.100000<br>2026/09/20 | 0.84 |
| 21 | 147 | 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000   | 119.40<br>835,817,800   | 118.59<br>830,186,000   | 1.600000<br>2033/12/20 | 0.84 |
| 22 | 351 | 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 800,000,000   | 101.89<br>815,192,000   | 101.32<br>810,568,000   | 0.100000<br>2028/06/20 | 0.82 |

|    |           |    |      |             |                       |                       |                        |      |
|----|-----------|----|------|-------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 23 | 340 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 760,000,000 | 103.29<br>785,021,600 | 102.67<br>780,352,800 | 0.400000<br>2025/09/20 | 0.79 |
| 24 | 134 20年国債 | 日本 | 国債証券 | 650,000,000 | 119.98<br>779,905,900 | 119.48<br>776,626,500 | 1.800000<br>2032/03/20 | 0.79 |
| 25 | 355 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 760,000,000 | 101.44<br>771,006,400 | 100.98<br>767,501,200 | 0.100000<br>2029/06/20 | 0.78 |
| 26 | 353 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 750,000,000 | 101.73<br>763,009,500 | 101.19<br>758,925,000 | 0.100000<br>2028/12/20 | 0.77 |
| 27 | 333 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 103.31<br>723,213,000 | 102.72<br>719,089,000 | 0.600000<br>2024/03/20 | 0.73 |
| 28 | 346 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 101.91<br>713,426,000 | 101.35<br>709,464,000 | 0.100000<br>2027/03/20 | 0.72 |
| 29 | 335 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 690,000,000 | 103.21<br>712,183,500 | 102.65<br>708,298,800 | 0.500000<br>2024/09/20 | 0.72 |
| 30 | 137 5年国債  | 日本 | 国債証券 | 700,000,000 | 101.05<br>707,357,000 | 100.76<br>705,320,000 | 0.100000<br>2023/09/20 | 0.72 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 88.99% |
| 地方債証券     | 4.41%  |
| 特殊債券      | 3.36%  |
| 社債券       | 2.72%  |
| 合計        | 99.48% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (参考情報) 運用実績

## ●FW 日本債券インデックス

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 9,986円 |
| 純資産総額 | 332億円  |

| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | -0.4% |
| 3カ月間     | -0.6% |
| 6カ月間     | -1.0% |
| 1年間      | -1.8% |
| 3年間      | 1.6%  |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | -0.1% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 第1期   | 第2期   | 第3期   | 第4期   |  |  |  |  |
|-----|-------|-------|-------|-------|--|--|--|--|
|     | 17年6月 | 18年6月 | 19年6月 | 20年6月 |  |  |  |  |
| 分配金 | 0円    | 0円    | 0円    | 0円    |  |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数   | 比率       | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位10銘柄  | 利率(%) | 償還日        | 比率    |
|-------------|-------|----------|--------------|---|-------|------------|-------|
| 国内債券        | 350   | 99.4%    | 直接利回り(%)     | 135 5年国債  | 0.100 | 2023/03/20 | 2.9%  |
| 国内債券先物      | -     | -        | 最終利回り(%)     | 410 2年国債  | 0.100 | 2022/03/01 | 2.0%  |
| コール・ローン、その他 | -     | 0.6%     | 修正デュレーション    | 142 5年国債  | 0.100 | 2024/12/20 | 1.8%  |
| 合計          | 350   | 100.0%   | 残存年数         | 341 10年国債   | 0.300 | 2025/12/20 | 1.6%  |
| 債券種別構成      | 比率    | 格付別構成    | 比率           | 131 5年国債 <td>0.100</td> <td>2022/03/20</td> <td>1.2%</td> | 0.100 | 2022/03/20 | 1.2%  |
| 国債          | 88.7% | AAA      | 91.7%        | 409 2年国債  | 0.100 | 2022/02/01 | 1.1%  |
| 地方債         | 5.4%  | AA       | 3.8%         | 342 10年国債   | 0.100 | 2026/03/20 | 1.1%  |
| 事業債         | 3.3%  | A        | 2.3%         | 117 20年国債   | 2.100 | 2030/03/20 | 1.1%  |
| 政府保証債       | 1.7%  | BBB      | -            | 349 10年国債   | 0.100 | 2027/12/20 | 1.1%  |
| その他         | 0.3%  | BB以下・無格付 | 2.1%         | 357 10年国債   | 0.100 | 2029/12/20 | 1.0%  |
| 合計          |       | 99.4%    | 合計           | 100.0%  | 合計    |            | 14.9% |

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

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

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】(2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 88,549,389,413 | 99.91   |
| 内 日本                  | 88,549,389,413 | 99.91   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 82,864,849     | 0.09    |
| 純資産総額                 | 88,632,254,262 | 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6月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                            | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|--------------------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                                |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | 外国債券インデックス(為替<br>ヘッジあり)マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 82,981,341,405  | 1.0612<br>88,061,627,425 | 1.0671<br>88,549,389,413 | 99.91           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.91% |
| 合計        | 99.91% |

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

## ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 33,745,104,093        | 33,745,104,093        | 0.9710                     | 0.9710                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 61,154,884,176        | 61,154,884,176        | 0.9475                     | 0.9475                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 72,847,478,521        | 72,847,478,521        | 0.9905                     | 0.9905                     |
| 2019年6月末日               | 73,835,227,213        | -                     | 0.9958                     | -                          |
| 7月末日                    | 75,022,993,085        | -                     | 0.9997                     | -                          |
| 8月末日                    | 79,220,099,744        | -                     | 1.0304                     | -                          |
| 9月末日                    | 79,774,093,266        | -                     | 1.0223                     | -                          |
| 10月末日                   | 80,764,292,460        | -                     | 1.0092                     | -                          |
| 11月末日                   | 82,562,197,324        | -                     | 1.0083                     | -                          |
| 12月末日                   | 83,178,189,511        | -                     | 1.0016                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 87,318,510,584        | -                     | 1.0195                     | -                          |
| 2月末日                    | 91,323,109,533        | -                     | 1.0306                     | -                          |
| 3月末日                    | 92,601,705,585        | -                     | 1.0463                     | -                          |
| 4月末日                    | 88,171,929,443        | -                     | 1.0446                     | -                          |
| 5月末日                    | 87,276,606,137        | -                     | 1.0437                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 87,728,604,640        | 87,728,604,640        | 1.0451                     | 1.0451                     |
| 6月末日                    | 88,632,254,262        | -                     | 1.0507                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 2.9    |
| 第2計算期間 | 2.4    |
| 第3計算期間 | 4.5    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第4計算期間 | 5.5 |
|--------|-----|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)        | 解約数量(口)        |
|--------|----------------|----------------|
| 第1計算期間 | 37,021,440,339 | 2,368,454,114  |
| 第2計算期間 | 41,568,085,908 | 11,780,237,725 |
| 第3計算期間 | 27,255,813,662 | 18,253,054,308 |
| 第4計算期間 | 32,566,137,503 | 22,163,944,927 |

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## (1) 投資状況(2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | 112,159,071,805 | 97.80   |
| 内 ユーロ                 | 44,640,037,364  | 38.93   |
| 内 シンガポール              | 512,498,519     | 0.45    |
| 内 マレーシア               | 541,160,782     | 0.47    |
| 内 イスラエル               | 436,318,720     | 0.38    |
| 内 ノルウェー               | 168,819,833     | 0.15    |
| 内 スウェーデン              | 337,948,431     | 0.29    |
| 内 デンマーク               | 544,962,786     | 0.48    |
| 内 イギリス                | 7,400,735,998   | 6.45    |
| 内 ポーランド               | 588,165,296     | 0.51    |
| 内 カナダ                 | 2,221,097,959   | 1.94    |
| 内 アメリカ                | 51,676,471,671  | 45.06   |
| 内 メキシコ                | 747,968,461     | 0.65    |
| 内 オーストラリア             | 2,342,885,985   | 2.04    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 2,518,535,758   | 2.20    |
| 純資産総額                 | 114,677,607,563 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|------------|-----------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | 113,006,576,500 | 98.54   |
| 内 日本       | 113,006,576,500 | 98.54   |

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

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

(注3) 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6月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

|    | 銘柄名                                 | 地域   | 種類       | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------------|------|----------|--------------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|
| 1  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 31,700,000               | 101.20<br>3,456,444,756 | 101.20<br>3,456,444,756 | 1.125000<br>2021/09/30   | 3.01            |
| 2  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 22,750,000               | 102.64<br>2,515,793,644 | 102.62<br>2,515,425,981 | 1.750000<br>2022/02/28   | 2.19            |
| 3  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 20,990,000               | 102.02<br>2,307,211,988 | 101.95<br>2,305,628,964 | 2.125000<br>2021/06/30   | 2.01            |
| 4  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 16,720,000               | 103.57<br>1,865,867,349 | 103.56<br>1,865,579,123 | 1.750000<br>2022/09/30   | 1.63            |
| 5  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 15,000,000               | 103.42<br>1,671,451,425 | 103.45<br>1,671,968,577 | 1.625000<br>2022/11/15   | 1.46            |
| 6  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 13,946,000               | 102.55<br>1,540,977,065 | 102.49<br>1,540,045,489 | 2.000000<br>2021/11/15   | 1.34            |
| 7  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 12,905,000               | 108.53<br>1,508,998,418 | 108.57<br>1,509,651,899 | 2.750000<br>2023/11/15   | 1.32            |
| 8  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 12,580,000               | 108.67<br>1,472,893,263 | 108.84<br>1,475,224,498 | 2.500000<br>2024/05/15   | 1.29            |
| 9  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 12,200,000               | 107.60<br>1,414,337,672 | 107.69<br>1,415,573,234 | 2.125000<br>2024/07/31   | 1.23            |
| 10 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 11,310,000               | 107.18<br>1,306,115,826 | 107.25<br>1,306,968,804 | 2.500000<br>2023/08/15   | 1.14            |
| 11 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 10,700,000               | 109.97<br>1,267,823,123 | 110.21<br>1,270,612,943 | 2.250000<br>2025/11/15   | 1.11            |
| 12 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 11,000,000               | 104.78<br>1,241,801,543 | 104.81<br>1,242,168,936 | 2.000000<br>2023/02/15   | 1.08            |
| 13 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 11,020,000               | 104.47<br>1,240,438,115 | 104.54<br>1,241,269,221 | 1.750000<br>2023/05/15   | 1.08            |
| 14 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 10,500,000               | 109.10<br>1,234,317,384 | 109.21<br>1,235,459,967 | 2.750000<br>2024/02/15   | 1.08            |
| 15 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 7,500,000                | 129.75<br>1,048,501,438 | 131.35<br>1,061,381,755 | 2.875000<br>2043/05/15   | 0.93            |

|    |                                   |      |      |           |                         |                         |                        |      |
|----|-----------------------------------|------|------|-----------|-------------------------|-------------------------|------------------------|------|
| 16 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 9,020,000 | 108.38<br>1,053,272,316 | 108.62<br>1,055,633,826 | 2.000000<br>2025/08/15 | 0.92 |
| 17 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 8,470,000 | 111.45<br>1,017,073,044 | 111.81<br>1,020,349,127 | 2.250000<br>2027/02/15 | 0.89 |
| 18 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 7,800,000 | 120.61<br>1,013,631,495 | 121.06<br>1,017,371,150 | 3.125000<br>2028/11/15 | 0.89 |
| 19 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 8,300,000 | 108.71<br>972,130,478   | 108.92<br>974,088,868   | 2.125000<br>2025/05/15 | 0.85 |
| 20 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | ユーロ  | 国債証券 | 6,770,000 | 112.30<br>920,601,703   | 112.37<br>921,150,910   | 5.500000<br>2022/11/01 | 0.80 |
| 21 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 7,810,000 | 108.53<br>913,300,764   | 108.71<br>914,806,958   | 2.250000<br>2024/11/15 | 0.80 |
| 22 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000 | 102.73<br>885,484,892   | 102.67<br>884,941,883   | 1.875000<br>2022/01/31 | 0.77 |
| 23 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 6,900,000 | 109.95<br>817,397,199   | 110.57<br>822,043,486   | 1.750000<br>2029/11/15 | 0.72 |
| 24 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000 | 106.64<br>804,257,552   | 106.83<br>805,728,203   | 1.875000<br>2024/08/31 | 0.70 |
| 25 | GERMAN GOVERNMENT BOND            | ユーロ  | 国債証券 | 6,100,000 | 108.78<br>803,458,184   | 108.96<br>804,831,957   | 1.000000<br>2025/08/15 | 0.70 |
| 26 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 5,040,000 | 135.39<br>735,202,417   | 137.16<br>744,813,687   | 3.125000<br>2044/08/15 | 0.65 |
| 27 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 4,750,000 | 140.85<br>720,826,120   | 141.25<br>722,868,062   | 6.125000<br>2027/11/15 | 0.63 |
| 28 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 4,980,000 | 132.04<br>708,465,012   | 133.72<br>717,500,434   | 2.875000<br>2046/11/15 | 0.63 |
| 29 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 5,850,000 | 109.59<br>690,741,664   | 109.89<br>692,664,015   | 2.000000<br>2026/11/15 | 0.60 |
| 30 | United States Treasury Note/Bond  | アメリカ | 国債証券 | 6,000,000 | 106.73<br>689,971,269   | 107.06<br>692,091,592   | 1.625000<br>2026/02/15 | 0.60 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 97.80% |
| 合計        | 97.80% |

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

#### 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/<br>売建   | 数量          | 簿価             | 時価             | 投資<br>比率 |
|------------------------|----|------------------------------|-------------|-------------|----------------|----------------|----------|
| 為替予約取引                 | 日本 | 豪ドル売/円買 2020年7月              | 売建          | 32,223,000  | 2,352,923,460  | 2,380,313,010  | 2.08%    |
|                        |    | カナダ・ドル売/円買<br>2020年7月        | 売建          | 28,238,000  | 2,220,353,940  | 2,224,872,020  | 1.94%    |
|                        |    | デンマーク・クローネ<br>売/円買 2020年7月   | 売建          | 33,469,000  | 541,871,079    | 543,871,250    | 0.47%    |
|                        |    | ユーロ売/円買 2020年7月              | 売建          | 372,293,000 | 44,928,319,240 | 45,077,236,440 | 39.31%   |
|                        |    | 英ポンド売/円買 2020年<br>7月         | 売建          | 56,651,000  | 7,596,332,590  | 7,506,257,500  | 6.55%    |
|                        |    | イスラエル・シェケル<br>売/円買 2020年7月   | 売建          | 14,519,000  | 447,765,960    | 452,847,610    | 0.39%    |
|                        |    | 米ドル売/円買 2020年7月              | 売建          | 482,058,000 | 51,671,797,020 | 51,932,108,340 | 45.29%   |
|                        |    | マレーシア・リングギット<br>売/円買 2020年7月 | 売建          | 20,180,000  | 504,730,052    | 506,518,000    | 0.44%    |
|                        |    | ノルウェー・クローネ<br>売/円買 2020年7月   | 売建          | 15,656,000  | 173,155,360    | 174,251,280    | 0.15%    |
|                        |    | ポーランド・ズロチ売/<br>円買 2020年7月    | 売建          | 22,260,000  | 603,246,000    | 604,804,200    | 0.53%    |
|                        |    | スウェーデン・クローネ<br>売/円買 2020年7月  | 売建          | 29,173,000  | 334,906,040    | 336,948,150    | 0.29%    |
|                        |    | シンガポール・ドル売/<br>円買 2020年7月    | 売建          | 6,741,000   | 517,868,420    | 521,079,300    | 0.45%    |
| メキシコ・ペソ売/円買<br>2020年7月 | 売建 | 160,316,000                  | 759,897,840 | 745,469,400 | 0.65%          |                |          |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## （参考情報）運用実績

## ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 10,507円 |
| 純資産総額 | 886億円   |

| 基準価額の騰落率 |      |
|----------|------|
| 期間       | ファンド |
| 1カ月間     | 0.7% |
| 3カ月間     | 0.4% |
| 6カ月間     | 4.9% |
| 1年間      | 5.5% |
| 3年間      | 9.3% |
| 5年間      | -    |
| 設定来      | 5.1% |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

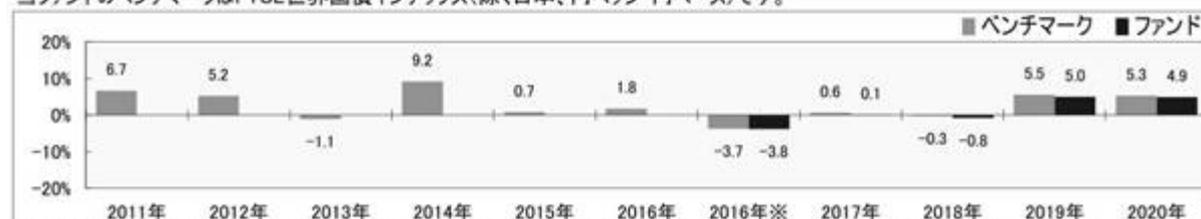
| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位10銘柄                         | 償還日        | 比率    |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|--------------|----------------------------------|------------|-------|
| 外国債券        | 470 | 97.7%  | 日本円         | 99.3%  | 直接利回り(%)     | United States Treasury Note/Bond | 2021/09/30 | 3.0%  |
|             |     |        | ユーロ         | 0.4%   | 最終利回り(%)     | United States Treasury Note/Bond | 2022/02/28 | 2.2%  |
| コール・ローン、その他 |     | 2.3%   | 米ドル         | 0.1%   | 修正デュレーション    | United States Treasury Note/Bond | 2021/06/30 | 2.0%  |
| 合計          | 470 | 100.0% | マレーシア・リンギット | 0.0%   | 残存年数         | United States Treasury Note/Bond | 2022/09/30 | 1.6%  |
| 債券種別構成      |     |        | 英ポンド        | 0.0%   | 格付別構成        | United States Treasury Note/Bond | 2022/11/15 | 1.5%  |
| 国債          |     | 97.7%  | カナダ・ドル      | 0.0%   | AAA          | United States Treasury Note/Bond | 2021/11/15 | 1.3%  |
|             |     |        | メキシコ・ペソ     | 0.0%   | AA           | United States Treasury Note/Bond | 2023/11/15 | 1.3%  |
|             |     |        | デンマーク・クローネ  | 0.0%   | A            | United States Treasury Note/Bond | 2024/05/15 | 1.3%  |
|             |     |        | スウェーデン・クローネ | 0.0%   | BBB          | United States Treasury Note/Bond | 2024/07/31 | 1.2%  |
|             |     |        | その他         | -0.0%  | BB           | United States Treasury Note/Bond | 2023/08/15 | 1.1%  |
| 合計          |     | 97.7%  | 合計          | 100.0% | 合計           | 合計                               |            | 16.6% |

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 5,079,294,152 | 99.91   |
| 内 日本                  | 5,079,294,152 | 99.91   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 4,751,679     | 0.09    |
| 純資産総額                 | 5,084,045,831 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                   | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------|----|-------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
|   |                       |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                         |                         |                 |
| 1 | 外国債券インデックスマザー<br>ファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 1,701,891,155   | 2.9587<br>5,035,403,530 | 2.9845<br>5,079,294,152 | 99.91           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.91% |
| 合計        | 99.91% |

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 1,404,884,490         | 1,404,884,490         | 1.0622                     | 1.0622                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 2,405,883,300         | 2,405,883,300         | 1.0709                     | 1.0709                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 3,676,403,565         | 3,676,403,565         | 1.0978                     | 1.0978                     |
| 2019年6月末日               | 3,721,753,676         | -                     | 1.1029                     | -                          |
| 7月末日                    | 3,796,636,214         | -                     | 1.1058                     | -                          |
| 8月末日                    | 3,931,392,400         | -                     | 1.1127                     | -                          |
| 9月末日                    | 4,025,224,729         | -                     | 1.1177                     | -                          |
| 10月末日                   | 3,931,721,436         | -                     | 1.1282                     | -                          |
| 11月末日                   | 4,110,309,579         | -                     | 1.1284                     | -                          |
| 12月末日                   | 4,390,509,126         | -                     | 1.1332                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 4,670,317,395         | -                     | 1.1418                     | -                          |
| 2月末日                    | 5,104,491,150         | -                     | 1.1549                     | -                          |
| 3月末日                    | 5,104,597,989         | -                     | 1.1561                     | -                          |
| 4月末日                    | 4,733,763,757         | -                     | 1.1336                     | -                          |
| 5月末日                    | 4,848,545,642         | -                     | 1.1498                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 4,949,959,877         | 4,949,959,877         | 1.1579                     | 1.1579                     |
| 6月末日                    | 5,084,045,831         | -                     | 1.1677                     | -                          |

【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 6.2    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第2計算期間 | 0.8 |
| 第3計算期間 | 2.5 |
| 第4計算期間 | 5.5 |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)       |
|--------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 1,394,396,399 | 72,737,713    |
| 第2計算期間 | 1,454,615,593 | 530,660,407   |
| 第3計算期間 | 1,649,381,625 | 547,264,585   |
| 第4計算期間 | 2,078,908,391 | 1,152,538,780 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | 194,006,139,067 | 98.20   |
| 内 ユーロ                 | 77,619,911,314  | 39.29   |
| 内 シンガポール              | 849,027,800     | 0.43    |
| 内 マレーシア               | 969,897,926     | 0.49    |
| 内 イスラエル               | 739,376,948     | 0.37    |
| 内 ノルウェー               | 398,315,812     | 0.20    |
| 内 スウェーデン              | 539,918,987     | 0.27    |
| 内 デンマーク               | 995,782,812     | 0.50    |
| 内 イギリス                | 12,713,658,521  | 6.44    |
| 内 ポーランド               | 1,144,670,898   | 0.58    |
| 内 カナダ                 | 3,683,093,197   | 1.86    |
| 内 アメリカ                | 88,747,421,341  | 44.92   |
| 内 メキシコ                | 1,498,493,034   | 0.76    |
| 内 オーストラリア             | 4,106,570,477   | 2.08    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 3,560,744,473   | 1.80    |
| 純資産総額                 | 197,566,883,540 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 2,921,292,790 | 1.48    |

|      |               |      |
|------|---------------|------|
| 内 日本 | 2,921,292,790 | 1.48 |
|------|---------------|------|

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

|    | 銘柄名                                 | 地域   | 種類       | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|-------------------------------------|------|----------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,700,000                | 108.99<br>786,767,471 | 118.57<br>855,964,779 | 2.875000<br>2028/08/15   | 0.43            |
| 2  | FRENCH<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 3,764,000                | 182.46<br>831,597,815 | 184.10<br>839,026,765 | 4.500000<br>2041/04/25   | 0.42            |
| 3  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,600,000                | 107.23<br>762,523,816 | 117.36<br>834,577,958 | 2.625000<br>2029/02/15   | 0.42            |
| 4  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,500,000                | 108.81<br>762,021,317 | 118.17<br>827,563,330 | 2.875000<br>2028/05/15   | 0.42            |
| 5  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,900,000                | 98.53<br>732,544,838  | 109.28<br>812,401,510 | 1.625000<br>2029/08/15   | 0.41            |
| 6  | GERMAN<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 6,200,000                | 106.12<br>796,709,184 | 106.28<br>797,892,257 | 0.250000<br>2027/02/15   | 0.40            |
| 7  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,400,000                | 105.45<br>727,123,829 | 112.98<br>779,065,354 | 2.375000<br>2027/05/15   | 0.39            |
| 8  | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,450,000                | 99.94<br>694,569,273  | 110.57<br>768,431,954 | 1.750000<br>2029/11/15   | 0.39            |
| 9  | GERMAN<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 3,571,000                | 172.39<br>745,395,307 | 172.62<br>746,390,243 | 4.000000<br>2037/01/04   | 0.38            |
| 10 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,668,000                | 100.04<br>718,712,052 | 103.45<br>743,245,764 | 1.625000<br>2022/11/15   | 0.38            |
| 11 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,140,000                | 103.96<br>687,761,910 | 111.81<br>739,662,767 | 2.250000<br>2027/02/15   | 0.37            |
| 12 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,162,000                | 103.32<br>685,988,268 | 108.81<br>722,396,208 | 2.375000<br>2024/08/15   | 0.37            |
| 13 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 4,520,000                | 125.03<br>608,881,965 | 147.65<br>719,062,276 | 3.375000<br>2048/11/15   | 0.36            |
| 14 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,900,000                | 103.71<br>659,300,061 | 112.44<br>714,774,633 | 2.250000<br>2027/08/15   | 0.36            |

|    |                                     |      |          |           |                       |                       |                        |      |
|----|-------------------------------------|------|----------|-----------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 15 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,650,000 | 107.65<br>655,335,445 | 116.79<br>710,973,458 | 2.750000<br>2028/02/15 | 0.36 |
| 16 | GERMAN<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 5,730,000 | 102.17<br>708,879,980 | 102.05<br>708,073,503 | -<br>2023/04/14        | 0.36 |
| 17 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 6,287,000 | 101.11<br>684,927,506 | 104.42<br>707,307,526 | 2.000000<br>2022/11/30 | 0.36 |
| 18 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 4,700,000 | 117.11<br>593,034,877 | 138.70<br>702,361,477 | 3.000000<br>2049/02/15 | 0.36 |
| 19 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,921,000 | 102.85<br>656,115,882 | 108.71<br>693,543,150 | 2.250000<br>2024/11/15 | 0.35 |
| 20 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,840,000 | 103.11<br>648,813,813 | 110.21<br>693,493,419 | 2.250000<br>2025/11/15 | 0.35 |
| 21 | GERMAN<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 3,448,000 | 165.72<br>691,891,860 | 164.46<br>686,598,098 | 5.500000<br>2031/01/04 | 0.35 |
| 22 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 4,650,000 | 114.37<br>573,008,456 | 135.94<br>681,072,214 | 2.875000<br>2049/05/15 | 0.34 |
| 23 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,788,000 | 102.32<br>638,116,507 | 108.92<br>679,280,285 | 2.125000<br>2025/05/15 | 0.34 |
| 24 | FRENCH<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 5,250,000 | 105.66<br>671,676,467 | 106.73<br>678,495,087 | 0.500000<br>2029/05/25 | 0.34 |
| 25 | FRENCH<br>GOVERNMENT BOND           | ユーロ  | 国債<br>証券 | 4,387,000 | 126.39<br>671,390,052 | 126.88<br>673,958,595 | 2.500000<br>2030/05/25 | 0.34 |
| 26 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,743,000 | 101.75<br>629,622,271 | 108.62<br>672,118,078 | 2.000000<br>2025/08/15 | 0.34 |
| 27 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,500,000 | 103.78<br>614,975,071 | 112.78<br>668,306,371 | 2.250000<br>2027/11/15 | 0.34 |
| 28 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 5,743,000 | 101.71<br>629,380,959 | 107.99<br>668,201,385 | 2.000000<br>2025/02/15 | 0.34 |
| 29 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 4,900,000 | 111.23<br>587,233,206 | 121.06<br>639,117,774 | 3.125000<br>2028/11/15 | 0.32 |
| 30 | United States Treasury<br>Note/Bond | アメリカ | 国債<br>証券 | 4,200,000 | 119.31<br>539,896,344 | 140.78<br>637,045,287 | 3.125000<br>2048/05/15 | 0.32 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 98.20% |
| 合計        | 98.20% |

(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/<br>売建   | 数量          | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|----------------------|----|-----------------------------|-------------|-------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引               | 日本 | 豪ドル買/円売 2020年8月             | 買建          | 349,000     | 25,820,276    | 25,777,140    | 0.01%    |
|                      |    | 豪ドル買/円売 2020年7月             | 買建          | 305,000     | 22,458,705    | 22,530,350    | 0.01%    |
|                      |    | カナダ・ドル買/円売<br>2020年8月       | 買建          | 490,000     | 38,613,053    | 38,597,300    | 0.02%    |
|                      |    | デンマーク・クローネ<br>買/円売 2020年7月  | 買建          | 748,000     | 12,081,696    | 12,155,000    | 0.01%    |
|                      |    | ユーロ買/円売 2020年7月             | 買建          | 13,975,000  | 1,679,913,825 | 1,692,093,000 | 0.86%    |
|                      |    | 英ポンド買/円売 2020年<br>8月        | 買建          | 326,000     | 43,185,356    | 43,185,220    | 0.02%    |
|                      |    | 米ドル買/円売 2020年8<br>月         | 買建          | 2,689,000   | 289,660,881   | 289,578,410   | 0.15%    |
|                      |    | メキシコ・ペソ買/円売<br>2020年7月      | 買建          | 12,451,000  | 59,912,376    | 57,897,150    | 0.03%    |
|                      |    | ノルウェー・クローネ<br>買/円売 2020年8月  | 買建          | 983,000     | 10,936,759    | 10,940,790    | 0.01%    |
|                      |    | ポーランド・ズロチ買/<br>円売 2020年7月   | 買建          | 456,000     | 12,270,595    | 12,389,520    | 0.01%    |
|                      |    | スウェーデン・クローネ<br>買/円売 2020年8月 | 買建          | 2,137,000   | 24,668,547    | 24,682,350    | 0.01%    |
|                      |    | シンガポール・ドル買/<br>円売 2020年7月   | 買建          | 268,000     | 20,422,136    | 20,716,400    | 0.01%    |
| 米ドル買/円売 2020年7<br>月  | 買建 | 5,642,000                   | 605,854,696 | 607,812,660 | 0.31%         |               |          |
| 英ポンド買/円売 2020年<br>7月 | 買建 | 475,000                     | 62,902,825  | 62,937,500  | 0.03%         |               |          |

- (注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
- (注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
- (注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,677円 |
| 純資産総額 | 50億円    |



| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 1.6%  |
| 3カ月間     | 1.0%  |
| 6カ月間     | 3.0%  |
| 1年間      | 5.9%  |
| 3年間      | 7.7%  |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 16.8% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位10銘柄                         | 償還日        | 比率   |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|--------------|----------------------------------|------------|------|
| 外国債券        | 787 | 98.1%  | 米ドル         | 45.4%  | 直接利回り(%)     | United States Treasury Note/Bond | 2028/08/15 | 0.4% |
|             |     |        | ユーロ         | 40.3%  | 最終利回り(%)     | FRENCH GOVERNMENT BOND           | 2041/04/25 | 0.4% |
|             |     |        | 英ポンド        | 6.5%   | 修正デュレーション    | United States Treasury Note/Bond | 2029/02/15 | 0.4% |
| コール・ローン、その他 |     | 1.9%   | 豪ドル         | 2.2%   | 残存年数         | United States Treasury Note/Bond | 2028/05/15 | 0.4% |
| 合計          | 787 | 100.0% | カナダ・ドル      | 1.9%   | 格付別構成        | United States Treasury Note/Bond | 2029/08/15 | 0.4% |
| 債券種別構成      |     |        | メキシコ・ペソ     | 0.8%   | AAA          | GERMAN GOVERNMENT BOND           | 2027/02/15 | 0.4% |
| 国債          |     | 98.1%  | ポーランド・ズロチ   | 0.6%   | AA           | United States Treasury Note/Bond | 2027/05/15 | 0.4% |
|             |     |        | デンマーク・クローネ  | 0.5%   | A            | United States Treasury Note/Bond | 2029/11/15 | 0.4% |
|             |     |        | マレーシア・リンギット | 0.5%   | BBB          | GERMAN GOVERNMENT BOND           | 2037/01/04 | 0.4% |
|             |     |        | その他         | 1.3%   | BB           | United States Treasury Note/Bond | 2022/11/15 | 0.4% |
| 合計          |     | 98.1%  | 合計          | 100.0% | 合計           | 合計                               |            | 4.0% |

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 1,725,294,786 | 99.91   |
| 内 日本                  | 1,725,294,786 | 99.91   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,613,117     | 0.09    |
| 純資産総額                 | 1,726,907,903 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                        | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|----------------------------|----|-------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
|   |                            |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                         |                         |                 |
| 1 | 外国債券インデックスマザー<br>ファンド      | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 462,829,145     | 2.9588<br>1,369,420,015 | 2.9845<br>1,381,313,583 | 79.99           |
| 2 | ダイワ新興国債券インデック<br>ス・マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 256,338,925     | 1.3480<br>345,545,337   | 1.3419<br>343,981,203   | 19.92           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.91% |
| 合計        | 99.91% |

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 599,181,409           | 599,181,409           | 1.0747                     | 1.0747                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 1,195,532,865         | 1,195,532,865         | 1.0746                     | 1.0746                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 1,344,487,088         | 1,344,487,088         | 1.1026                     | 1.1026                     |
| 2019年6月末日               | 1,350,671,382         | -                     | 1.1107                     | -                          |
| 7月末日                    | 1,391,845,891         | -                     | 1.1168                     | -                          |
| 8月末日                    | 1,390,379,481         | -                     | 1.1117                     | -                          |
| 9月末日                    | 1,387,270,430         | -                     | 1.1216                     | -                          |
| 10月末日                   | 1,436,702,461         | -                     | 1.1386                     | -                          |
| 11月末日                   | 1,486,014,034         | -                     | 1.1353                     | -                          |
| 12月末日                   | 1,578,444,227         | -                     | 1.1477                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 1,671,819,162         | -                     | 1.1518                     | -                          |
| 2月末日                    | 1,787,803,918         | -                     | 1.1579                     | -                          |
| 3月末日                    | 1,740,975,199         | -                     | 1.1275                     | -                          |
| 4月末日                    | 1,666,685,655         | -                     | 1.1143                     | -                          |
| 5月末日                    | 1,702,206,576         | -                     | 1.1407                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 1,706,986,677         | 1,706,986,677         | 1.1508                     | 1.1508                     |
| 6月末日                    | 1,726,907,903         | -                     | 1.1575                     | -                          |

【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 7.5    |

|        |     |
|--------|-----|
| 第2計算期間 | 0.0 |
| 第3計算期間 | 2.6 |
| 第4計算期間 | 4.4 |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)     | 解約数量(口)     |
|--------|-------------|-------------|
| 第1計算期間 | 571,935,222 | 15,390,972  |
| 第2計算期間 | 683,181,594 | 128,182,978 |
| 第3計算期間 | 364,448,905 | 257,568,148 |
| 第4計算期間 | 564,211,268 | 300,318,547 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

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

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類   | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------|----------------|---------|
| 国債証券      | 15,078,710,496 | 95.28   |
| 内 中国      | 455,797,288    | 2.88    |
| 内 タイ      | 1,441,979,417  | 9.11    |
| 内 マレーシア   | 1,071,077,871  | 6.77    |
| 内 フィリピン   | 26,761,320     | 0.17    |
| 内 インドネシア  | 1,534,499,690  | 9.70    |
| 内 ポーランド   | 1,262,622,298  | 7.98    |
| 内 ロシア     | 1,347,651,290  | 8.52    |
| 内 ハンガリー   | 550,949,514    | 3.48    |
| 内 ルーマニア   | 430,620,690    | 2.72    |
| 内 トルコ     | 449,257,488    | 2.84    |
| 内 チェコ     | 687,489,551    | 4.34    |
| 内 メキシコ    | 1,439,070,795  | 9.09    |
| 内 ドミニカ共和国 | 18,266,600     | 0.12    |
| 内 コロンビア   | 834,322,115    | 5.27    |

|                       |                |        |
|-----------------------|----------------|--------|
| 内 ペルー                 | 537,325,115    | 3.40   |
| 内 チリ                  | 364,080,335    | 2.30   |
| 内 ブラジル                | 1,479,139,689  | 9.35   |
| 内 ウルグアイ               | 20,074,660     | 0.13   |
| 内 南アフリカ               | 1,127,724,770  | 7.13   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 747,223,899    | 4.72   |
| 純資産総額                 | 15,825,934,395 | 100.00 |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価(円)       | 投資比率(%) |
|------------|-------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 445,682,908 | 2.82    |
| 内 日本       | 445,682,908 | 2.82    |
| 為替予約取引(売建) | 39,715,000  | 0.25    |
| 内 日本       | 39,715,000  | 0.25    |

(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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名  | 地域        | 種類       | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)     | 評価単価<br>時価<br>(円)     | 利率(%)<br>償還期限<br>(年/月/日) | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|--|-----------|----------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------|
| 1 | Brazil Notas do<br>Tesouro Nacional Serie<br>F | ブラジル      | 国債証<br>券 | 13,310,000               | 110.92<br>294,242,787 | 113.57<br>301,267,860 | 10.000000<br>2023/01/01  | 1.90            |
| 2 | Brazil Notas do<br>Tesouro Nacional Serie<br>F | ブラジル      | 国債証<br>券 | 9,490,000                | 113.67<br>215,001,430 | 116.93<br>221,167,722 | 10.000000<br>2025/01/01  | 1.40            |
| 3 | Brazil Letras do<br>Tesouro Nacional           | ブラジル      | 国債証<br>券 | 12,700,000               | 80.04<br>202,607,349  | 87.21<br>220,748,227  | -<br>2023/07/01          | 1.39            |
| 4 | REPUBLIC OF SOUTH<br>AFRICA                    | 南アフリ<br>カ | 国債証<br>券 | 30,050,000               | 112.86<br>211,291,678 | 114.31<br>214,001,465 | 10.500000<br>2026/12/21  | 1.35            |
| 5 | Brazil Notas do<br>Tesouro Nacional Serie<br>F | ブラジル      | 国債証<br>券 | 7,250,000                | 116.13<br>167,802,854 | 118.32<br>170,966,415 | 10.000000<br>2027/01/01  | 1.08            |

|    |  |       |      |               |                       |                       |                         |      |
|----|--|-------|------|---------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|------|
| 6  | Mexican Bonos                            | メキシコ  | 国債証券 | 30,730,000    | 110.64<br>158,445,144 | 118.28<br>169,389,113 | 8.500000<br>2029/05/31  | 1.07 |
| 7  | Poland Government Bond                   | ポーランド | 国債証券 | 5,400,000     | 105.39<br>154,692,958 | 110.89<br>162,762,809 | 2.750000<br>2028/04/25  | 1.03 |
| 8  | Mexican Bonos                            | メキシコ  | 国債証券 | 30,230,000    | 101.50<br>142,998,046 | 111.33<br>156,845,253 | 7.500000<br>2027/06/03  | 0.99 |
| 9  | Mexican Bonos                            | メキシコ  | 国債証券 | 31,450,000    | 99.73<br>146,165,138  | 103.41<br>151,567,783 | 6.500000<br>2022/06/09  | 0.96 |
| 10 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA                 | 南アフリカ | 国債証券 | 29,520,000    | 89.20<br>164,053,001  | 79.50<br>146,208,132  | 8.750000<br>2048/02/28  | 0.92 |
| 11 | Colombian TES                            | コロンビア | 国債証券 | 4,310,000,000 | 111.76<br>138,250,000 | 113.19<br>140,015,108 | 7.500000<br>2026/08/26  | 0.88 |
| 12 | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | ブラジル  | 国債証券 | 7,200,000     | 86.26<br>123,781,084  | 95.65<br>137,263,968  | -<br>2022/01/01         | 0.87 |
| 13 | Poland Government Bond                   | ポーランド | 国債証券 | 4,450,000     | 106.02<br>128,234,791 | 112.32<br>135,854,582 | 2.750000<br>2029/10/25  | 0.86 |
| 14 | Mexican Bonos                            | メキシコ  | 国債証券 | 24,150,000    | 113.55<br>127,793,451 | 120.24<br>135,324,771 | 10.000000<br>2024/12/05 | 0.86 |
| 15 | Colombian TES                            | コロンビア | 国債証券 | 4,335,000,000 | 106.12<br>132,031,155 | 106.80<br>132,878,418 | 7.000000<br>2022/05/04  | 0.84 |
| 16 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA                 | 南アフリカ | 国債証券 | 22,900,000    | 93.90<br>133,971,005  | 92.70<br>132,253,735  | 8.000000<br>2030/01/31  | 0.84 |
| 17 | Colombian TES                            | コロンビア | 国債証券 | 3,650,000,000 | 121.69<br>127,486,146 | 122.80<br>128,642,282 | 10.000000<br>2024/07/24 | 0.81 |
| 18 | Thailand Government Bond                 | タイ    | 国債証券 | 29,000,000    | 118.38<br>119,821,285 | 124.79<br>126,304,007 | 3.775000<br>2032/06/25  | 0.80 |
| 19 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル  | 国債証券 | 5,100,000     | 119.78<br>121,749,627 | 119.87<br>121,847,595 | 10.000000<br>2029/01/01 | 0.77 |
| 20 | Colombian TES                            | コロンビア | 国債証券 | 4,090,000,000 | 101.94<br>119,666,570 | 101.14<br>118,721,166 | 6.000000<br>2028/04/28  | 0.75 |
| 21 | Thailand Government Bond                 | タイ    | 国債証券 | 26,050,000    | 125.49<br>114,090,858 | 130.19<br>118,366,133 | 4.875000<br>2029/06/22  | 0.75 |
| 22 | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | ブラジル  | 国債証券 | 6,030,000     | 89.82<br>107,950,899  | 97.66<br>117,371,746  | -<br>2021/07/01         | 0.74 |
| 23 | Poland Government Bond                   | ポーランド | 国債証券 | 4,230,000     | 100.49<br>115,537,423 | 101.87<br>117,123,664 | 1.750000<br>2021/07/25  | 0.74 |
| 24 | Mexican Bonos                            | メキシコ  | 国債証券 | 22,750,000    | 103.15<br>109,355,306 | 110.25<br>116,882,597 | 8.000000<br>2023/12/07  | 0.74 |

|    |                                   |       |      |            |                       |                       |                        |      |
|----|-----------------------------------|-------|------|------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|------|
| 25 | Mexican Bonos                     | メキシコ  | 国債証券 | 22,000,000 | 104.75<br>107,391,138 | 111.87<br>114,697,325 | 8.000000<br>2024/09/05 | 0.72 |
| 26 | Brazil Letras do Tesouro Nacional | ブラジル  | 国債証券 | 6,100,000  | 84.79<br>103,092,142  | 93.14<br>113,241,602  | -<br>2022/07/01        | 0.72 |
| 27 | Thailand Government Bond          | タイ    | 国債証券 | 30,600,000 | 104.64<br>111,757,785 | 104.65<br>111,763,124 | 3.650000<br>2021/12/17 | 0.71 |
| 28 | Poland Government Bond            | ポーランド | 国債証券 | 3,740,000  | 103.33<br>105,043,410 | 108.98<br>110,781,657 | 2.500000<br>2026/07/25 | 0.70 |
| 29 | Poland Government Bond            | ポーランド | 国債証券 | 3,610,000  | 111.80<br>109,704,750 | 112.53<br>110,420,098 | 5.750000<br>2022/09/23 | 0.70 |
| 30 | Poland Government Bond            | ポーランド | 国債証券 | 3,550,000  | 107.52<br>103,747,949 | 112.39<br>108,450,741 | 3.250000<br>2025/07/25 | 0.69 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 国債証券      | 95.28% |
| 合計        | 95.28% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

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/<br>売建 | 数量         | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|--------|----|-----------------------------|-----------|------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | オフショア人民元買/<br>円売 2020年7月    | 買建        | 11,700,000 | 178,352,694 | 178,074,000 | 1.13%    |
|        |    | ルーマニア・レイ買/<br>円売 2020年7月    | 買建        | 1,195,000  | 29,580,142  | 29,839,150  | 0.19%    |
|        |    | チェコ・コルナ買/円<br>売 2020年7月     | 買建        | 10,401,000 | 46,427,715  | 47,012,520  | 0.30%    |
|        |    | ハンガリー・フォリン<br>ト買/円売 2020年7月 | 買建        | 19,364,000 | 6,675,437   | 6,562,458   | 0.04%    |

|                            |    |               |            |            |       |
|----------------------------|----|---------------|------------|------------|-------|
| メキシコ・ペソ買/円<br>売 2020年7月    | 買建 | 11,000,000    | 52,154,700 | 51,150,000 | 0.32% |
| 南アフリカ・ランド<br>買/円売 2020年7月  | 買建 | 1,828,000     | 11,338,573 | 11,370,160 | 0.07% |
| ポーランド・ズロチ<br>買/円売 2020年7月  | 買建 | 3,511,000     | 95,126,723 | 95,393,870 | 0.60% |
| トルコ・リラ買/円売<br>2020年7月      | 買建 | 1,675,000     | 26,233,586 | 26,280,750 | 0.17% |
| インドネシア・ルピア<br>売/円買 2020年7月 | 売建 | 2,700,000,000 | 20,169,000 | 20,520,000 | 0.13% |
| タイ・バーツ売/円買<br>2020年7月      | 売建 | 5,500,000     | 19,181,800 | 19,195,000 | 0.12% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,575円 |
| 純資産総額 | 17億円    |



| 基準価額の騰落率 |       |
|----------|-------|
| 期間       | ファンド  |
| 1カ月間     | 1.5%  |
| 3カ月間     | 2.7%  |
| 6カ月間     | 0.9%  |
| 1年間      | 4.2%  |
| 3年間      | 5.8%  |
| 5年間      | -     |
| 設定来      | 15.8% |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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<br>17年6月 | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |  |  |  |  |  |
|-----|--------------|--------------|--------------|--------------|--|--|--|--|--|
| 分配金 | 0円           | 0円           | 0円           | 0円           |  |  |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

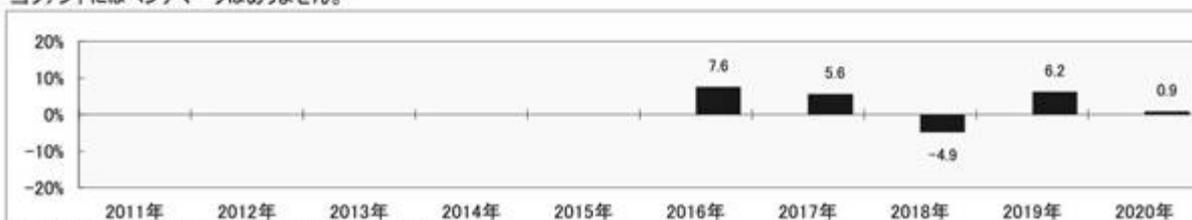
| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | 債券ポートフォリオ特性値 | 組入上位10銘柄                                 | 償還日        | 比率   |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|--------------|--|------------|------|
| 外国債券        | 963 | 97.5%  | 米ドル         | 36.4%  | 直接利回り(%)     | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 2023/01/01 | 0.4% |
|             |     |        | ユーロ         | 32.2%  | 最終利回り(%)     | United States Treasury Note/Bond         | 2028/08/15 | 0.3% |
| コール・ローン、その他 |     | 2.5%   | 英ポンド        | 5.2%   | 修正デュレーション    | FRENCH GOVERNMENT BOND                   | 2041/04/25 | 0.3% |
| 合計          | 963 | 100.0% | メキシコ・ペソ     | 2.6%   | 残存年数         | United States Treasury Note/Bond         | 2029/02/15 | 0.3% |
| 債券種別構成      |     |        | ポーランド・ズロチ   | 2.2%   | 格付別構成        | United States Treasury Note/Bond         | 2028/05/15 | 0.3% |
| 国債          |     | 97.5%  | インドネシア・ルピア  | 2.0%   | AAA          | United States Treasury Note/Bond         | 2029/08/15 | 0.3% |
|             |     |        | ブラジル・レアル    | 1.9%   | AA           | GERMAN GOVERNMENT BOND                   | 2027/02/15 | 0.3% |
|             |     |        | タイ・バーツ      | 1.8%   | A            | United States Treasury Note/Bond         | 2027/05/15 | 0.3% |
|             |     |        | マレーシア・リンギット | 1.8%   | BBB          | United States Treasury Note/Bond         | 2029/11/15 | 0.3% |
|             |     |        | その他         | 13.9%  | BB           | GERMAN GOVERNMENT BOND                   | 2037/01/04 | 0.3% |
| 合計          |     | 97.5%  | 合計          | 100.0% | 合計           | 合計                                       |            | 3.3% |

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 4,218,707,959 | 99.95   |
| 内 日本                  | 4,218,707,959 | 99.95   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 2,123,424     | 0.05    |
| 純資産総額                 | 4,220,831,383 | 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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名              | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|------------------|----|-------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
|   |                  |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                         |                         |                 |
| 1 | ダイワJ-REITマザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 1,614,260,335   | 2.5579<br>4,129,143,718 | 2.6134<br>4,218,707,959 | 99.95           |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 1,224,211,506         | 1,224,211,506         | 0.9906                     | 0.9906                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 2,355,374,969         | 2,355,374,969         | 1.0250                     | 1.0250                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 3,254,479,810         | 3,254,479,810         | 1.1818                     | 1.1818                     |
| 2019年6月末日               | 3,303,917,351         | -                     | 1.1856                     | -                          |
| 7月末日                    | 3,590,456,772         | -                     | 1.2370                     | -                          |
| 8月末日                    | 3,866,163,457         | -                     | 1.2831                     | -                          |
| 9月末日                    | 4,102,968,034         | -                     | 1.3432                     | -                          |
| 10月末日                   | 4,021,819,131         | -                     | 1.3871                     | -                          |
| 11月末日                   | 4,122,069,143         | -                     | 1.3743                     | -                          |
| 12月末日                   | 4,251,332,359         | -                     | 1.3338                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 4,577,176,219         | -                     | 1.3807                     | -                          |
| 2月末日                    | 4,393,341,084         | -                     | 1.2632                     | -                          |
| 3月末日                    | 3,597,307,058         | -                     | 1.0014                     | -                          |
| 4月末日                    | 3,874,790,821         | -                     | 0.9920                     | -                          |
| 5月末日                    | 4,221,554,105         | -                     | 1.0732                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 4,081,513,165         | 4,081,513,165         | 1.0318                     | 1.0318                     |
| 6月末日                    | 4,220,831,383         | -                     | 1.0545                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 0.9    |
| 第2計算期間 | 3.5    |
| 第3計算期間 | 15.3   |

|        |      |
|--------|------|
| 第4計算期間 | 12.7 |
|--------|------|

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)     |
|--------|---------------|-------------|
| 第1計算期間 | 1,295,129,456 | 60,344,463  |
| 第2計算期間 | 1,366,263,589 | 304,124,518 |
| 第3計算期間 | 1,052,662,291 | 596,816,922 |
| 第4計算期間 | 2,033,327,838 | 831,339,359 |

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

ダイワJ-REITマザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)           | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 投資証券                  | 327,716,683,170 | 97.42   |
| 内 日本                  | 327,716,683,170 | 97.42   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 8,671,774,665   | 2.58    |
| 純資産総額                 | 336,388,457,835 | 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) | 8,653,952,000 | 2.57    |
| 内 日本            | 8,653,952,000 | 2.57    |

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

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

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

## (2) 投資資産 (2020年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

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

|    |                    |    |      |         |                              |                              |      |
|----|--------------------|----|------|---------|------------------------------|------------------------------|------|
| 1  | 日本ビルファンド           | 日本 | 投資証券 | 36,777  | 687,310.78<br>25,277,228,847 | 614,000.00<br>22,581,078,000 | 6.71 |
| 2  | ジャパンリアルエステイト       | 日本 | 投資証券 | 37,978  | 621,104.77<br>23,588,317,306 | 553,000.00<br>21,001,834,000 | 6.24 |
| 3  | 日本プロロジスリート         | 日本 | 投資証券 | 57,148  | 269,299.59<br>15,389,933,105 | 328,000.00<br>18,744,544,000 | 5.57 |
| 4  | 野村不動産マスターF         | 日本 | 投資証券 | 122,606 | 125,203.70<br>15,350,725,539 | 129,400.00<br>15,865,216,400 | 4.72 |
| 5  | GLP投資法人            | 日本 | 投資証券 | 98,281  | 113,954.31<br>11,199,544,239 | 156,500.00<br>15,380,976,500 | 4.57 |
| 6  | 大和ハウスリート投資法人       | 日本 | 投資証券 | 54,187  | 237,469.05<br>12,867,735,601 | 254,000.00<br>13,763,498,000 | 4.09 |
| 7  | アドバンス・レジデンス        | 日本 | 投資証券 | 36,021  | 275,909.34<br>9,938,530,652  | 321,500.00<br>11,580,751,500 | 3.44 |
| 8  | オリックス不動産投資         | 日本 | 投資証券 | 75,671  | 153,775.66<br>11,636,358,651 | 141,400.00<br>10,699,879,400 | 3.18 |
| 9  | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 日本 | 投資証券 | 85,273  | 119,315.44<br>10,174,386,047 | 115,800.00<br>9,874,613,400  | 2.94 |
| 10 | 日本リテールファンド         | 日本 | 投資証券 | 71,778  | 147,054.32<br>10,555,265,567 | 134,500.00<br>9,654,141,000  | 2.87 |
| 11 | 産業ファンド             | 日本 | 投資証券 | 48,911  | 133,107.06<br>6,510,399,651  | 173,600.00<br>8,490,949,600  | 2.52 |
| 12 | 日本プライムリアルティ        | 日本 | 投資証券 | 24,959  | 336,376.06<br>8,395,610,306  | 316,000.00<br>7,887,044,000  | 2.34 |
| 13 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 12,620  | 555,483.81<br>7,010,205,720  | 624,000.00<br>7,874,880,000  | 2.34 |
| 14 | 積水ハウス・リート投資        | 日本 | 投資証券 | 111,045 | 64,325.25<br>7,142,997,470   | 69,200.00<br>7,684,314,000   | 2.28 |
| 15 | 日本ロジスティクスファンド投資法人  | 日本 | 投資証券 | 24,814  | 214,804.32<br>5,330,154,575  | 292,800.00<br>7,265,539,200  | 2.16 |
| 16 | API投資法人            | 日本 | 投資証券 | 19,030  | 364,119.04<br>6,929,185,452  | 371,500.00<br>7,069,645,000  | 2.10 |
| 17 | ケネディクス・オフィス投資法人    | 日本 | 投資証券 | 11,748  | 583,120.59<br>6,850,500,712  | 601,000.00<br>7,060,548,000  | 2.10 |
| 18 | 森ヒルズリート            | 日本 | 投資証券 | 43,695  | 130,988.91<br>5,723,560,777  | 136,200.00<br>5,951,259,000  | 1.77 |
| 19 | ラサールロジポート投資        | 日本 | 投資証券 | 35,310  | 129,269.53<br>4,564,507,224  | 166,200.00<br>5,868,522,000  | 1.74 |
| 20 | ジャパン・ホテル・リート投資法人   | 日本 | 投資証券 | 122,344 | 40,225.17<br>4,921,309,134   | 44,500.00<br>5,444,308,000   | 1.62 |

|    |                         |    |      |         |                             |                             |      |
|----|-------------------------|----|------|---------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 21 | コンフォリア・レジデンシャル          | 日本 | 投資証券 | 16,536  | 270,207.76<br>4,468,155,617 | 322,000.00<br>5,324,592,000 | 1.58 |
| 22 | 大和証券オフィス投資法人            | 日本 | 投資証券 | 8,766   | 591,210.39<br>5,182,550,335 | 597,000.00<br>5,233,302,000 | 1.56 |
| 23 | 三井不ロジパーク                | 日本 | 投資証券 | 10,808  | 395,041.16<br>4,269,604,951 | 480,500.00<br>5,193,244,000 | 1.54 |
| 24 | イオンリート投資                | 日本 | 投資証券 | 40,986  | 97,157.01<br>3,982,077,529  | 114,400.00<br>4,688,798,400 | 1.39 |
| 25 | 大和証券リビング投資法人            | 日本 | 投資証券 | 46,492  | 83,340.77<br>3,874,679,481  | 100,400.00<br>4,667,796,800 | 1.39 |
| 26 | インヴィンシブル投資法人            | 日本 | 投資証券 | 166,589 | 29,560.92<br>4,924,525,193  | 27,790.00<br>4,629,508,310  | 1.38 |
| 27 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 日本 | 投資証券 | 24,777  | 147,150.29<br>3,645,942,863 | 186,100.00<br>4,610,999,700 | 1.37 |
| 28 | フロンティア不動産投資             | 日本 | 投資証券 | 13,490  | 304,532.66<br>4,108,145,687 | 340,500.00<br>4,593,345,000 | 1.37 |
| 29 | ジャパンエクセレント投資法人          | 日本 | 投資証券 | 35,129  | 122,664.25<br>4,309,072,660 | 125,200.00<br>4,398,150,800 | 1.31 |
| 30 | ヒューリックリート投資法            | 日本 | 投資証券 | 32,299  | 135,712.35<br>4,383,373,449 | 134,000.00<br>4,328,066,000 | 1.29 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率   |
|-----------|--------|
| 投資証券      | 97.42% |
| 合計        | 97.42% |

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

| 種類              | 地域 | 資産名                    | 買建/<br>売建 | 数量    | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|-----------------|----|------------------------|-----------|-------|---------------|---------------|----------|
| 不動産投信指<br>数先物取引 | 日本 | 東証REIT指数先物 2020<br>年9月 | 買建        | 5,248 | 9,075,900,480 | 8,653,952,000 | 2.57%    |

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

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

(参考情報) 運用実績

## ●FW J-REITインデックス

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 10,545円 |
| 純資産総額 | 42億円    |



| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | -1.7%  |
| 3カ月間     | 5.3%   |
| 6カ月間     | -20.9% |
| 1年間      | -11.1% |
| 3年間      | 9.6%   |
| 5年間      | -      |
| 設定来      | 5.5%   |

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 第1期<br>17年6月 | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |  |  |  |  |
|-----|--------------|--------------|--------------|--------------|--|--|--|--|
| 分配金 | 0円           | 0円           | 0円           | 0円           |  |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

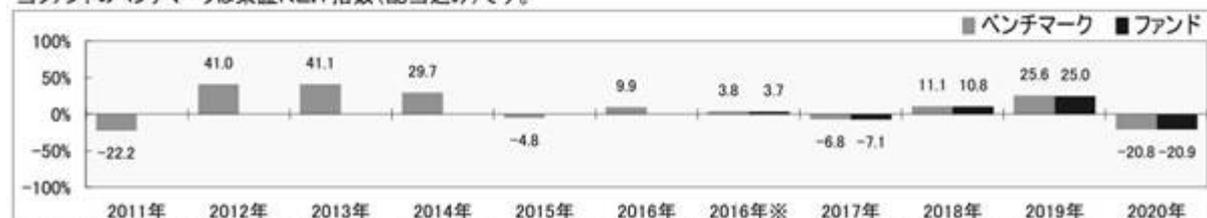
| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率    | リート用途別構成    | 比率    | 組入上位10銘柄        | 用途名     | 比率    |
|-------------|-----|-------|-------------|-------|-----------------|---------|-------|
| 国内リート       | 63  | 97.4% | オフィス不動産     | 28.8% | 日本ビルファンド        | オフィス不動産 | 6.7%  |
| 国内リート先物     | 1   | 2.6%  | 各種不動産       | 26.2% | ジャパンリアルエステイト    | オフィス不動産 | 6.2%  |
|             |     |       | 工業用不動産      | 20.0% | 日本プロジスリート       | 工業用不動産  | 5.6%  |
|             |     |       | 住宅用不動産      | 10.5% | 野村不動産マスターF      | 各種不動産   | 4.7%  |
|             |     |       | 店舗用不動産      | 7.3%  | GLP投資法人         | 工業用不動産  | 4.6%  |
|             |     |       | ホテル・リゾート不動産 | 4.3%  | 大和ハウスリート投資法人    | 各種不動産   | 4.1%  |
|             |     |       | ヘルスケア不動産    | 0.3%  | アドバンス・レジデンス     | 住宅用不動産  | 3.4%  |
|             |     |       |             |       | オリックス不動産投資      | オフィス不動産 | 3.2%  |
|             |     |       |             |       | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 各種不動産   | 2.9%  |
| コール・ローン、その他 |     | 2.6%  |             |       | 日本リートファンド       | 店舗用不動産  | 2.9%  |
| 合計          | 64  | -     | 合計          | 97.4% | 合計              |         | 44.3% |

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2020年6月30日現在）

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 11,788,974,799 | 100.27  |
| 内 日本                  | 11,788,974,799 | 100.27  |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 31,386,596     | 0.27    |
| 純資産総額                 | 11,757,588,203 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類    | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|------------|----------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | 11,732,323,666 | 99.79   |
| 内 日本       | 11,732,323,666 | 99.79   |

(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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                         | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)        | 評価単価<br>時価<br>(円)        | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|-----------------------------|----|-------------------|-----------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|
|   |                             |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                          |                          |                 |
| 1 | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 5,863,702,959   | 2.0677<br>12,124,695,357 | 2.0105<br>11,788,974,799 | 100.27          |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率    |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.27% |
| 合計        | 100.27% |

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

| 種類     | 地域 | 資産名                         | 買建/<br>売建 | 数量         | 簿価            | 時価            | 投資<br>比率 |
|--------|----|-----------------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 豪ドル売/円買 2020年7月             | 売建        | 10,583,900 | 772,877,208   | 781,832,693   | 6.65%    |
|        |    | カナダ・ドル売/円買<br>2020年7月       | 売建        | 2,729,800  | 214,617,433   | 215,080,942   | 1.83%    |
|        |    | ユーロ売/円買 2020年7月             | 売建        | 4,586,300  | 553,467,002   | 555,309,204   | 4.72%    |
|        |    | 英ポンド売/円買 2020年7月            | 売建        | 4,655,400  | 624,199,011   | 616,840,500   | 5.25%    |
|        |    | 米ドル売/円買 2020年7月             | 売建        | 81,917,000 | 8,780,568,280 | 8,824,099,240 | 75.05%   |
|        |    | イスラエル・シケル<br>売/円買 2020年7月   | 売建        | 273,800    | 8,443,992     | 8,539,822     | 0.07%    |
|        |    | ニュージーランド・ドル<br>売/円買 2020年7月 | 売建        | 755,700    | 51,909,033    | 52,203,756    | 0.44%    |
|        |    | シンガポール・ドル売/<br>円買 2020年7月   | 売建        | 6,071,300  | 466,393,853   | 469,250,777   | 3.99%    |
|        |    | 香港ドル売/円買 2020年7月            | 売建        | 15,058,800 | 208,261,156   | 209,166,732   | 1.78%    |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

|                         | 純資産総額<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 5,285,588,386         | 5,285,588,386         | 0.9844                     | 0.9844                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 8,688,426,682         | 8,688,426,682         | 0.9722                     | 0.9722                     |

|                         |                |                |        |        |
|-------------------------|----------------|----------------|--------|--------|
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 10,895,667,977 | 10,895,667,977 | 1.0760 | 1.0760 |
| 2019年6月末日               | 10,802,818,974 | -              | 1.0548 | -      |
| 7月末日                    | 11,134,092,036 | -              | 1.0754 | -      |
| 8月末日                    | 11,535,675,992 | -              | 1.0898 | -      |
| 9月末日                    | 11,878,974,604 | -              | 1.1173 | -      |
| 10月末日                   | 12,223,798,926 | -              | 1.1361 | -      |
| 11月末日                   | 12,447,269,264 | -              | 1.1263 | -      |
| 12月末日                   | 12,492,687,334 | -              | 1.1064 | -      |
| 2020年1月末日               | 13,256,002,101 | -              | 1.1340 | -      |
| 2月末日                    | 12,780,351,282 | -              | 1.0650 | -      |
| 3月末日                    | 9,796,040,998  | -              | 0.8084 | -      |
| 4月末日                    | 11,440,011,571 | -              | 0.8758 | -      |
| 5月末日                    | 11,483,648,991 | -              | 0.8782 | -      |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 12,056,922,582 | 12,056,922,582 | 0.9117 | 0.9117 |
| 6月末日                    | 11,757,588,203 | -              | 0.8823 | -      |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 1.6    |
| 第2計算期間 | 1.2    |
| 第3計算期間 | 10.7   |
| 第4計算期間 | 15.3   |

## (4) 【設定及び解約の実績】

|        | 設定数量(口)       | 解約数量(口)       |
|--------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 5,609,575,520 | 250,487,506   |
| 第2計算期間 | 4,660,565,456 | 1,092,724,304 |
| 第3計算期間 | 3,628,593,466 | 2,439,154,634 |
| 第4計算期間 | 5,683,570,118 | 2,585,491,447 |

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

## ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)          | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券              | 229,946,789    | 0.95    |
| 内 アメリカ                | 229,946,789    | 0.95    |
| 投資証券                  | 23,440,976,178 | 96.62   |
| 内 ガーンジー               | 50,794,893     | 0.21    |
| 内 マン島                 | 4,567,652      | 0.02    |
| 内 韓国                  | 12,556,692     | 0.05    |
| 内 香港                  | 438,193,261    | 1.81    |
| 内 シンガポール              | 1,062,392,589  | 4.38    |
| 内 イスラエル               | 11,064,091     | 0.05    |
| 内 イギリス                | 1,167,046,577  | 4.81    |
| 内 アイルランド              | 29,643,571     | 0.12    |
| 内 オランダ                | 40,244,740     | 0.17    |
| 内 ベルギー                | 257,283,812    | 1.06    |
| 内 フランス                | 473,189,563    | 1.95    |
| 内 ドイツ                 | 56,160,851     | 0.23    |
| 内 スペイン                | 107,224,907    | 0.44    |
| 内 イタリア                | 2,625,499      | 0.01    |
| 内 カナダ                 | 455,330,050    | 1.88    |
| 内 アメリカ                | 17,608,584,255 | 72.58   |
| 内 オーストラリア             | 1,559,068,044  | 6.43    |
| 内 ニューージーランド           | 105,005,131    | 0.43    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 589,467,442    | 2.43    |
| 純資産総額                 | 24,260,390,409 | 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) | 614,084,337 | 2.53    |
| 内 ドイツ           | 235,318,980 | 0.97    |
| 内 アメリカ          | 378,765,357 | 1.56    |
| 為替予約取引(買建)      | 358,274,400 | 1.48    |
| 内 日本            | 358,274,400 | 1.48    |

|            |      |            |      |
|------------|------|------------|------|
| 為替予約取引(売建) |      | 96,957,000 | 0.40 |
|            | 内 日本 | 96,957,000 | 0.40 |

(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6月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

|    | 銘柄名                             | 地域      | 種類   | 株数、口数<br>また<br>は<br>額面金額 | 簿価単価<br>簿価<br>(円)          | 評価単価<br>時価<br>(円)          | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------------------------------|---------|------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | PROLOGIS INC                    | アメリカ    | 投資証券 | 150,619                  | 9,786.45<br>1,474,038,356  | 9,822.65<br>1,479,478,594  | 6.10            |
| 2  | EQUINIX INC                     | アメリカ    | 投資証券 | 18,000                   | 62,371.33<br>1,122,685,191 | 74,224.24<br>1,336,036,334 | 5.51            |
| 3  | DIGITAL REALTY TRUST INC        | アメリカ    | 投資証券 | 54,778                   | 13,540.54<br>741,729,113   | 15,097.60<br>827,016,672   | 3.41            |
| 4  | PUBLIC STORAGE                  | アメリカ    | 投資証券 | 30,700                   | 22,654.81<br>695,503,363   | 20,589.11<br>632,085,800   | 2.61            |
| 5  | AVALONBAY COMMUNITIES INC       | アメリカ    | 投資証券 | 28,700                   | 22,514.21<br>646,157,937   | 16,484.22<br>473,097,114   | 1.95            |
| 6  | WELLTOWER INC                   | アメリカ    | 投資証券 | 85,300                   | 8,652.38<br>738,054,770    | 5,522.75<br>471,090,780    | 1.94            |
| 7  | SIMON PROPERTY GROUP INC        | アメリカ    | 投資証券 | 62,147                   | 15,413.17<br>957,883,304   | 7,340.32<br>456,179,252    | 1.88            |
| 8  | REALTY INCOME CORP              | アメリカ    | 投資証券 | 70,117                   | 7,946.79<br>557,211,489    | 6,440.69<br>451,602,366    | 1.86            |
| 9  | ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUIT | アメリカ    | 投資証券 | 25,800                   | 17,368.76<br>448,115,246   | 17,414.01<br>449,281,618   | 1.85            |
| 10 | EQUITY RESIDENTIAL              | アメリカ    | 投資証券 | 71,400                   | 8,901.26<br>635,553,972    | 6,213.36<br>443,634,318    | 1.83            |
| 11 | LINK REIT                       | 香港      | 投資証券 | 429,700                  | 1,090.41<br>468,554,626    | 884.73<br>380,170,630      | 1.57            |
| 12 | GOODMAN GROUP                   | オーストラリア | 投資証券 | 339,810                  | 1,079.68<br>366,898,569    | 1,110.41<br>377,330,597    | 1.56            |
| 13 | ESSEX PROPERTY TRUST INC        | アメリカ    | 投資証券 | 13,367                   | 32,913.49<br>439,955,025   | 24,395.56<br>326,095,560   | 1.34            |

|    |                              |      |          |         |                          |                          |      |
|----|------------------------------|------|----------|---------|--------------------------|--------------------------|------|
| 14 | INVITATION HOMES INC         | アメリカ | 投資証券     | 111,097 | 3,235.97<br>359,511,380  | 2,918.67<br>324,256,214  | 1.34 |
| 15 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | アメリカ | 投資証券     | 109,900 | 3,606.16<br>396,320,243  | 2,928.37<br>321,828,215  | 1.33 |
| 16 | VENTAS INC                   | アメリカ | 投資証券     | 75,479  | 6,070.07<br>458,166,773  | 3,954.05<br>298,448,344  | 1.23 |
| 17 | SUN COMMUNITIES INC          | アメリカ | 投資証券     | 20,100  | 17,199.72<br>345,714,517 | 14,484.56<br>291,139,769 | 1.20 |
| 18 | BOSTON PROPERTIES INC        | アメリカ | 投資証券     | 29,500  | 14,524.96<br>428,488,929 | 9,661.04<br>285,000,851  | 1.17 |
| 19 | SEGRO PLC                    | イギリス | 投資証券     | 238,460 | 1,168.07<br>278,545,263  | 1,182.78<br>282,046,735  | 1.16 |
| 20 | DUKE REALTY CORP             | アメリカ | 投資証券     | 75,200  | 3,775.74<br>283,942,898  | 3,725.64<br>280,168,820  | 1.15 |
| 21 | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | アメリカ | 投資証券     | 23,128  | 14,447.39<br>334,139,781 | 12,015.16<br>277,886,731 | 1.15 |
| 22 | EXTRA SPACE STORAGE INC      | アメリカ | 投資証券     | 26,200  | 11,366.78<br>297,810,318 | 9,893.76<br>259,216,622  | 1.07 |
| 23 | WP CAREY INC                 | アメリカ | 投資証券     | 34,900  | 8,812.80<br>307,567,123  | 7,204.57<br>251,439,626  | 1.04 |
| 24 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | アメリカ | 投資証券     | 36,900  | 7,851.01<br>289,705,749  | 6,642.17<br>245,096,110  | 1.01 |
| 25 | UDR INC                      | アメリカ | 投資証券     | 60,200  | 5,069.27<br>305,175,285  | 3,963.75<br>238,618,027  | 0.98 |
| 26 | VANGUARD REAL ESTATE ETF     | アメリカ | 投資信託受益証券 | 27,500  | 8,343.70<br>229,454,417  | 8,361.70<br>229,946,789  | 0.95 |
| 27 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | アメリカ | 投資証券     | 107,900 | 2,220.84<br>239,630,869  | 1,986.72<br>214,367,692  | 0.88 |
| 28 | VICI PROPERTIES INC          | アメリカ | 投資証券     | 95,700  | 2,634.78<br>252,154,319  | 2,154.80<br>206,214,360  | 0.85 |
| 29 | CAMDEN PROPERTY TRUST        | アメリカ | 投資証券     | 19,900  | 11,817.56<br>235,170,886 | 9,684.74<br>192,726,497  | 0.79 |
| 30 | CYRUSONE INC                 | アメリカ | 投資証券     | 23,500  | 6,802.70<br>159,865,689  | 8,023.39<br>188,549,848  | 0.78 |

(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  | 0.95% |

|      |        |
|------|--------|
| 投資証券 | 96.62% |
| 合計   | 97.57% |

(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/<br>売建 | 数量        | 簿価          | 時価          | 投資<br>比率 |
|-----------------|------|---------------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|----------|
| 不動産投信指<br>数先物取引 | アメリカ | DJ US REIT IDXFTRS<br>2020年9月   | 買建        | 115       | 393,286,016 | 378,765,357 | 1.56%    |
|                 | ドイツ  | STOXX600 REIT IDXFTR<br>2020年9月 | 買建        | 260       | 245,939,028 | 235,318,980 | 0.97%    |
| 為替予約取引          | 日本   | ユーロ買/円売 2020年7<br>月             | 買建        | 1,000,000 | 120,059,830 | 121,080,000 | 0.50%    |
|                 |      | 米ドル買/円売 2020年7<br>月             | 買建        | 2,140,000 | 230,043,249 | 230,542,200 | 0.95%    |
|                 |      | カナダ・ドル買/円売<br>2020年7月           | 買建        | 30,000    | 2,353,290   | 2,363,700   | 0.01%    |
|                 |      | 豪ドル買/円売 2020年7<br>月             | 買建        | 30,000    | 2,208,963   | 2,216,100   | 0.01%    |
|                 |      | ニュージーランド・ドル<br>買/円売 2020年7月     | 買建        | 30,000    | 2,010,873   | 2,072,400   | 0.01%    |
|                 |      | 米ドル売/円買 2020年7<br>月             | 売建        | 900,000   | 96,964,650  | 96,957,000  | 0.40%    |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 8,823円 |
| 純資産総額 | 117億円  |

| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | 0.5%   |
| 3カ月間     | 9.1%   |
| 6カ月間     | -20.3% |
| 1年間      | -16.4% |
| 3年間      | -9.0%  |
| 5年間      | -      |
| 設定来      | -11.8% |



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

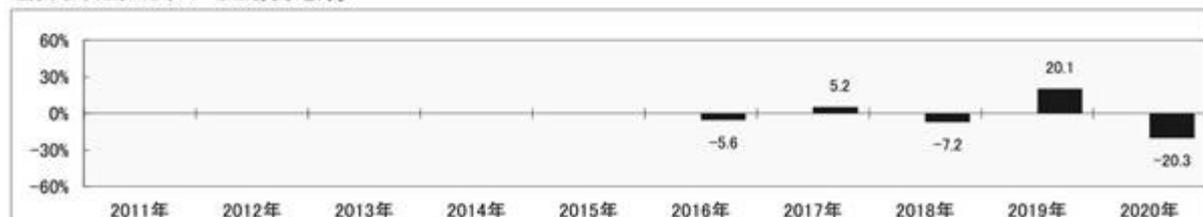
| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | リート用途別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄                     | 用途名    | 国・地域名 | 比率    |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|----------|-------|------------------------------|--------|-------|-------|
| 外国リート・先物    | 309 | 99.3%  | 日本円         | 99.4%  | 産業施設     | 15.5% | PROLOGIS INC                 | 産業施設   | アメリカ  | 6.1%  |
| 外国投資信託等     | 3   | 1.1%   | 米ドル         | 0.3%   | 商業施設     | 15.4% | EQUINIX INC                  | 特殊用途施設 | アメリカ  | 5.5%  |
| コール・ローン、その他 |     | 2.2%   | 香港ドル        | 0.2%   | 住宅       | 14.9% | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 特殊用途施設 | アメリカ  | 3.4%  |
| 合計          | 312 | -      | ユーロ         | 0.2%   | 特殊用途施設   | 13.2% | PUBLIC STORAGE               | 貸倉庫    | アメリカ  | 2.6%  |
| 国・地域別構成     |     |        | シンガポール・ドル   | 0.1%   | オフィス     | 11.1% | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 住宅     | アメリカ  | 2.0%  |
| アメリカ        |     | 75.3%  | カナダ・ドル      | 0.1%   | ヘルスケア    | 9.3%  | WELLTOWER INC                | ヘルスケア  | アメリカ  | 1.9%  |
| オーストラリア     |     | 6.4%   | 韓国ウォン       | 0.1%   | 各種不動産    | 9.2%  | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 商業施設   | アメリカ  | 1.9%  |
| イギリス        |     | 4.8%   | ニュージーランド・ドル | 0.0%   | 貸倉庫      | 5.8%  | REALTY INCOME CORP           | 商業施設   | アメリカ  | 1.9%  |
| シンガポール      |     | 4.4%   | イスラエル・シェケル  | -0.0%  | ホテル/リゾート | 2.3%  | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | オフィス   | アメリカ  | 1.9%  |
| その他         |     | 9.4%   | その他         | -0.3%  | その他      | 0.0%  | EQUITY RESIDENTIAL           | 住宅     | アメリカ  | 1.8%  |
| 合計          |     | 100.4% | 合計          | 100.0% | 合計       | 96.8% | 合計                           |        |       | 29.0% |

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】 (2020年6月30日現在)

## 投資状況

| 投資資産の種類               | 時価(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券             | 2,062,060,691 | 99.99   |
| 内 日本                  | 2,062,060,691 | 99.99   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 204,470       | 0.01    |
| 純資産総額                 | 2,062,265,161 | 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6月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

|   | 銘柄名                             | 地域 | 種類                | 株数、口数           | 簿価単価<br>簿価<br>(円)       | 評価単価<br>時価<br>(円)       | 投資<br>比率<br>(%) |
|---|---------------------------------|----|-------------------|-----------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
|   |                                 |    |                   | また<br>は<br>額面金額 |                         |                         |                 |
| 1 | ダイワ・グローバルREITイン<br>デックス・マザーファンド | 日本 | 親投資<br>信託受<br>益証券 | 1,025,645,706   | 2.0677<br>2,120,826,012 | 2.0105<br>2,062,060,691 | 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<br>(分配落)<br>(円) | 純資産総額<br>(分配付)<br>(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配落)(円) | 1口当たりの<br>純資産額<br>(分配付)(円) |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------------|
| 第1計算期間末<br>(2017年6月15日) | 609,843,907           | 609,843,907           | 1.0729                     | 1.0729                     |
| 第2計算期間末<br>(2018年6月15日) | 1,189,127,891         | 1,189,127,891         | 1.0864                     | 1.0864                     |
| 第3計算期間末<br>(2019年6月17日) | 1,667,702,163         | 1,667,702,163         | 1.1931                     | 1.1931                     |
| 2019年6月末日               | 1,642,195,928         | -                     | 1.1652                     | -                          |
| 7月末日                    | 1,736,878,425         | -                     | 1.1939                     | -                          |
| 8月末日                    | 1,770,999,532         | -                     | 1.1849                     | -                          |
| 9月末日                    | 1,877,407,774         | -                     | 1.2340                     | -                          |
| 10月末日                   | 1,859,099,526         | -                     | 1.2754                     | -                          |
| 11月末日                   | 1,906,145,460         | -                     | 1.2711                     | -                          |
| 12月末日                   | 2,011,661,926         | -                     | 1.2578                     | -                          |
| 2020年1月末日               | 2,153,322,330         | -                     | 1.2802                     | -                          |
| 2月末日                    | 2,119,896,657         | -                     | 1.2039                     | -                          |
| 3月末日                    | 1,649,709,226         | -                     | 0.9011                     | -                          |
| 4月末日                    | 1,959,419,716         | -                     | 0.9629                     | -                          |
| 5月末日                    | 2,003,230,103         | -                     | 0.9731                     | -                          |
| 第4計算期間末<br>(2020年6月15日) | 2,091,937,862         | 2,091,937,862         | 1.0120                     | 1.0120                     |
| 6月末日                    | 2,062,265,161         | -                     | 0.9836                     | -                          |

## 【分配の推移】

|        | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第1計算期間 | 0.0000      |
| 第2計算期間 | 0.0000      |
| 第3計算期間 | 0.0000      |
| 第4計算期間 | 0.0000      |

## 【収益率の推移】

|        | 収益率(%) |
|--------|--------|
| 第1計算期間 | 7.3    |
| 第2計算期間 | 1.3    |

|        |      |
|--------|------|
| 第3計算期間 | 9.8  |
| 第4計算期間 | 15.2 |

## (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 | 593,727,416   | 35,333,000  |
| 第2計算期間 | 637,956,340   | 111,827,964 |
| 第3計算期間 | 579,621,490   | 276,337,306 |
| 第4計算期間 | 1,036,279,306 | 366,994,605 |

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2020年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 9,836円 |
| 純資産総額 | 20億円   |

| 基準価額の騰落率 |        |
|----------|--------|
| 期間       | ファンド   |
| 1カ月間     | 1.1%   |
| 3カ月間     | 9.2%   |
| 6カ月間     | -21.8% |
| 1年間      | -15.6% |
| 3年間      | -9.2%  |
| 5年間      | -      |
| 設定来      | -1.6%  |



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 |              |              |              | 設定来分配金合計額: 0円 |  |  |  |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--|--|--|
|     | 第1期<br>17年6月    | 第2期<br>18年6月 | 第3期<br>19年6月 | 第4期<br>20年6月 |               |  |  |  |
| 分配金 | 0円              | 0円           | 0円           | 0円           |               |  |  |  |

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

| 資産別構成       | 銘柄数 | 比率     | 通貨別構成       | 比率     | リート用途別構成 | 比率    | 組入上位10銘柄                     | 用途名    | 国・地域名 | 比率    |
|-------------|-----|--------|-------------|--------|----------|-------|------------------------------|--------|-------|-------|
| 外国リート・先物    | 309 | 99.0%  | 米ドル         | 75.1%  | 産業施設     | 15.5% | PROLOGIS INC                 | 産業施設   | アメリカ  | 6.1%  |
| 外国投資信託等     | 3   | 1.1%   | 豪ドル         | 6.5%   | 商業施設     | 15.4% | EQUINIX INC                  | 特殊用途施設 | アメリカ  | 5.5%  |
| コール・ローン、その他 |     | 2.4%   | 英ポンド        | 5.1%   | 住宅       | 14.9% | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 特殊用途施設 | アメリカ  | 3.4%  |
| 合計          | 312 | -      | ユーロ         | 4.9%   | 特殊用途施設   | 13.2% | PUBLIC STORAGE               | 貸倉庫    | アメリカ  | 2.6%  |
| 国・地域別構成     |     |        | シンガポール・ドル   | 4.1%   | オフィス     | 11.0% | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 住宅     | アメリカ  | 1.9%  |
| アメリカ        |     | 75.1%  | 香港ドル        | 2.0%   | ヘルスケア    | 9.2%  | WELLTOWER INC                | ヘルスケア  | アメリカ  | 1.9%  |
| オーストラリア     |     | 6.4%   | カナダ・ドル      | 1.9%   | 各種不動産    | 9.2%  | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 商業施設   | アメリカ  | 1.9%  |
| イギリス        |     | 4.8%   | ニュージーランド・ドル | 0.4%   | 貸倉庫      | 5.8%  | REALTY INCOME CORP           | 商業施設   | アメリカ  | 1.9%  |
| シンガポール      |     | 4.4%   | 韓国ウォン       | 0.1%   | ホテル/リゾート | 2.3%  | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | オフィス   | アメリカ  | 1.9%  |
| その他         |     | 9.4%   | その他         | -0.1%  | その他      | 0.0%  | EQUITY RESIDENTIAL           | 住宅     | アメリカ  | 1.8%  |
| 合計          |     | 100.1% | 合計          | 100.0% | 合計       | 96.5% | 合計                           |        |       | 28.9% |

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2020年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 2 【換金(解約)手続等】

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

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

## ＜一部解約＞

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

## ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

## ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

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

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

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

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

[ 別表A ]

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

[ 別表B ]

| ファンド名 | 価額 |
|-------|----|
|-------|----|

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

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

\*「FW J-REITインデックス」は除きます。

#### (注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

#### (注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします(「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。)

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)

電話番号(コールセンター) 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

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

## (4) 【計算期間】

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

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

## (5) 【その他】

信託の終了

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

権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

#### 信託約款の変更等

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

7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

#### 換金請求権

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2019年6月18日から2020年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 15,008,455          | 28,662,508          |
| 親投資信託受益証券       | 8,838,674,747       | 11,170,279,752      |
| 未収入金            | 150,000             | 4,200,000           |
| 流動資産合計          | 8,853,833,202       | 11,203,142,260      |
| 資産合計            | 8,853,833,202       | 11,203,142,260      |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | -                   | 13,408,391          |
| 未払受託者報酬         | 922,584             | 1,184,995           |
| 未払委託者報酬         | 13,377,985          | 17,183,003          |
| その他未払費用         | 233,096             | 296,216             |
| 流動負債合計          | 14,533,665          | 32,072,605          |
| 負債合計            | 14,533,665          | 32,072,605          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 7,338,540,787     | 1 9,121,901,905     |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,500,758,750       | 2,049,167,750       |
| （分配準備積立金）       | 648,712,408         | 493,154,837         |
| 元本等合計           | 8,839,299,537       | 11,171,069,655      |
| 純資産合計           | 8,839,299,537       | 11,171,069,655      |
| 負債純資産合計         | 8,853,833,202       | 11,203,142,260      |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期 |                            | 第4期 |                            |
|---|-----|----------------------------|-----|----------------------------|
|   | 自   | 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自   | 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
| <b>営業収益</b>                               |     |                            |     |                            |
| 受取利息                                      |     | 17                         |     | 193                        |
| 有価証券売買等損益                                 |     | 1,115,734,434              |     | 139,275,005                |
| 営業収益合計                                    |     | 1,115,734,417              |     | 139,275,198                |
| <b>営業費用</b>                               |     |                            |     |                            |
| 支払利息                                      |     | 11,028                     |     | 8,873                      |
| 受託者報酬                                     |     | 1,885,848                  |     | 2,268,670                  |
| 委託者報酬                                     |     | 27,346,035                 |     | 32,896,932                 |
| その他費用                                     |     | 472,687                    |     | 569,792                    |
| 営業費用合計                                    |     | 29,715,598                 |     | 35,744,267                 |
| 営業利益又は営業損失( )                             |     | 1,145,450,015              |     | 103,530,931                |
| 経常利益又は経常損失( )                             |     | 1,145,450,015              |     | 103,530,931                |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |     | 1,145,450,015              |     | 103,530,931                |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |     | 176,542,336                |     | 88,632,183                 |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |     | 2,324,416,974              |     | 1,500,758,750              |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |     | 789,673,667                |     | 1,027,919,513              |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |     | 789,673,667                |     | 1,027,919,513              |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |     | 644,424,212                |     | 494,409,261                |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |     | 644,424,212                |     | 494,409,261                |
| 分配金                                       |     | 1 -                        |     | 1 -                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |     | 1,500,758,750              |     | 2,049,167,750              |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 6,237,886,759円 | 7,338,540,787円 |
| 期中追加設定元本額           | 2,901,918,904円 | 4,061,789,160円 |
| 期中一部解約元本額           | 1,801,264,876円 | 2,278,428,042円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 7,338,540,787口 | 9,121,901,905口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(852,061,854円)及び分配準備積立金(648,712,408円)より分配対象額は1,500,774,262円(1万口当たり2,045.06円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,277,687,718円)及び分配準備積立金(493,154,837円)より分配対象額は2,770,842,555円(1万口当たり3,037.57円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 1,003,791,034            | 90,571,597               |
| 合計        | 1,003,791,034            | 90,571,597               |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.2045円<br>(12,045円) | 1.2246円<br>(12,246円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                  | 券面総額           | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|--------------|----------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | トピックス・インデックス・マザーファンド | 11,062,968,954 | 11,170,279,752 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                      |                | 11,170,279,752 |    |
| 合計           |                      |                | 11,170,279,752 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金 額 (円)      | 金 額 (円)      |
| 資産の部 |              |              |

|                 |     |                 |
|-----------------|-----|-----------------|
| 流動資産            |     |                 |
| コール・ローン         |     | 21,226,501,523  |
| 株式              | 3 4 | 134,161,291,380 |
| 派生商品評価勘定        |     | 3,346,000       |
| 未収入金            |     | 24,540,100      |
| 未収配当金           |     | 1,086,024,213   |
| 未収利息            |     | 720,429         |
| 前払金             |     | -               |
| その他未収収益         | 5   | 37,436,485      |
| 差入委託証拠金         |     | -               |
| 流動資産合計          |     | 156,539,860,130 |
| 資産合計            |     | 156,539,860,130 |
| 負債の部            |     |                 |
| 流動負債            |     |                 |
| 派生商品評価勘定        |     | 1,281,740       |
| 前受金             |     | 8,460,000       |
| 未払金             |     | -               |
| 未払解約金           |     | 50,779,400      |
| 受入担保金           |     | 20,323,222,856  |
| その他未払費用         |     | -               |
| 流動負債合計          |     | 20,383,743,996  |
| 負債合計            |     | 20,383,743,996  |
| 純資産の部           |     |                 |
| 元本等             |     |                 |
| 元本              | 1   | 137,575,273,801 |
| 剰余金             |     |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 2   | 1,419,157,667   |
| 元本等合計           |     | 136,156,116,134 |
| 純資産合計           |     | 136,156,116,134 |
| 負債純資産合計         |     | 156,539,860,130 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|     |                              |
|-----|------------------------------|
| 区 分 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|-----|------------------------------|

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分               | 2019年6月17日現在     | 2020年6月15日現在     |
|-------------------|------------------|------------------|
| 1. 1 期首           | 2018年6月16日       | 2019年6月18日       |
| 期首元本額             | 130,458,954,190円 | 137,575,273,801円 |
| 期中追加設定元本額         | 19,483,159,298円  | 39,667,785,354円  |
| 期中一部解約元本額         | 12,366,839,687円  | 35,473,804,842円  |
| 期末元本額の内訳<br>ファンド名 |                  |                  |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| トピックス・インデックス<br>ファンド                     | 4,064,718,502円  | 3,431,880,768円  |
| ダイワ・トピックス・イン<br>デックスファンドVA               | 7,831,019,610円  | 7,031,041,815円  |
| 適格機関投資家専用・ダイ<br>ワ・トピックスインデックス<br>ファンドVA2 | 28,922,843円     | 2,678,796円      |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 60,746,661円     | 49,608,551円     |
| ダイワ国内重視バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 970,087,745円    | 725,117,589円    |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド30VA(一般投資家私<br>募)     | 49,591,649円     | 40,741,510円     |
| ダイワ国際分散バランスファ<br>ンド50VA(一般投資家私<br>募)     | 1,345,886,376円  | 1,079,559,180円  |
| 日本株式インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用) | 17,407,313円     | 93,444,117円     |
| D-I's TOPIXイン<br>デックス                    | 40,206,774円     | 55,557,627円     |
| 為替ヘッジ付米国国債プラス<br>日本株式ファンド                | 19,956,909円     | 13,600,232円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                   | 1,811,311円      | 21,174,600円     |
| iFree TOPIXイン<br>デックス                    | 1,086,769,694円  | 1,794,166,388円  |
| iFree 8資産バランス                            | 1,719,726,019円  | 2,416,776,177円  |
| iFree 年金バランス                             | 45,351,886円     | 92,512,175円     |
| DCダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 65,593,800,212円 | 65,610,936,766円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                       | 2,830,723,893円  | 2,891,908,692円  |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                       | 3,174,079,892円  | 3,733,714,207円  |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                       | 2,924,490,418円  | 3,281,143,353円  |
| 年金ダイワ日本株式インデッ<br>クス                      | 4,901,290,488円  | 5,113,096,051円  |

|                                      |                |                |
|--------------------------------------|----------------|----------------|
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020               | 15,661,912円    | 14,119,485円    |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030               | 51,776,914円    | 53,875,091円    |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040               | 18,724,906円    | 32,163,043円    |
| ダイワつみたてインデックス<br>日本株式                | 124,032,077円   | 620,750,487円   |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス30              | 198,705円       | 11,880,333円    |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス50              | 298,057円       | 7,017,784円     |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス70              | 447,086円       | 10,310,045円    |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド15VA              | 370,487円       | - 円            |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド20VA              | 380,895円       | - 円            |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド20VA(国内株式型)       | 748,462円       | - 円            |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド25VA              | 4,378,927円     | - 円            |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド30VA              | 4,332,378円     | - 円            |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド30VA(国内株式型)       | 8,522,639円     | - 円            |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                | 171,234,737円   | 153,610,897円   |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                | 171,314,178円   | 155,742,680円   |
| ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                 | 9,583,310,698円 | 8,889,004,308円 |
| ダイワ・ワールド・バランス<br>ファンド75VA            | 2,950,347円     | - 円            |
| ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用)  | 825,721,462円   | 735,977,487円   |
| ダイワ国内バランスファンド<br>25VA(適格機関投資家専<br>用) | 127,351,633円   | 121,831,903円   |

|    |   |   |   |
|----|---|---|---|
|    | ダイワ国内バランスファンド<br>30VA(適格機関投資家専用)          | 223,926,223円  | 199,527,738円  |
|    | ダイワ・ノーロードTOP<br>IXファンド                    | 164,247,771円  | 183,644,716円  |
|    | ダイワファンドラップTOP<br>PIXインデックス                | 8,930,660,551円  | 11,062,968,954円   |
|    | ダイワTOPIXインデック<br>ス(ダイワSMA専用)              | 1,918,006,449円  | 5,133,228,644円  |
|    | ダイワファンドラップオンラ<br>インTOPIXインデック<br>ス        | 2,518,767,124円  | 2,052,886,383円  |
|    | ダイワ・インデックスセレク<br>トTOPIX                   | 1,423,976,054円  | 1,336,114,842円  |
|    | ダイワライフスタイル25                              | 192,967,338円  | 201,336,286円  |
|    | ダイワライフスタイル50                              | 678,951,850円  | 665,325,688円  |
|    | ダイワライフスタイル75                              | 559,984,571円  | 549,365,823円  |
|    | DC・ダイワ・トピックス・<br>インデックス(確定拠出年金<br>専用ファンド) | 13,145,441,175円   | 12,099,913,102円   |
|    | 計   | 137,575,273,801円  | 141,769,254,313円  |
| 2. | 期末日における受益権の総数                             | 137,575,273,801口  | 141,769,254,313口  |
| 3. | 2 元本の欠損                                   | 貸借対照表上の純資産額が元<br>本総額を下回っており、その<br>差額は1,419,157,667円であり<br>ます。       |   |
| 4. | 3 貸付有価証券                                  | 株券貸借取引契約により、以<br>下のとおり有価証券の貸付を<br>行っております。<br>株式 19,310,988,920円    | 株券貸借取引契約により、以<br>下のとおり有価証券の貸付を<br>行っております。<br>株式 20,192,814,970円    |
| 5. | 4 差入委託証拠金代用有価証券                           | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>株式 482,520,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>株式 500,160,000円 |

|              |   |   |
|--------------|---|---|
| 6. 5 その他未収収益 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分35,913,563円が含まれております。 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分32,561,275円が含まれております。 |
|--------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                            | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。                                   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15日現在                                |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。     |

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類     | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|---------|------------------------|------------------------|
|         | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 株式      | 19,957,618,777         | 6,881,048,958          |
| 新株予約権証券 | -                      | 0                      |
| 合計      | 19,957,618,777         | 6,881,048,958          |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年9月20日から2019年6月17日まで、及び2019年9月20日から2020年6月15日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

| 種 類          | 2019年6月17日 現在 |           |               |             | 2020年6月15日 現在 |           |               |             |
|--------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|              | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|              | (円)           | うち<br>1年超 |               |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引         |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 株価指数<br>先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買 建          | 2,008,715,000 | -         | 2,010,850,000 | 2,135,000   | 2,458,263,200 | -         | 2,342,340,000 | 115,923,200 |
| 合計           | 2,008,715,000 | -         | 2,010,850,000 | 2,135,000   | 2,458,263,200 | -         | 2,342,340,000 | 115,923,200 |

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

## 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

|              | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 0.9897円      | 1.0097円      |
| (1万口当たり純資産額) | (9,897円)     | (10,097円)    |

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

| 銘柄            | 株式数     | 評価額(円)   |             | 備考           |
|---------------|---------|----------|-------------|--------------|
|               |         | 単価       | 金額          |              |
| 極洋            | 3,300   | 2,656.00 | 8,764,800   |              |
| 日本水産          | 90,200  | 473.00   | 42,664,600  |              |
| マルハニチロ        | 13,100  | 2,129.00 | 27,889,900  |              |
| ハウスイ          | 500     | 897.00   | 448,500     | 貸付株式数 200株   |
| カネコ種苗         | 2,700   | 1,436.00 | 3,877,200   |              |
| サカタのタネ        | 10,600  | 3,415.00 | 36,199,000  | 貸付株式数 4,300株 |
| ホクト           | 6,700   | 1,983.00 | 13,286,100  | 貸付株式数 1,400株 |
| ホクリヨウ         | 1,600   | 620.00   | 992,000     | 貸付株式数 500株   |
| ヒノキヤグループ      | 2,200   | 1,648.00 | 3,625,600   | 貸付株式数 800株   |
| ショーボンドHD      | 14,000  | 4,815.00 | 67,410,000  |              |
| ミライト・ホールディングス | 26,700  | 1,478.00 | 39,462,600  |              |
| タマホーム         | 5,000   | 1,191.00 | 5,955,000   | 貸付株式数 1,900株 |
| サンヨーホームズ      | 1,200   | 627.00   | 752,400     | 貸付株式数 300株   |
| 日本アクア         | 3,800   | 554.00   | 2,105,200   | 貸付株式数 1,400株 |
| ファーストコーポレーション | 3,000   | 531.00   | 1,593,000   | 貸付株式数 1,000株 |
| ベステラ          | 1,600   | 963.00   | 1,540,800   |              |
| スペースバリューHD    | 11,100  | 350.00   | 3,885,000   |              |
| 住石ホールディングス    | 18,400  | 117.00   | 2,152,800   |              |
| 日鉄鉱業          | 2,100   | 4,350.00 | 9,135,000   |              |
| 三井松島HLDGS     | 3,400   | 835.00   | 2,839,000   |              |
| 国際石油開発帝石      | 357,800 | 706.10   | 252,642,580 |              |
| 石油資源開発        | 11,900  | 1,868.00 | 22,229,200  |              |
| K&Oエナジーグループ   | 4,300   | 1,479.00 | 6,359,700   |              |
| ダイセキ環境ソリューション | 1,800   | 915.00   | 1,647,000   |              |

|                   |         |          |             |                        |
|-------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 第一カッター興業          | 1,100   | 2,119.00 | 2,330,900   |                        |
| 安藤・間              | 52,300  | 628.00   | 32,844,400  |                        |
| 東急建設              | 26,000  | 561.00   | 14,586,000  |                        |
| コムシスホールディングス      | 31,800  | 2,899.00 | 92,188,200  |                        |
| ビーアールホールディングス     | 9,800   | 515.00   | 5,047,000   |                        |
| 高松コンストラクションG<br>P | 5,500   | 2,280.00 | 12,540,000  | 貸付株式数 2,100株           |
| 東建コーポレーション        | 2,700   | 7,170.00 | 19,359,000  | 貸付株式数 1,100株<br>(100株) |
| ソネック              | 900     | 811.00   | 729,900     | 貸付株式数 300株             |
| ヤマウラ              | 4,000   | 795.00   | 3,180,000   | 貸付株式数 100株             |
| 大成建設              | 68,500  | 3,790.00 | 259,615,000 |                        |
| 大林組               | 203,600 | 996.00   | 202,785,600 |                        |
| 清水建設              | 206,100 | 845.00   | 174,154,500 |                        |
| 飛鳥建設              | 5,900   | 1,043.00 | 6,153,700   |                        |
| 長谷工コーポレーション       | 79,200  | 1,294.00 | 102,484,800 |                        |
| 松井建設              | 8,200   | 646.00   | 5,297,200   |                        |
| 銭高組               | 900     | 3,860.00 | 3,474,000   |                        |
| 鹿島建設              | 160,500 | 1,202.00 | 192,921,000 |                        |
| 不動テトラ             | 5,400   | 1,390.00 | 7,506,000   |                        |
| 大末建設              | 2,300   | 801.00   | 1,842,300   |                        |
| 鉄建建設              | 4,600   | 2,025.00 | 9,315,000   |                        |
| 西松建設              | 15,900  | 2,060.00 | 32,754,000  |                        |
| 三井住友建設            | 49,600  | 471.00   | 23,361,600  |                        |
| 大豊建設              | 4,800   | 2,317.00 | 11,121,600  |                        |
| 前田建設              | 51,500  | 828.00   | 42,642,000  |                        |
| 佐田建設              | 4,500   | 412.00   | 1,854,000   |                        |
| ナカノフドー建設          | 5,400   | 376.00   | 2,030,400   |                        |
| 奥村組               | 11,100  | 2,390.00 | 26,529,000  |                        |
| 東鉄工業              | 8,800   | 2,697.00 | 23,733,600  |                        |
| イチケン              | 1,400   | 1,467.00 | 2,053,800   |                        |
| 富士ピー・エス           | 3,000   | 563.00   | 1,689,000   |                        |
| 浅沼組               | 2,400   | 4,165.00 | 9,996,000   |                        |
| 戸田建設              | 83,900  | 668.00   | 56,045,200  |                        |
| 熊谷組               | 9,400   | 2,534.00 | 23,819,600  |                        |
| 北野建設              | 1,300   | 2,560.00 | 3,328,000   |                        |
| 植木組               | 900     | 2,416.00 | 2,174,400   |                        |
| 矢作建設              | 9,100   | 729.00   | 6,633,900   |                        |
| ピーエス三菱            | 6,400   | 510.00   | 3,264,000   | 貸付株式数 2,300株           |

|            |         |           |             |               |
|------------|---------|-----------|-------------|---------------|
| 日本ハウスHLDGS | 14,200  | 272.00    | 3,862,400   |               |
| 大東建託       | 22,300  | 10,375.00 | 231,362,500 | 貸付株式数 8,900株  |
| 新日本建設      | 8,700   | 803.00    | 6,986,100   |               |
| NIPPO      | 16,800  | 2,561.00  | 43,024,800  |               |
| 東亜道路       | 1,300   | 3,180.00  | 4,134,000   |               |
| 前田道路       | 18,600  | 1,991.00  | 37,032,600  |               |
| 日本道路       | 2,000   | 7,090.00  | 14,180,000  |               |
| 東亜建設       | 6,500   | 1,460.00  | 9,490,000   | 貸付株式数 2,500株  |
| 日本国土開発     | 15,200  | 504.00    | 7,660,800   | 貸付株式数 6,100株  |
| 若築建設       | 3,500   | 1,120.00  | 3,920,000   |               |
| 東洋建設       | 23,600  | 394.00    | 9,298,400   |               |
| 五洋建設       | 81,500  | 554.00    | 45,151,000  | 貸付株式数 32,800株 |
| 世紀東急       | 10,100  | 745.00    | 7,524,500   |               |
| 福田組        | 2,400   | 4,675.00  | 11,220,000  | 貸付株式数 900株    |
| 日本ドライケミカル  | 1,700   | 1,600.00  | 2,720,000   | 貸付株式数 200株    |
| 住友林業       | 52,600  | 1,238.00  | 65,118,800  |               |
| 日本基礎技術     | 7,300   | 407.00    | 2,971,100   |               |
| 巴コーポレーション  | 9,200   | 375.00    | 3,450,000   |               |
| 大和ハウス      | 203,100 | 2,646.50  | 537,504,150 |               |
| ライト工業      | 11,900  | 1,429.00  | 17,005,100  |               |
| 積水ハウス      | 221,300 | 2,019.00  | 446,804,700 |               |
| 日特建設       | 5,400   | 720.00    | 3,888,000   |               |
| 北陸電気工事     | 3,500   | 951.00    | 3,328,500   |               |
| ユアテック      | 11,300  | 616.00    | 6,960,800   |               |
| 四電工        | 1,000   | 2,399.00  | 2,399,000   |               |
| 中電工        | 7,700   | 2,219.00  | 17,086,300  |               |
| 関電工        | 29,000  | 943.00    | 27,347,000  |               |
| きんでん       | 48,600  | 1,763.00  | 85,681,800  |               |
| 東京エネシス     | 6,800   | 790.00    | 5,372,000   |               |
| トーエネック     | 2,000   | 3,575.00  | 7,150,000   |               |
| 住友電設       | 5,800   | 2,244.00  | 13,015,200  |               |
| 日本電設工業     | 11,500  | 2,403.00  | 27,634,500  |               |
| 協和エクシオ     | 31,600  | 2,485.00  | 78,526,000  |               |
| 新日本空調      | 5,500   | 2,401.00  | 13,205,500  |               |
| 日本工営       | 4,300   | 2,914.00  | 12,530,200  |               |
| 九電工        | 14,500  | 2,907.00  | 42,151,500  |               |
| 三機工業       | 15,000  | 1,266.00  | 18,990,000  |               |
| 日揮ホールディングス | 63,400  | 1,122.00  | 71,134,800  |               |
| 中外炉工業      | 2,200   | 1,482.00  | 3,260,400   |               |
| ヤマト        | 6,600   | 620.00    | 4,092,000   |               |

|                    |        |          |             |                      |
|--------------------|--------|----------|-------------|----------------------|
| 太平電業               | 5,000  | 2,230.00 | 11,150,000  |                      |
| 高砂熱学               | 18,000 | 1,730.00 | 31,140,000  |                      |
| 三晃金属               | 800    | 2,052.00 | 1,641,600   |                      |
| N E C ネットエスアイ      | 18,600 | 1,972.00 | 36,679,200  |                      |
| 朝日工業社              | 1,400  | 2,966.00 | 4,152,400   | 貸付株式数 500株           |
| 明星工業               | 13,400 | 744.00   | 9,969,600   |                      |
| 大 氣 社              | 10,200 | 3,125.00 | 31,875,000  |                      |
| ダイダン               | 4,900  | 2,737.00 | 13,411,300  |                      |
| 日比谷総合設備            | 6,800  | 1,795.00 | 12,206,000  | 貸付株式数 900株           |
| 日本製粉               | 18,900 | 1,592.00 | 30,088,800  |                      |
| 日清製粉G本社            | 74,800 | 1,632.00 | 122,073,600 |                      |
| 日東富士製粉             | 400    | 6,180.00 | 2,472,000   |                      |
| 昭和産業               | 5,800  | 3,240.00 | 18,792,000  | 貸付株式数 2,400株         |
| 鳥越製粉               | 5,500  | 849.00   | 4,669,500   | 貸付株式数 2,200株         |
| 中部飼料               | 8,200  | 1,546.00 | 12,677,200  |                      |
| フィード・ワン            | 45,000 | 190.00   | 8,550,000   |                      |
| 東洋精糖               | 1,200  | 1,254.00 | 1,504,800   |                      |
| 日本甜菜糖              | 3,100  | 1,676.00 | 5,195,600   |                      |
| 三井製糖               | 5,400  | 2,005.00 | 10,827,000  | 貸付株式数 2,200株         |
| 塩水港精糖              | 6,400  | 206.00   | 1,318,400   | 貸付株式数 2,400株         |
| 日新製糖               | 2,900  | 1,880.00 | 5,452,000   |                      |
| L I F U L L        | 22,200 | 401.00   | 8,902,200   |                      |
| ジェイエシーリクルート<br>メント | 4,300  | 1,136.00 | 4,884,800   | 貸付株式数 1,700株         |
| 日本M & A センター       | 47,900 | 4,635.00 | 222,016,500 | 貸付株式数 19,000株        |
| メンバーズ              | 1,900  | 1,465.00 | 2,783,500   |                      |
| 中広                 | 600    | 546.00   | 327,600     | 貸付株式数 200株           |
| アイティメディア           | 2,000  | 1,423.00 | 2,846,000   | 貸付株式数 800株<br>(200株) |
| タケエイ               | 6,200  | 905.00   | 5,611,000   |                      |
| E・Jホールディングス        | 1,200  | 1,430.00 | 1,716,000   |                      |
| ビーネックスグループ         | 8,000  | 840.00   | 6,720,000   |                      |
| コシダカホールディングス       | 15,300 | 441.00   | 6,747,300   | 貸付株式数 6,100株         |
| アルトナー              | 1,800  | 876.00   | 1,576,800   |                      |
| パソナグループ            | 7,000  | 1,120.00 | 7,840,000   | 貸付株式数 2,700株         |
| C D S              | 1,600  | 1,242.00 | 1,987,200   | 貸付株式数 400株           |
| リンクアンドモチベーショ<br>ン  | 14,600 | 404.00   | 5,898,400   | 貸付株式数 5,600株         |
| G C A              | 7,800  | 632.00   | 4,929,600   |                      |
| エス・エム・エス           | 19,900 | 2,458.00 | 48,914,200  |                      |

|              |        |          |             |       |                |
|--------------|--------|----------|-------------|-------|----------------|
| サニーサイドアップG   | 1,900  | 772.00   | 1,466,800   | 貸付株式数 | 700株           |
| パーソルホールディングス | 63,400 | 1,360.00 | 86,224,000  | 貸付株式数 | 24,500株        |
| リニカル         | 3,200  | 861.00   | 2,755,200   | 貸付株式数 | 1,200株         |
| クックパッド       | 22,600 | 293.00   | 6,621,800   | 貸付株式数 | 8,700株         |
| エスクリ         | 2,000  | 393.00   | 786,000     | 貸付株式数 | 700株           |
| アイ・ケイ・ケイ     | 3,100  | 570.00   | 1,767,000   | 貸付株式数 | 700株<br>(200株) |
| 森永製菓         | 15,500 | 4,270.00 | 66,185,000  |       |                |
| 中村屋          | 1,700  | 4,005.00 | 6,808,500   |       |                |
| 江崎グリコ        | 19,500 | 5,080.00 | 99,060,000  |       |                |
| 名糖産業         | 3,300  | 1,303.00 | 4,299,900   |       |                |
| 井村屋グループ      | 2,800  | 2,001.00 | 5,602,800   | 貸付株式数 | 600株           |
| 不二家          | 3,600  | 2,191.00 | 7,887,600   | 貸付株式数 | 1,400株         |
| 山崎製パン        | 49,600 | 1,854.00 | 91,958,400  | 貸付株式数 | 19,800株        |
| 第一屋製パン       | 1,300  | 951.00   | 1,236,300   | 貸付株式数 | 400株           |
| モロゾフ         | 1,100  | 5,480.00 | 6,028,000   | 貸付株式数 | 400株           |
| 亀田製菓         | 3,700  | 5,120.00 | 18,944,000  |       |                |
| 寿スピリッツ       | 6,400  | 4,550.00 | 29,120,000  |       |                |
| カルビー         | 29,900 | 2,926.00 | 87,487,400  |       |                |
| 森永乳業         | 12,200 | 4,630.00 | 56,486,000  |       |                |
| 六甲バター        | 4,200  | 1,509.00 | 6,337,800   |       |                |
| ヤクルト         | 45,300 | 6,890.00 | 312,117,000 |       |                |
| 明治ホールディングス   | 43,400 | 8,290.00 | 359,786,000 |       |                |
| 雪印メグミルク      | 16,100 | 2,622.00 | 42,214,200  |       |                |
| プリマハム        | 10,300 | 2,655.00 | 27,346,500  | 貸付株式数 | 2,700株         |
| 日本ハム         | 25,100 | 4,075.00 | 102,282,500 |       |                |
| 林兼産業         | 2,300  | 554.00   | 1,274,200   | 貸付株式数 | 800株           |
| 丸大食品         | 7,000  | 1,886.00 | 13,202,000  | 貸付株式数 | 2,500株         |
| S Foods      | 5,100  | 2,593.00 | 13,224,300  | 貸付株式数 | 2,000株         |
| 伊藤ハム米久HLDGS  | 40,300 | 628.00   | 25,308,400  |       |                |
| 学情           | 2,400  | 1,183.00 | 2,839,200   |       |                |
| スタジオアリス      | 3,200  | 1,615.00 | 5,168,000   | 貸付株式数 | 1,200株         |
| クロスキャット      | 1,800  | 1,052.00 | 1,893,600   | 貸付株式数 | 600株           |
| シミックホールディングス | 3,600  | 1,450.00 | 5,220,000   |       |                |
| システナ         | 23,500 | 1,454.00 | 34,169,000  |       |                |
| NJS          | 1,400  | 1,779.00 | 2,490,600   | 貸付株式数 | 400株           |
| デジタルアーツ      | 3,300  | 8,130.00 | 26,829,000  | 貸付株式数 | 1,200株         |
| 日鉄ソリューションズ   | 10,000 | 2,824.00 | 28,240,000  |       |                |
| 総合警備保障       | 25,100 | 5,080.00 | 127,508,000 |       |                |
| キューブシステム     | 3,500  | 758.00   | 2,653,000   | 貸付株式数 | 1,300株         |

|               |         |          |             |       |                |
|---------------|---------|----------|-------------|-------|----------------|
| いちご           | 83,300  | 274.00   | 22,824,200  |       |                |
| エイジア          | 1,400   | 1,254.00 | 1,755,600   | 貸付株式数 | 400株           |
| 日本駐車場開発       | 69,700  | 134.00   | 9,339,800   |       |                |
| コア            | 2,800   | 1,102.00 | 3,085,600   |       |                |
| カカクコム         | 46,700  | 2,604.00 | 121,606,800 | 貸付株式数 | 18,600株        |
| アイロムグループ      | 2,400   | 3,125.00 | 7,500,000   | 貸付株式数 | 900株           |
| セントケア・ホールディング | 3,900   | 401.00   | 1,563,900   | 貸付株式数 | 300株           |
| サイネックス        | 1,100   | 662.00   | 728,200     |       |                |
| ルネサンス         | 3,500   | 1,043.00 | 3,650,500   |       |                |
| ディップ          | 9,000   | 2,161.00 | 19,449,000  | 貸付株式数 | 3,600株         |
| SBSホールディングス   | 5,700   | 2,250.00 | 12,825,000  |       |                |
| オプトホールディング    | 3,400   | 1,406.00 | 4,780,400   | 貸付株式数 | 1,300株         |
| 新日本科学         | 7,100   | 664.00   | 4,714,400   | 貸付株式数 | 2,700株         |
| ツクイ           | 15,000  | 512.00   | 7,680,000   |       |                |
| キャリアデザインセンター  | 1,700   | 950.00   | 1,615,000   |       |                |
| ベネフィット・ワン     | 17,300  | 2,020.00 | 34,946,000  | 貸付株式数 | 6,900株         |
| エムスリー         | 138,700 | 4,330.00 | 600,571,000 | 貸付株式数 | 54,100株        |
| ツカダ・グローバルHOLD | 3,700   | 325.00   | 1,202,500   | 貸付株式数 | 1,500株         |
| プラス           | 700     | 464.00   | 324,800     |       |                |
| アウトソーシング      | 36,800  | 631.00   | 23,220,800  |       |                |
| ウェルネット        | 6,600   | 702.00   | 4,633,200   | 貸付株式数 | 2,600株         |
| ワールドホールディングス  | 2,300   | 1,673.00 | 3,847,900   | 貸付株式数 | 800株<br>(100株) |
| ディー・エヌ・エー     | 31,100  | 1,424.00 | 44,286,400  |       |                |
| 博報堂DYHLDGS    | 87,800  | 1,209.00 | 106,150,200 |       |                |
| ぐるなび          | 11,100  | 690.00   | 7,659,000   |       |                |
| タカミヤ          | 6,700   | 472.00   | 3,162,400   | 貸付株式数 | 2,600株         |
| ジャパンベストレスキュー  | 4,500   | 823.00   | 3,703,500   | 貸付株式数 | 100株           |
| ファンコミュニケーションズ | 18,000  | 440.00   | 7,920,000   |       |                |
| ライク           | 2,300   | 1,532.00 | 3,523,600   | 貸付株式数 | 900株           |
| ビジネス・ブレークスルー  | 3,200   | 356.00   | 1,139,200   | 貸付株式数 | 1,000株         |
| エスプール         | 12,400  | 717.00   | 8,890,800   |       |                |
| WDBホールディングス   | 3,000   | 2,631.00 | 7,893,000   |       |                |
| ティア           | 3,600   | 497.00   | 1,789,200   |       |                |
| CDG           | 700     | 1,537.00 | 1,075,900   | 貸付株式数 | 200株<br>(200株) |

|                 |         |          |             |                             |
|-----------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| バリューコマース        | 3,600   | 2,735.00 | 9,846,000   | 貸付株式数<br>1,400株<br>(1,300株) |
| インフォマート         | 69,900  | 853.00   | 59,624,700  | 貸付株式数<br>26,900株            |
| サッポロホールディングス    | 22,400  | 1,962.00 | 43,948,800  |                             |
| アサヒグループホールディングン | 137,600 | 3,896.00 | 536,089,600 |                             |
| キリンHD           | 278,600 | 2,242.00 | 624,621,200 | 貸付株式数<br>5,400株             |
| 宝ホールディングス       | 49,200  | 930.00   | 45,756,000  |                             |
| オエノンホールディングス    | 18,000  | 392.00   | 7,056,000   |                             |
| 養命酒             | 1,900   | 1,834.00 | 3,484,600   |                             |
| コカ・コーラボトラーズJHD  | 46,300  | 2,067.00 | 95,702,100  |                             |
| サントリー食品インター     | 43,700  | 4,215.00 | 184,195,500 |                             |
| ダイドーグループHD      | 3,400   | 4,780.00 | 16,252,000  | 貸付株式数<br>1,300株             |
| 伊藤園             | 20,200  | 6,060.00 | 122,412,000 | 貸付株式数<br>8,200株             |
| キーコーヒー          | 6,500   | 2,282.00 | 14,833,000  |                             |
| ユニカフェ           | 1,600   | 957.00   | 1,531,200   | 貸付株式数<br>100株               |
| ジャパンフーズ         | 900     | 1,144.00 | 1,029,600   | 貸付株式数<br>100株               |
| 日清オイリオグループ      | 8,500   | 3,295.00 | 28,007,500  |                             |
| 不二製油グループ        | 16,200  | 2,713.00 | 43,950,600  |                             |
| かどや製油           | 700     | 3,620.00 | 2,534,000   | 貸付株式数<br>100株               |
| J-オイルミルズ        | 3,400   | 3,990.00 | 13,566,000  |                             |
| ローソン            | 16,400  | 5,850.00 | 95,940,000  | 貸付株式数<br>6,400株             |
| サンエー            | 5,200   | 4,185.00 | 21,762,000  | 貸付株式数<br>800株               |
| カワチ薬品           | 5,100   | 2,647.00 | 13,499,700  | 貸付株式数<br>2,000株             |
| エービーシー・マート      | 10,200  | 6,220.00 | 63,444,000  |                             |
| ハードオフコーポレーション   | 2,400   | 695.00   | 1,668,000   |                             |
| 高千穂交易           | 2,400   | 942.00   | 2,260,800   |                             |
| アスクル            | 6,800   | 3,640.00 | 24,752,000  | 貸付株式数<br>900株               |
| ゲオホールディングス      | 11,900  | 1,308.00 | 15,565,200  |                             |
| アダストリア          | 9,100   | 1,627.00 | 14,805,700  |                             |
| ジーフット           | 4,400   | 454.00   | 1,997,600   | 貸付株式数<br>1,600株             |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア  | 1,000   | 500.00   | 500,000     | 貸付株式数<br>400株               |
| 伊藤忠食品           | 1,600   | 4,875.00 | 7,800,000   | 貸付株式数<br>600株               |
| くら寿司            | 3,400   | 4,835.00 | 16,439,000  | 貸付株式数<br>1,300株<br>(1,300株) |
| キャンドウ           | 3,200   | 2,053.00 | 6,569,600   | 貸付株式数<br>1,200株<br>(600株)   |

|                |         |          |             |                        |
|----------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| エレマテック         | 6,100   | 862.00   | 5,258,200   |                        |
| パルグループHLDGS    | 6,700   | 1,304.00 | 8,736,800   |                        |
| JALUX          | 1,800   | 1,714.00 | 3,085,200   | 貸付株式数 700株             |
| エディオン          | 29,800  | 1,000.00 | 29,800,000  | 貸付株式数 11,900株          |
| あらた            | 5,200   | 4,415.00 | 22,958,000  |                        |
| サーラコーポレーション    | 13,500  | 549.00   | 7,411,500   |                        |
| ワッツ            | 2,800   | 858.00   | 2,402,400   | 貸付株式数 1,100株<br>(400株) |
| トーメンデバイス       | 1,000   | 3,315.00 | 3,315,000   | 貸付株式数 300株             |
| ハローズ           | 2,400   | 3,020.00 | 7,248,000   | 貸付株式数 900株             |
| J Pホールディングス    | 20,200  | 272.00   | 5,494,400   | 貸付株式数 7,800株           |
| フジオフードシステム     | 5,600   | 1,512.00 | 8,467,200   | 貸付株式数 2,100株           |
| あみやき亭          | 1,400   | 3,030.00 | 4,242,000   | 貸付株式数 500株             |
| 東京エレクトロデバイス    | 2,300   | 2,675.00 | 6,152,500   |                        |
| ひらまつ           | 11,800  | 180.00   | 2,124,000   |                        |
| フィールズ          | 4,600   | 331.00   | 1,522,600   | 貸付株式数 1,800株           |
| 双日             | 355,400 | 238.00   | 84,585,200  |                        |
| アルフレッサホールディングス | 72,400  | 2,207.00 | 159,786,800 |                        |
| 大黒天物産          | 1,500   | 4,425.00 | 6,637,500   | 貸付株式数 600株             |
| ハニーズホールディングス   | 5,800   | 1,050.00 | 6,090,000   | 貸付株式数 2,100株           |
| ファーマライズHD      | 1,500   | 651.00   | 976,500     |                        |
| キッコーマン         | 47,400  | 4,950.00 | 234,630,000 | 貸付株式数 18,500株          |
| 味の素            | 144,600 | 1,796.00 | 259,701,600 |                        |
| キューピー          | 36,200  | 2,050.00 | 74,210,000  | 貸付株式数 14,700株          |
| ハウス食品G本社       | 24,900  | 3,515.00 | 87,523,500  |                        |
| カゴメ            | 25,100  | 2,996.00 | 75,199,600  | 貸付株式数 10,000株          |
| 焼津水産化工         | 3,000   | 934.00   | 2,802,000   |                        |
| アリアケジャパン       | 6,100   | 6,780.00 | 41,358,000  |                        |
| ピエトロ           | 700     | 1,627.00 | 1,138,900   |                        |
| エバラ食品工業        | 1,500   | 2,158.00 | 3,237,000   | 貸付株式数 500株             |
| やまみ            | 500     | 1,966.00 | 983,000     |                        |
| ニチレイ           | 31,400  | 2,996.00 | 94,074,400  |                        |
| 横浜冷凍           | 16,600  | 892.00   | 14,807,200  |                        |
| 東洋水産           | 34,100  | 5,690.00 | 194,029,000 |                        |
| イトアアンド         | 2,300   | 1,760.00 | 4,048,000   | 貸付株式数 800株             |
| 大冷             | 800     | 1,989.00 | 1,591,200   | 貸付株式数 300株             |
| ヨシムラ・フード・HLDGS | 3,800   | 1,040.00 | 3,952,000   | 貸付株式数 1,200株           |
| 日清食品HD         | 27,900  | 9,040.00 | 252,216,000 |                        |

|               |         |          |             |                              |
|---------------|---------|----------|-------------|------------------------------|
| 永谷園ホールディングス   | 3,400   | 2,132.00 | 7,248,800   |                              |
| 一正蒲鉾          | 2,600   | 1,022.00 | 2,657,200   | 貸付株式数<br>1,000株<br>(800株)    |
| フジッコ          | 7,100   | 1,924.00 | 13,660,400  |                              |
| ロックフィールド      | 7,300   | 1,285.00 | 9,380,500   | 貸付株式数<br>400株<br>(100株)      |
| 日本たばこ産業       | 376,900 | 2,104.50 | 793,186,050 | 貸付株式数<br>150,400株            |
| ケンコーマヨネーズ     | 3,700   | 2,007.00 | 7,425,900   |                              |
| わらべや日洋HD      | 4,400   | 1,674.00 | 7,365,600   | 貸付株式数<br>1,600株              |
| なとり           | 3,900   | 1,719.00 | 6,704,100   | 貸付株式数<br>100株                |
| イフジ産業         | 1,000   | 800.00   | 800,000     | 貸付株式数<br>400株                |
| ピックルスコーポレーション | 1,500   | 2,305.00 | 3,457,500   | 貸付株式数<br>500株<br>(400株)      |
| 北の達人コーポ       | 23,500  | 547.00   | 12,854,500  | 貸付株式数<br>9,300株              |
| ユーグレナ         | 28,700  | 762.00   | 21,869,400  | 貸付株式数<br>11,400株             |
| ADワークスグループ    | 15,900  | 169.00   | 2,687,100   |                              |
| 片倉工業          | 9,600   | 1,153.00 | 11,068,800  |                              |
| グ ン ゼ         | 4,600   | 3,760.00 | 17,296,000  | 貸付株式数<br>1,200株              |
| ヒューリック        | 137,100 | 1,018.00 | 139,567,800 | 貸付株式数<br>55,500株             |
| 神 栄           | 1,000   | 481.00   | 481,000     | 貸付株式数<br>100株                |
| ラサ商事          | 3,300   | 853.00   | 2,814,900   |                              |
| アルペン          | 5,200   | 1,789.00 | 9,302,800   | 貸付株式数<br>2,000株              |
| ハブ            | 1,900   | 671.00   | 1,274,900   | 貸付株式数<br>700株                |
| ラクーンホールディングス  | 3,200   | 788.00   | 2,521,600   |                              |
| クオールホールディングス  | 9,700   | 1,156.00 | 11,213,200  | 貸付株式数<br>3,700株              |
| アルコニックス       | 7,000   | 1,159.00 | 8,113,000   | 貸付株式数<br>2,700株              |
| 神戸物産          | 22,600  | 6,050.00 | 136,730,000 | 貸付株式数<br>8,900株              |
| ソリトンシステムズ     | 3,100   | 1,447.00 | 4,485,700   | 貸付株式数<br>1,100株              |
| ジンスホールディングス   | 3,500   | 6,230.00 | 21,805,000  | 貸付株式数<br>1,300株              |
| ビックカメラ        | 38,200  | 1,100.00 | 42,020,000  |                              |
| DCMホールディングス   | 35,200  | 1,094.00 | 38,508,800  | 貸付株式数<br>14,800株<br>(4,700株) |
| ペッパーフードサービス   | 5,700   | 578.00   | 3,294,600   | 貸付株式数<br>2,200株<br>(300株)    |
| Monotaro      | 46,400  | 4,130.00 | 191,632,000 | 貸付株式数<br>18,400株             |
| 東京一番フーズ       | 1,500   | 497.00   | 745,500     | 貸付株式数<br>600株<br>(600株)      |
| DDホールディングス    | 2,700   | 910.00   | 2,457,000   |                              |
| あい ホールディングス   | 9,500   | 1,511.00 | 14,354,500  |                              |
| ディービーエックス     | 2,200   | 872.00   | 1,918,400   |                              |

|                |         |          |             |       |                    |
|----------------|---------|----------|-------------|-------|--------------------|
| きちりホールディングス    | 1,700   | 607.00   | 1,031,900   | 貸付株式数 | 400株               |
| アークランドサービスHD   | 4,900   | 1,898.00 | 9,300,200   | 貸付株式数 | 1,900株             |
| J. フロント リテイリング | 76,600  | 861.00   | 65,952,600  |       |                    |
| ドトール・日レスHD     | 9,900   | 1,722.00 | 17,047,800  | 貸付株式数 | 4,000株             |
| マツモトキヨシHLDGS   | 27,000  | 3,835.00 | 103,545,000 | 貸付株式数 | 10,400株            |
| ブロンコビリー        | 3,400   | 2,530.00 | 8,602,000   | 貸付株式数 | 1,300株             |
| ZOZO           | 44,800  | 2,220.00 | 99,456,000  |       |                    |
| トレジャー・ファクトリー   | 2,000   | 683.00   | 1,366,000   |       |                    |
| 物語コーポレーション     | 1,800   | 8,220.00 | 14,796,000  | 貸付株式数 | 700株<br>(100株)     |
| ココカラファイン       | 6,800   | 5,750.00 | 39,100,000  |       |                    |
| 三越伊勢丹HD        | 114,200 | 681.00   | 77,770,200  |       |                    |
| 東洋紡            | 25,300  | 1,437.00 | 36,356,100  |       |                    |
| ユニチカ           | 19,800  | 340.00   | 6,732,000   | 貸付株式数 | 7,400株             |
| 富士紡ホールディングス    | 3,200   | 3,085.00 | 9,872,000   |       |                    |
| 日清紡ホールディングス    | 43,400  | 775.00   | 33,635,000  |       |                    |
| 倉敷紡績           | 6,500   | 2,256.00 | 14,664,000  | 貸付株式数 | 100株               |
| ダイワボウHD        | 5,500   | 7,450.00 | 40,975,000  |       |                    |
| シキボウ           | 4,000   | 961.00   | 3,844,000   |       |                    |
| 日東紡績           | 9,800   | 4,910.00 | 48,118,000  | 貸付株式数 | 4,000株             |
| トヨタ紡織          | 18,400  | 1,401.00 | 25,778,400  |       |                    |
| マクニカ・富士エレHLDGS | 15,200  | 1,492.00 | 22,678,400  |       |                    |
| Hamee          | 2,400   | 1,898.00 | 4,555,200   | 貸付株式数 | 900株               |
| ラクト・ジャパン       | 2,500   | 3,690.00 | 9,225,000   | 貸付株式数 | 500株<br>(500株)     |
| ウエルシアHD        | 19,400  | 8,950.00 | 173,630,000 |       |                    |
| クリエイトSDH       | 10,900  | 3,420.00 | 37,278,000  | 貸付株式数 | 3,600株             |
| バイタルKSKHD      | 11,000  | 1,061.00 | 11,671,000  |       |                    |
| 八洲電機           | 4,900   | 877.00   | 4,297,300   | 貸付株式数 | 1,800株             |
| メディアスホールディングス  | 3,600   | 912.00   | 3,283,200   | 貸付株式数 | 1,400株             |
| レスターホールディングス   | 6,400   | 2,110.00 | 13,504,000  |       |                    |
| ジューテックHD       | 1,700   | 979.00   | 1,664,300   | 貸付株式数 | 600株               |
| 丸善CHI HD       | 8,000   | 390.00   | 3,120,000   | 貸付株式数 | 3,100株             |
| 大光             | 2,800   | 663.00   | 1,856,400   | 貸付株式数 | 1,100株<br>(1,000株) |
| OCHIホールディングス   | 1,900   | 1,454.00 | 2,762,600   |       |                    |

|                   |        |          |             |       |                     |
|-------------------|--------|----------|-------------|-------|---------------------|
| ＴＯＫＡＩホールディングス     | 35,000 | 958.00   | 33,530,000  |       |                     |
| 黒谷                | 1,600  | 519.00   | 830,400     | 貸付株式数 | 500株                |
| ミサワ               | 1,600  | 481.00   | 769,600     |       |                     |
| ティーライフ            | 900    | 1,024.00 | 921,600     | 貸付株式数 | 300株<br>(300株)      |
| Cominix           | 1,000  | 705.00   | 705,000     | 貸付株式数 | 400株                |
| エー・ピーカンパニー        | 1,500  | 466.00   | 699,000     |       |                     |
| 三洋貿易              | 6,500  | 984.00   | 6,396,000   |       |                     |
| チムニー              | 2,000  | 1,634.00 | 3,268,000   | 貸付株式数 | 700株                |
| シュッピン             | 4,600  | 725.00   | 3,335,000   |       |                     |
| ビューティガレージ         | 1,100  | 1,483.00 | 1,631,300   |       |                     |
| ウイン・パートナーズ        | 4,700  | 897.00   | 4,215,900   | 貸付株式数 | 1,700株              |
| ネクステージ            | 9,500  | 770.00   | 7,315,000   | 貸付株式数 | 3,800株              |
| ジョイフル本田           | 19,000 | 1,341.00 | 25,479,000  | 貸付株式数 | 7,600株<br>(100株)    |
| 鳥貴族               | 2,300  | 1,570.00 | 3,611,000   |       |                     |
| キリン堂ホールディングス      | 2,600  | 2,194.00 | 5,704,400   | 貸付株式数 | 900株                |
| ホットランド            | 4,500  | 1,195.00 | 5,377,500   | 貸付株式数 | 1,700株              |
| すかいらくHD           | 73,000 | 1,754.00 | 128,042,000 | 貸付株式数 | 29,100株<br>(2,800株) |
| SFPホールディングス       | 2,800  | 1,546.00 | 4,328,800   | 貸付株式数 | 1,100株              |
| 綿半ホールディングス        | 2,400  | 1,781.00 | 4,274,400   | 貸付株式数 | 900株                |
| 日本毛織              | 21,000 | 996.00   | 20,916,000  | 貸付株式数 | 8,100株              |
| ダイトウボウ            | 12,100 | 119.00   | 1,439,900   | 貸付株式数 | 4,100株              |
| トーア紡コーポレーション      | 2,600  | 474.00   | 1,232,400   | 貸付株式数 | 1,000株              |
| ダイドーリミテッド         | 9,700  | 211.00   | 2,046,700   |       |                     |
| ヨシックス             | 1,100  | 2,038.00 | 2,241,800   | 貸付株式数 | 400株                |
| ユナイテッド・スーパー<br>マケ | 18,700 | 1,124.00 | 21,018,800  | 貸付株式数 | 7,400株              |
| 三栄建築設計            | 3,000  | 1,198.00 | 3,594,000   |       |                     |
| 野村不動産HLDGS        | 39,200 | 1,946.00 | 76,283,200  |       |                     |
| 三重交通グループHD        | 13,300 | 463.00   | 6,157,900   | 貸付株式数 | 3,500株              |
| サムティ              | 9,500  | 1,290.00 | 12,255,000  |       |                     |
| 日本商業開発            | 4,700  | 1,448.00 | 6,805,600   |       |                     |
| プレサンスコーポレーシ<br>ョン | 11,200 | 1,120.00 | 12,544,000  | 貸付株式数 | 4,200株              |
| 日本管理センター          | 4,700  | 1,183.00 | 5,560,100   | 貸付株式数 | 1,600株              |
| サンセイランディック        | 2,500  | 825.00   | 2,062,500   | 貸付株式数 | 700株                |
| エストラスト            | 1,400  | 621.00   | 869,400     | 貸付株式数 | 300株                |

|                       |         |           |             |       |                    |
|-----------------------|---------|-----------|-------------|-------|--------------------|
| フージャースHD              | 13,600  | 518.00    | 7,044,800   | 貸付株式数 | 5,300株             |
| オープンハウス               | 19,100  | 3,365.00  | 64,271,500  |       |                    |
| 東急不動産HD               | 175,500 | 521.00    | 91,435,500  |       |                    |
| 飯田GH D                | 53,000  | 1,643.00  | 87,079,000  | 貸付株式数 | 21,100株            |
| イーグランド                | 1,900   | 673.00    | 1,278,700   |       |                    |
| 帝国繊維                  | 7,300   | 2,189.00  | 15,979,700  |       |                    |
| 日本コークス工業              | 56,000  | 63.00     | 3,528,000   |       |                    |
| ゴルフダイジェスト・オン          | 2,900   | 560.00    | 1,624,000   | 貸付株式数 | 1,100株             |
| ミタチ産業                 | 1,700   | 595.00    | 1,011,500   | 貸付株式数 | 600株               |
| B E E N O S           | 2,500   | 951.00    | 2,377,500   | 貸付株式数 | 1,000株             |
| あさひ                   | 4,800   | 1,436.00  | 6,892,800   |       |                    |
| 日本調剤                  | 4,000   | 1,588.00  | 6,352,000   |       |                    |
| コスモス薬品                | 5,800   | 16,720.00 | 96,976,000  | 貸付株式数 | 200株               |
| シップヘルスケアHD            | 10,500  | 4,375.00  | 45,937,500  |       |                    |
| トーエル                  | 3,000   | 694.00    | 2,082,000   | 貸付株式数 | 1,200株             |
| ソフトクリエイイトHD           | 2,900   | 2,079.00  | 6,029,100   |       |                    |
| オンリー                  | 1,100   | 601.00    | 661,100     |       |                    |
| セブン&アイ・H L D G S      | 252,200 | 3,579.00  | 902,623,800 |       |                    |
| クリエイイト・レストラン<br>ツ・ホール | 35,600  | 755.00    | 26,878,000  | 貸付株式数 | 13,900株            |
| 明治電機工業                | 1,800   | 1,422.00  | 2,559,600   | 貸付株式数 | 600株               |
| ツルハホールディングス           | 14,200  | 15,780.00 | 224,076,000 | 貸付株式数 | 5,600株             |
| デリカフーズH L D G S       | 2,200   | 614.00    | 1,350,800   | 貸付株式数 | 200株               |
| スターティアホールディング<br>ス    | 1,700   | 603.00    | 1,025,100   | 貸付株式数 | 500株               |
| サンマルクホールディング<br>ス     | 5,100   | 1,742.00  | 8,884,200   |       |                    |
| フェリシモ                 | 1,400   | 1,096.00  | 1,534,400   | 貸付株式数 | 400株               |
| トリドールホールディング<br>ス     | 16,400  | 1,241.00  | 20,352,400  | 貸付株式数 | 6,400株<br>(1,600株) |
| 帝 人                   | 51,800  | 1,710.00  | 88,578,000  | 貸付株式数 | 4,900株             |
| 東 レ                   | 463,600 | 498.60    | 231,150,960 |       |                    |
| ク ラ レ                 | 100,500 | 1,158.00  | 116,379,000 | 貸付株式数 | 40,800株            |
| 旭 化 成                 | 425,200 | 853.20    | 362,780,640 |       |                    |
| サカイオーベックス             | 1,700   | 2,096.00  | 3,563,200   |       |                    |
| T O K Y O B A S E     | 6,000   | 346.00    | 2,076,000   |       |                    |
| 稲葉製作所                 | 3,600   | 1,352.00  | 4,867,200   | 貸付株式数 | 1,500株             |
| 宮地エンジニアリングG           | 1,900   | 1,574.00  | 2,990,600   | 貸付株式数 | 700株               |
| トーカロ                  | 18,200  | 1,061.00  | 19,310,200  |       |                    |
| アルファCO                | 2,200   | 910.00    | 2,002,000   |       |                    |

|                 |        |          |             |       |                |
|-----------------|--------|----------|-------------|-------|----------------|
| SUMCO           | 76,700 | 1,517.00 | 116,353,900 | 貸付株式数 | 30,700株        |
| 川田テクノロジーズ       | 1,300  | 4,850.00 | 6,305,000   |       |                |
| RS TECHNOLOGIES | 1,900  | 3,130.00 | 5,947,000   |       |                |
| 信和              | 2,800  | 721.00   | 2,018,800   |       |                |
| ビーロット           | 3,400  | 664.00   | 2,257,600   | 貸付株式数 | 1,200株         |
| ファーストブラザーズ      | 1,500  | 683.00   | 1,024,500   | 貸付株式数 | 100株           |
| ハウスドゥ           | 3,500  | 992.00   | 3,472,000   | 貸付株式数 | 1,200株         |
| シーアールイー         | 2,000  | 1,228.00 | 2,456,000   | 貸付株式数 | 600株           |
| プロパティエージェント     | 1,300  | 981.00   | 1,275,300   | 貸付株式数 | 400株           |
| ケイアイスター不動産      | 2,400  | 1,636.00 | 3,926,400   | 貸付株式数 | 800株           |
| アグレ都市デザイン       | 2,200  | 451.00   | 992,200     | 貸付株式数 | 400株           |
| ジェイ・エス・ビー       | 1,600  | 2,397.00 | 3,835,200   |       |                |
| テンポイノベーション      | 1,700  | 641.00   | 1,089,700   | 貸付株式数 | 600株           |
| グローバルリンクマネジメント  | 1,400  | 606.00   | 848,400     | 貸付株式数 | 400株           |
| 住江織物            | 1,400  | 2,044.00 | 2,861,600   | 貸付株式数 | 400株           |
| 日本フェルト          | 3,300  | 473.00   | 1,560,900   | 貸付株式数 | 1,000株         |
| イチカワ            | 900    | 1,283.00 | 1,154,700   | 貸付株式数 | 100株           |
| エコナックホールディングス   | 13,500 | 97.00    | 1,309,500   |       |                |
| 日東製網            | 800    | 1,337.00 | 1,069,600   |       |                |
| 芦森工業            | 1,300  | 883.00   | 1,147,900   | 貸付株式数 | 500株           |
| アツギ             | 5,200  | 597.00   | 3,104,400   |       |                |
| ウイルプラスHLDGS     | 1,100  | 708.00   | 778,800     | 貸付株式数 | 200株           |
| JMホールディングス      | 3,300  | 2,711.00 | 8,946,300   | 貸付株式数 | 1,300株         |
| コメダホールディングス     | 14,500 | 1,835.00 | 26,607,500  | 貸付株式数 | 5,100株         |
| サツドラホールディングス    | 900    | 1,975.00 | 1,777,500   | 貸付株式数 | 100株<br>(100株) |
| アレンザホールディングス    | 3,200  | 866.00   | 2,771,200   | 貸付株式数 | 900株<br>(300株) |
| 串カツ田中HLDGS      | 1,100  | 1,581.00 | 1,739,100   |       |                |
| バロックジャパン        | 4,600  | 620.00   | 2,852,000   | 貸付株式数 | 1,700株         |
| クスリのアオキHLDGS    | 5,900  | 8,550.00 | 50,445,000  | 貸付株式数 | 1,900株         |
| ダイニック           | 2,300  | 719.00   | 1,653,700   |       |                |
| 共和レザー           | 3,400  | 666.00   | 2,264,400   |       |                |
| 力の源HD           | 3,000  | 667.00   | 2,001,000   | 貸付株式数 | 1,100株         |
| スシローグローバルHLDGS  | 28,800 | 2,190.00 | 63,072,000  |       |                |
| LIXILピバ         | 6,600  | 2,593.00 | 17,113,800  |       |                |

|                   |         |          |             |                          |
|-------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| セーレン              | 15,900  | 1,270.00 | 20,193,000  |                          |
| ソトー               | 2,300   | 937.00   | 2,155,100   |                          |
| 東海染工              | 900     | 1,134.00 | 1,020,600   | 貸付株式数 100株               |
| 小松マテーレ            | 10,700  | 711.00   | 7,607,700   | 貸付株式数 1,700株             |
| ワコールホールディングス      | 16,300  | 2,065.00 | 33,659,500  |                          |
| ホギメディカル           | 7,400   | 3,340.00 | 24,716,000  |                          |
| クラウドシアHLDGS       | 1,700   | 417.00   | 708,900     | 貸付株式数 600株               |
| T S Iホールディングス     | 21,000  | 458.00   | 9,618,000   | 貸付株式数 8,500株             |
| マツオカコーポレーション      | 1,900   | 2,127.00 | 4,041,300   | 貸付株式数 700株               |
| ワールド              | 9,200   | 1,539.00 | 14,158,800  |                          |
| T I S             | 65,400  | 2,157.00 | 141,067,800 |                          |
| ネオス               | 2,800   | 683.00   | 1,912,400   | 貸付株式数 1,000株             |
| 電算システム            | 2,500   | 3,315.00 | 8,287,500   | 貸付株式数 900株               |
| グリー               | 40,300  | 440.00   | 17,732,000  |                          |
| コーエーテクモHD         | 13,200  | 3,230.00 | 42,636,000  |                          |
| 三菱総合研究所           | 2,900   | 3,880.00 | 11,252,000  |                          |
| ボルテージ             | 1,900   | 431.00   | 818,900     | 貸付株式数 600株               |
| 電算                | 700     | 2,155.00 | 1,508,500   |                          |
| A G S             | 3,700   | 791.00   | 2,926,700   |                          |
| ファインデックス          | 5,700   | 955.00   | 5,443,500   | 貸付株式数 2,100株             |
| ブレインパッド           | 1,700   | 4,585.00 | 7,794,500   | 貸付株式数 600株               |
| K L a b           | 12,800  | 698.00   | 8,934,400   | 貸付株式数 5,000株             |
| ポルトゥウィン・ピット<br>クル | 8,000   | 874.00   | 6,992,000   | 貸付株式数 900株               |
| イーブックイニシアティブ      | 900     | 2,768.00 | 2,491,200   | 貸付株式数 300株               |
| ネクソン              | 179,600 | 2,379.00 | 427,268,400 |                          |
| アイスタイル            | 18,400  | 282.00   | 5,188,800   | 貸付株式数 6,600株             |
| エムアップホールディング<br>ス | 1,900   | 2,235.00 | 4,246,500   | 貸付株式数 700株               |
| エイチーム             | 4,200   | 819.00   | 3,439,800   |                          |
| エニグモ              | 4,600   | 999.00   | 4,595,400   |                          |
| テクノスジャパン          | 5,300   | 579.00   | 3,068,700   |                          |
| e n i s h         | 3,200   | 543.00   | 1,737,600   |                          |
| コロプラ              | 21,500  | 949.00   | 20,403,500  | 貸付株式数 8,500株<br>(4,500株) |
| オルトプラス            | 4,900   | 418.00   | 2,048,200   | 貸付株式数 1,600株             |
| ブロードリーフ           | 32,900  | 513.00   | 16,877,700  | 貸付株式数 12,700株            |
| クロス・マーケティングG      | 3,200   | 304.00   | 972,800     | 貸付株式数 1,100株             |
| デジタルハーツHLDGS      | 3,700   | 812.00   | 3,004,400   | 貸付株式数 1,300株<br>(1,300株) |

|                 |        |           |             |       |                    |
|-----------------|--------|-----------|-------------|-------|--------------------|
| システム情報          | 3,600  | 1,293.00  | 4,654,800   | 貸付株式数 | 1,200株             |
| メディアドゥ          | 2,000  | 4,565.00  | 9,130,000   | 貸付株式数 | 800株               |
| じげん             | 16,500 | 337.00    | 5,560,500   | 貸付株式数 | 6,500株<br>(100株)   |
| ブイキューブ          | 4,200  | 1,215.00  | 5,103,000   | 貸付株式数 | 1,600株             |
| エンカレッジ・テクノロジー   | 1,300  | 797.00    | 1,036,100   | 貸付株式数 | 100株               |
| サイバーリンクス        | 1,200  | 1,643.00  | 1,971,600   |       |                    |
| ディー・エル・イー       | 4,300  | 485.00    | 2,085,500   |       |                    |
| フィックスターズ        | 7,100  | 1,265.00  | 8,981,500   | 貸付株式数 | 2,700株             |
| CARTA HOLDINGS  | 3,100  | 1,050.00  | 3,255,000   |       |                    |
| オブティム           | 3,400  | 3,255.00  | 11,067,000  | 貸付株式数 | 1,300株             |
| セレス             | 2,300  | 1,186.00  | 2,727,800   | 貸付株式数 | 800株               |
| 特種東海製紙          | 4,200  | 4,265.00  | 17,913,000  |       |                    |
| ティーガイア          | 5,700  | 2,066.00  | 11,776,200  |       |                    |
| セック             | 1,000  | 3,080.00  | 3,080,000   |       |                    |
| 日本アジアグループ       | 7,300  | 291.00    | 2,124,300   |       |                    |
| テクマトリックス        | 4,700  | 3,670.00  | 17,249,000  |       |                    |
| プロシップ           | 1,900  | 1,181.00  | 2,243,900   | 貸付株式数 | 700株               |
| ガンホー・オンライン・エンター | 15,700 | 1,723.00  | 27,051,100  |       |                    |
| GMOペイメントゲートウェイ  | 13,700 | 11,160.00 | 152,892,000 | 貸付株式数 | 5,400株             |
| ザッパラス           | 2,900  | 384.00    | 1,113,600   | 貸付株式数 | 1,300株             |
| システムリサーチ        | 1,800  | 1,893.00  | 3,407,400   |       |                    |
| インターネットイニシアティブ  | 9,700  | 3,835.00  | 37,199,500  |       |                    |
| さくらインターネット      | 6,900  | 603.00    | 4,160,700   | 貸付株式数 | 2,700株             |
| ヴィンクス           | 1,900  | 1,202.00  | 2,283,800   | 貸付株式数 | 100株<br>(100株)     |
| GMOクラウド         | 1,200  | 7,090.00  | 8,508,000   | 貸付株式数 | 400株<br>(400株)     |
| SRAホールディングス     | 3,600  | 2,314.00  | 8,330,400   |       |                    |
| システムインテグレータ     | 2,300  | 837.00    | 1,925,100   |       |                    |
| 朝日ネット           | 4,500  | 1,355.00  | 6,097,500   |       |                    |
| eBASE           | 8,000  | 1,181.00  | 9,448,000   |       |                    |
| アバント            | 4,800  | 1,014.00  | 4,867,200   | 貸付株式数 | 1,800株<br>(1,800株) |
| アドソル日進          | 2,400  | 2,341.00  | 5,618,400   |       |                    |
| フリービット          | 3,700  | 811.00    | 3,000,700   |       |                    |

|                 |         |          |             |                         |
|-----------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| コムチュア           | 7,400   | 2,717.00 | 20,105,800  |                         |
| サイバーコム          | 1,200   | 1,735.00 | 2,082,000   | 貸付株式数<br>400株<br>(400株) |
| アステリア           | 4,400   | 462.00   | 2,032,800   | 貸付株式数<br>1,500株         |
| アイル             | 2,400   | 1,486.00 | 3,566,400   | 貸付株式数<br>900株           |
| 王子ホールディングス      | 268,000 | 500.00   | 134,000,000 |                         |
| 日本製紙            | 27,700  | 1,547.00 | 42,851,900  | 貸付株式数<br>11,800株        |
| 三菱製紙            | 6,200   | 349.00   | 2,163,800   |                         |
| 北越コーポレーション      | 37,700  | 372.00   | 14,024,400  |                         |
| 中越パルプ           | 2,700   | 1,397.00 | 3,771,900   |                         |
| 巴川製紙            | 2,100   | 887.00   | 1,862,700   |                         |
| 大王製紙            | 27,200  | 1,445.00 | 39,304,000  | 貸付株式数<br>11,700株        |
| 阿波製紙            | 2,000   | 482.00   | 964,000     |                         |
| マークラインズ         | 3,300   | 2,051.00 | 6,768,300   | 貸付株式数<br>1,300株         |
| メディカル・データ・ピジ    | 5,000   | 1,025.00 | 5,125,000   | 貸付株式数<br>2,000株         |
| gumi            | 8,600   | 957.00   | 8,230,200   |                         |
| ショーケース          | 1,600   | 574.00   | 918,400     | 貸付株式数<br>600株           |
| モバイルファクトリー      | 1,600   | 1,042.00 | 1,667,200   | 貸付株式数<br>500株           |
| テラスカイ           | 2,400   | 2,768.00 | 6,643,200   | 貸付株式数<br>900株           |
| デジタル・インフォメーション  | 2,900   | 1,385.00 | 4,016,500   | 貸付株式数<br>1,000株         |
| P C Iホールディングス   | 2,800   | 1,175.00 | 3,290,000   | 貸付株式数<br>1,000株         |
| パイプドHD          | 900     | 1,482.00 | 1,333,800   | 貸付株式数<br>300株<br>(200株) |
| アイビーシー          | 1,400   | 931.00   | 1,303,400   | 貸付株式数<br>400株           |
| ネオジャパン          | 1,200   | 1,819.00 | 2,182,800   | 貸付株式数<br>400株           |
| P R T I M E S   | 600     | 2,492.00 | 1,495,200   | 貸付株式数<br>100株           |
| ランドコンピュータ       | 1,000   | 1,064.00 | 1,064,000   | 貸付株式数<br>400株           |
| ダブルスタンダード       | 900     | 4,200.00 | 3,780,000   | 貸付株式数<br>200株           |
| オーブンドア          | 3,400   | 1,155.00 | 3,927,000   | 貸付株式数<br>1,300株         |
| マイネット           | 2,100   | 1,015.00 | 2,131,500   |                         |
| アカツキ            | 2,300   | 3,785.00 | 8,705,500   | 貸付株式数<br>900株           |
| ベネフィットジャパン      | 500     | 1,391.00 | 695,500     | 貸付株式数<br>100株           |
| UBICOMホールディングス  | 1,600   | 1,844.00 | 2,950,400   | 貸付株式数<br>500株           |
| L I N E         | 14,800  | 5,350.00 | 79,180,000  | 貸付株式数<br>100株           |
| カナミックネットワーク     | 4,100   | 840.00   | 3,444,000   |                         |
| ノムラシステムコーポレーション | 1,800   | 532.00   | 957,600     | 貸付株式数<br>500株           |
| レンゴー            | 61,400  | 866.00   | 53,172,400  |                         |

|                      |         |           |               |       |                |
|----------------------|---------|-----------|---------------|-------|----------------|
| トーモク                 | 3,900   | 1,657.00  | 6,462,300     | 貸付株式数 | 1,400株         |
| ザ・パック                | 4,900   | 3,085.00  | 15,116,500    | 貸付株式数 | 1,900株         |
| チェンジ                 | 1,400   | 5,640.00  | 7,896,000     |       |                |
| シンクロ・フード             | 2,700   | 321.00    | 866,700       | 貸付株式数 | 1,000株         |
| オークネット               | 4,000   | 1,129.00  | 4,516,000     | 貸付株式数 | 1,600株         |
| セグエグループ              | 1,300   | 794.00    | 1,032,200     | 貸付株式数 | 100株           |
| エイトレッド               | 900     | 1,921.00  | 1,728,900     | 貸付株式数 | 300株           |
| AOI TYO HOLD<br>INGS | 6,700   | 446.00    | 2,988,200     | 貸付株式数 | 2,600株         |
| マクロミル                | 13,400  | 696.00    | 9,326,400     | 貸付株式数 | 4,500株         |
| ビーグリー                | 1,300   | 1,652.00  | 2,147,600     | 貸付株式数 | 400株<br>(400株) |
| オロ                   | 1,700   | 2,458.00  | 4,178,600     | 貸付株式数 | 600株           |
| テモナ                  | 900     | 738.00    | 664,200       | 貸付株式数 | 200株           |
| ニーズウェル               | 1,000   | 632.00    | 632,000       |       |                |
| サインポスト               | 1,100   | 1,650.00  | 1,815,000     | 貸付株式数 | 300株           |
| 昭和電工                 | 46,000  | 2,553.00  | 117,438,000   |       |                |
| 住友化学                 | 464,000 | 325.00    | 150,800,000   |       |                |
| 住友精化                 | 2,900   | 3,365.00  | 9,758,500     |       |                |
| 日産化学                 | 35,900  | 5,190.00  | 186,321,000   |       |                |
| ラサ工業                 | 2,300   | 1,446.00  | 3,325,800     |       |                |
| クレハ                  | 5,500   | 4,720.00  | 25,960,000    |       |                |
| 多木化学                 | 1,900   | 7,390.00  | 14,041,000    | 貸付株式数 | 700株           |
| テイカ                  | 4,700   | 1,422.00  | 6,683,400     |       |                |
| 石原産業                 | 11,600  | 699.00    | 8,108,400     |       |                |
| 片倉コープアグリ             | 1,700   | 1,227.00  | 2,085,900     |       |                |
| 日本曹達                 | 9,600   | 2,811.00  | 26,985,600    |       |                |
| 東ソー                  | 98,600  | 1,465.00  | 144,449,000   |       |                |
| トクヤマ                 | 18,700  | 2,378.00  | 44,468,600    |       |                |
| セントラル硝子              | 12,700  | 1,839.00  | 23,355,300    |       |                |
| 東亜合成                 | 40,200  | 1,028.00  | 41,325,600    |       |                |
| 大阪ソーダ                | 6,600   | 2,423.00  | 15,991,800    |       |                |
| 関東電化                 | 15,500  | 859.00    | 13,314,500    |       |                |
| デンカ                  | 23,900  | 2,581.00  | 61,685,900    | 貸付株式数 | 9,600株         |
| イビデン                 | 40,300  | 2,828.00  | 113,968,400   |       |                |
| 信越化学                 | 109,900 | 11,850.00 | 1,302,315,000 | 貸付株式数 | 43,200株        |
| 日本カ-バイド              | 2,100   | 1,311.00  | 2,753,100     | 貸付株式数 | 800株           |
| 堺化学                  | 4,100   | 1,966.00  | 8,060,600     |       |                |
| 第一稀元素化学工             | 7,000   | 746.00    | 5,222,000     |       |                |
| エア・ウォーター             | 59,800  | 1,515.00  | 90,597,000    |       |                |

|                 |         |          |             |                        |
|-----------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 大陽日酸            | 62,200  | 1,800.00 | 111,960,000 |                        |
| 日本化学工業          | 2,100   | 2,157.00 | 4,529,700   |                        |
| 東邦アセチレン         | 900     | 1,251.00 | 1,125,900   |                        |
| 日本パ - カライジング    | 32,300  | 1,116.00 | 36,046,800  |                        |
| 高压ガス            | 10,000  | 723.00   | 7,230,000   |                        |
| チタン工業           | 900     | 1,725.00 | 1,552,500   | 貸付株式数 300株             |
| 四国化成            | 9,800   | 1,062.00 | 10,407,600  |                        |
| 戸田工業            | 1,500   | 1,891.00 | 2,836,500   | 貸付株式数 500株             |
| ステラ ケミファ        | 3,600   | 2,539.00 | 9,140,400   | 貸付株式数 1,400株<br>(100株) |
| 保土谷化学           | 2,500   | 3,780.00 | 9,450,000   |                        |
| 日本触媒            | 9,900   | 5,730.00 | 56,727,000  |                        |
| 大日精化            | 5,800   | 2,304.00 | 13,363,200  |                        |
| カネカ             | 16,600  | 2,740.00 | 45,484,000  |                        |
| 協和キリン           | 65,800  | 2,725.00 | 179,305,000 |                        |
| 三菱瓦斯化学          | 59,700  | 1,582.00 | 94,445,400  |                        |
| 三井化学            | 58,400  | 2,287.00 | 133,560,800 |                        |
| J S R           | 60,000  | 1,945.00 | 116,700,000 |                        |
| 東京応化工業          | 11,100  | 4,855.00 | 53,890,500  |                        |
| 大阪有機化学          | 6,100   | 1,932.00 | 11,785,200  | 貸付株式数 1,600株           |
| 三菱ケミカルH L D G S | 426,400 | 633.10   | 269,953,840 |                        |
| K H ネオケム        | 11,400  | 1,997.00 | 22,765,800  | 貸付株式数 4,600株           |
| ダイセル            | 83,300  | 814.00   | 67,806,200  |                        |
| 住友ベ - クライト      | 10,200  | 3,030.00 | 30,906,000  |                        |
| 積水化学            | 137,000 | 1,481.00 | 202,897,000 |                        |
| 日本ゼオン           | 57,900  | 997.00   | 57,726,300  |                        |
| アイカ工業           | 19,400  | 3,230.00 | 62,662,000  |                        |
| 宇部興産            | 31,700  | 1,843.00 | 58,423,100  |                        |
| 積水樹脂            | 11,600  | 2,257.00 | 26,181,200  |                        |
| タキロンシーアイ        | 14,400  | 679.00   | 9,777,600   |                        |
| 旭有機材            | 3,700   | 1,410.00 | 5,217,000   |                        |
| ニチバン            | 3,400   | 1,468.00 | 4,991,200   |                        |
| リケンテクノス         | 16,000  | 417.00   | 6,672,000   |                        |
| 大倉工業            | 2,900   | 1,553.00 | 4,503,700   | 貸付株式数 1,100株           |
| 積水化成品           | 8,700   | 570.00   | 4,959,000   |                        |
| 群栄化学            | 1,400   | 2,695.00 | 3,773,000   |                        |
| タイガース ポリマー      | 3,400   | 470.00   | 1,598,000   |                        |
| ミライアル           | 2,200   | 997.00   | 2,193,400   | 貸付株式数 800株             |
| ダイキアクシス         | 2,400   | 801.00   | 1,922,400   | 貸付株式数 200株             |
| ダイキョーニシカワ       | 12,900  | 525.00   | 6,772,500   |                        |

|                 |        |           |             |       |                |
|-----------------|--------|-----------|-------------|-------|----------------|
| 竹本容器            | 2,100  | 706.00    | 1,482,600   | 貸付株式数 | 900株           |
| 森六ホールディングス      | 2,800  | 1,571.00  | 4,398,800   |       |                |
| 日本化薬            | 39,900 | 1,069.00  | 42,653,100  |       |                |
| カーリットホールディングス   | 6,400  | 499.00    | 3,193,600   | 貸付株式数 | 2,600株         |
| E P Sホールディングス   | 9,000  | 1,032.00  | 9,288,000   |       |                |
| ソルクシーズ          | 3,000  | 655.00    | 1,965,000   | 貸付株式数 | 1,100株         |
| レグス             | 1,700  | 906.00    | 1,540,200   | 貸付株式数 | 600株           |
| プレステージ・インター     | 23,900 | 795.00    | 19,000,500  |       |                |
| フェイス            | 2,300  | 650.00    | 1,495,000   |       |                |
| プロトコーポレーション     | 6,000  | 996.00    | 5,976,000   |       |                |
| ハイマックス          | 800    | 1,949.00  | 1,559,200   |       |                |
| アミューズ           | 3,500  | 2,175.00  | 7,612,500   |       |                |
| 野村総合研究所         | 91,800 | 2,797.00  | 256,764,600 |       |                |
| ドリームインキュベータ     | 1,900  | 1,294.00  | 2,458,600   | 貸付株式数 | 700株           |
| サイバネットシステム      | 5,100  | 646.00    | 3,294,600   |       |                |
| クイック            | 3,900  | 1,111.00  | 4,332,900   |       |                |
| T A C           | 4,400  | 187.00    | 822,800     | 貸付株式数 | 1,600株         |
| C Eホールディングス     | 4,100  | 480.00    | 1,968,000   |       |                |
| ケネディクス          | 59,400 | 525.00    | 31,185,000  |       |                |
| 日本システム技術        | 1,200  | 1,411.00  | 1,693,200   |       |                |
| 電通グループ          | 65,200 | 2,674.00  | 174,344,800 | 貸付株式数 | 25,200株        |
| インテージホールディングス   | 8,400  | 855.00    | 7,182,000   |       |                |
| テイクアンドギヴニーズ     | 2,400  | 655.00    | 1,572,000   | 貸付株式数 | 900株           |
| 東邦システムサイエンス     | 1,700  | 921.00    | 1,565,700   | 貸付株式数 | 200株           |
| ぴあ              | 1,800  | 3,400.00  | 6,120,000   | 貸付株式数 | 700株           |
| イオンファンタジー       | 2,400  | 1,671.00  | 4,010,400   | 貸付株式数 | 900株<br>(200株) |
| ソースネクスト         | 31,600 | 275.00    | 8,690,000   | 貸付株式数 | 12,200株        |
| シーティーエス         | 7,300  | 845.00    | 6,168,500   |       |                |
| ネクシーズグループ       | 2,400  | 988.00    | 2,371,200   | 貸付株式数 | 900株           |
| インフォコム          | 7,200  | 2,949.00  | 21,232,800  | 貸付株式数 | 100株           |
| メディカルシステムネットワーク | 6,300  | 488.00    | 3,074,400   |       |                |
| 日本精化            | 5,400  | 1,352.00  | 7,300,800   |       |                |
| 扶桑化学工業          | 6,600  | 3,745.00  | 24,717,000  |       |                |
| トリケミカル          | 1,500  | 10,490.00 | 15,735,000  |       |                |
| ラクスル            | 3,500  | 2,852.00  | 9,982,000   | 貸付株式数 | 1,400株         |
| F I G           | 7,700  | 260.00    | 2,002,000   | 貸付株式数 | 2,800株         |

|                 |         |           |               |                |
|-----------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| A D E K A       | 28,800  | 1,385.00  | 39,888,000    |                |
| 日油              | 24,300  | 3,660.00  | 88,938,000    |                |
| ミヨシ油脂           | 2,300   | 1,086.00  | 2,497,800     |                |
| 新日本理化           | 10,700  | 162.00    | 1,733,400     |                |
| ハリマ化成グループ       | 5,400   | 980.00    | 5,292,000     |                |
| アルテリア・ネットワークス   | 7,300   | 1,975.00  | 14,417,500    |                |
| ヒト・コミュニケーションズHD | 1,600   | 950.00    | 1,520,000     |                |
| 花 王             | 156,500 | 8,643.00  | 1,352,629,500 |                |
| 第一工業製薬          | 2,500   | 4,620.00  | 11,550,000    |                |
| 石原ケミカル          | 1,700   | 1,872.00  | 3,182,400     |                |
| 日華化学            | 2,100   | 938.00    | 1,969,800     | 貸付株式数 800株     |
| ニイタカ            | 1,100   | 4,750.00  | 5,225,000     | 貸付株式数 400株     |
| 三洋化成            | 3,800   | 4,700.00  | 17,860,000    |                |
| 武田薬品            | 544,100 | 3,922.00  | 2,133,960,200 | 貸付株式数 213,800株 |
| アステラス製薬         | 566,700 | 1,741.50  | 986,908,050   | 貸付株式数 222,900株 |
| 大日本住友製薬         | 48,700  | 1,416.00  | 68,959,200    |                |
| 塩野義製薬           | 82,400  | 6,535.00  | 538,484,000   |                |
| わかもと製薬          | 8,500   | 280.00    | 2,380,000     |                |
| あすか製薬           | 7,600   | 1,141.00  | 8,671,600     |                |
| 日本新薬            | 17,300  | 8,530.00  | 147,569,000   |                |
| ピオフェルミン製薬       | 1,200   | 2,290.00  | 2,748,000     |                |
| 中外製薬            | 68,300  | 16,000.00 | 1,092,800,000 |                |
| 科研製薬            | 11,200  | 5,490.00  | 61,488,000    |                |
| エーザイ            | 78,400  | 8,161.00  | 639,822,400   |                |
| 理研ビタミン          | 6,300   | 2,226.00  | 14,023,800    |                |
| ロート製薬           | 33,700  | 3,220.00  | 108,514,000   |                |
| 小野薬品            | 150,300 | 3,002.00  | 451,200,600   |                |
| 久光製薬            | 17,100  | 5,400.00  | 92,340,000    |                |
| 有機合成薬品          | 5,900   | 337.00    | 1,988,300     | 貸付株式数 2,000株   |
| 持田製薬            | 9,100   | 3,915.00  | 35,626,500    |                |
| 参天製薬            | 121,900 | 1,967.00  | 239,777,300   |                |
| 扶桑薬品            | 2,300   | 2,439.00  | 5,609,700     |                |
| 日本ケミファ          | 900     | 2,587.00  | 2,328,300     |                |
| ツムラ             | 20,200  | 2,871.00  | 57,994,200    |                |
| 日医工             | 19,200  | 1,235.00  | 23,712,000    |                |
| テ ル モ           | 185,100 | 3,941.00  | 729,479,100   | 貸付株式数 72,600株  |
| みらかホールディングス     | 17,400  | 2,544.00  | 44,265,600    |                |
| キッセイ薬品工業        | 11,600  | 2,550.00  | 29,580,000    |                |

|                 |         |           |               |               |
|-----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| 生化学工業           | 12,500  | 1,106.00  | 13,825,000    |               |
| 栄研化学            | 11,800  | 1,742.00  | 20,555,600    |               |
| 日水製薬            | 2,800   | 1,193.00  | 3,340,400     |               |
| 鳥居薬品            | 4,200   | 3,080.00  | 12,936,000    |               |
| J C R ファーマ      | 4,700   | 11,240.00 | 52,828,000    |               |
| 東和薬品            | 8,400   | 2,050.00  | 17,220,000    |               |
| 富士製薬工業          | 4,600   | 1,164.00  | 5,354,400     |               |
| 沢井製薬            | 13,400  | 5,560.00  | 74,504,000    |               |
| ゼリア新薬工業         | 11,800  | 1,993.00  | 23,517,400    |               |
| 第一三共            | 187,400 | 8,622.00  | 1,615,762,800 | 貸付株式数 73,500株 |
| キョーリン製薬HD       | 14,900  | 2,091.00  | 31,155,900    | 貸付株式数 5,600株  |
| 大幸薬品            | 8,300   | 2,195.00  | 18,218,500    | 貸付株式数 3,000株  |
| ダイト             | 4,000   | 4,050.00  | 16,200,000    |               |
| 大塚ホールディングス      | 124,500 | 4,712.00  | 586,644,000   |               |
| 大正製薬HD          | 13,800  | 6,390.00  | 88,182,000    |               |
| ペプチドリーム         | 33,500  | 4,780.00  | 160,130,000   | 貸付株式数 7,800株  |
| 大日本塗料           | 7,300   | 917.00    | 6,694,100     |               |
| 日本ペイントHOLD      | 53,000  | 7,870.00  | 417,110,000   |               |
| 関西ペイント          | 72,100  | 2,165.00  | 156,096,500   |               |
| 神東塗料            | 6,800   | 181.00    | 1,230,800     |               |
| 中国塗料            | 18,400  | 740.00    | 13,616,000    |               |
| 日本特殊塗料          | 4,800   | 947.00    | 4,545,600     |               |
| 藤倉化成            | 8,600   | 496.00    | 4,265,600     |               |
| 太陽ホールディングス      | 4,700   | 4,840.00  | 22,748,000    |               |
| D I C           | 26,900  | 2,639.00  | 70,989,100    | 貸付株式数 10,800株 |
| サカタインクス         | 14,100  | 974.00    | 13,733,400    |               |
| 東洋インキSCホールディングン | 12,700  | 2,006.00  | 25,476,200    | 貸付株式数 5,300株  |
| T & K TOKA      | 4,100   | 746.00    | 3,058,600     | 貸付株式数 1,900株  |
| アルプス技研          | 5,700   | 1,802.00  | 10,271,400    |               |
| サニックス           | 11,400  | 289.00    | 3,294,600     | 貸付株式数 4,400株  |
| ダイオーズ           | 1,200   | 1,063.00  | 1,275,600     | 貸付株式数 400株    |
| 日本空調サービス        | 6,800   | 703.00    | 4,780,400     |               |
| オリエンタルランド       | 66,500  | 15,030.00 | 999,495,000   |               |
| フォーカスシステムズ      | 4,200   | 837.00    | 3,515,400     | 貸付株式数 1,600株  |
| ダスキン            | 16,100  | 2,694.00  | 43,373,400    |               |
| パーク24           | 35,200  | 1,984.00  | 69,836,800    | 貸付株式数 13,900株 |
| 明光ネットワークジャパン    | 7,600   | 837.00    | 6,361,200     | 貸付株式数 3,000株  |
| ファルコホールディングス    | 3,500   | 1,540.00  | 5,390,000     |               |
| クレスコ            | 4,000   | 1,396.00  | 5,584,000     |               |

|                |         |           |             |                |
|----------------|---------|-----------|-------------|----------------|
| フジ・メディア・HD     | 62,100  | 1,033.00  | 64,149,300  |                |
| 秀英予備校          | 1,400   | 418.00    | 585,200     |                |
| 田谷             | 1,200   | 535.00    | 642,000     | 貸付株式数 400株     |
| ラウンドワン         | 17,700  | 798.00    | 14,124,600  | 貸付株式数 7,200株   |
| リゾートトラスト       | 29,300  | 1,380.00  | 40,434,000  |                |
| オービック          | 22,500  | 18,380.00 | 413,550,000 |                |
| ジャストシステム       | 10,700  | 7,170.00  | 76,719,000  |                |
| TDCソフト         | 5,900   | 904.00    | 5,333,600   |                |
| Zホールディングス      | 885,200 | 440.00    | 389,488,000 |                |
| ビー・エム・エル       | 8,300   | 2,973.00  | 24,675,900  |                |
| ワタベウェディング      | 1,000   | 375.00    | 375,000     | 貸付株式数 200株     |
| トレンドマイクロ       | 28,900  | 5,960.00  | 172,244,000 |                |
| りらいあコミュニケーション  | 11,600  | 991.00    | 11,495,600  |                |
| IDホールディングス     | 2,500   | 1,367.00  | 3,417,500   |                |
| リソー教育          | 29,200  | 308.00    | 8,993,600   |                |
| 日本オラクル         | 13,200  | 11,850.00 | 156,420,000 | 貸付株式数 5,200株   |
| 早稲田アカデミー       | 2,000   | 924.00    | 1,848,000   | 貸付株式数 800株     |
| アルファシステムズ      | 2,100   | 3,815.00  | 8,011,500   | 貸付株式数 700株     |
| フューチャー         | 8,000   | 1,700.00  | 13,600,000  |                |
| CAC HOLDINGS   | 4,400   | 1,269.00  | 5,583,600   |                |
| SBテクノロジー       | 2,400   | 2,747.00  | 6,592,800   |                |
| トーセ            | 1,800   | 809.00    | 1,456,200   | 貸付株式数 700株     |
| ユー・エス・エス       | 70,700  | 1,821.00  | 128,744,700 |                |
| オービックビジネスC     | 6,700   | 5,820.00  | 38,994,000  |                |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 29,900  | 3,695.00  | 110,480,500 |                |
| アイティフォー        | 8,100   | 666.00    | 5,394,600   | 貸付株式数 3,000株   |
| 東京個別指導学院       | 2,300   | 567.00    | 1,304,100   | 貸付株式数 800株     |
| 東計電算           | 1,000   | 4,055.00  | 4,055,000   | 貸付株式数 400株     |
| サイバーエージェント     | 36,500  | 4,990.00  | 182,135,000 | 貸付株式数 14,900株  |
| 楽天             | 293,300 | 923.00    | 270,715,900 | 貸付株式数 113,600株 |
| エクスネット         | 1,100   | 965.00    | 1,061,500   |                |
| クリーク・アンド・リバー社  | 3,400   | 1,021.00  | 3,471,400   |                |
| テー・オー・ダブリュー    | 10,400  | 375.00    | 3,900,000   | 貸付株式数 4,000株   |
| 大塚商会           | 35,200  | 5,410.00  | 190,432,000 | 貸付株式数 11,300株  |
| サイボウズ          | 7,700   | 3,050.00  | 23,485,000  |                |
| ソフトブレーン        | 4,100   | 462.00    | 1,894,200   | 貸付株式数 1,400株   |
| 山田コンサルティンググループ | 3,000   | 1,285.00  | 3,855,000   |                |
| セントラルスポーツ      | 2,300   | 2,382.00  | 5,478,600   | 貸付株式数 900株     |
| パラカ            | 1,600   | 1,640.00  | 2,624,000   | 貸付株式数 600株     |

|                |         |           |             |       |                    |
|----------------|---------|-----------|-------------|-------|--------------------|
| 電通国際情報S        | 4,100   | 4,660.00  | 19,106,000  |       |                    |
| デジタルガレージ       | 11,700  | 3,585.00  | 41,944,500  | 貸付株式数 | 4,800株             |
| イーエムシステムズ      | 9,300   | 919.00    | 8,546,700   |       |                    |
| ウェザーニューズ       | 2,300   | 3,700.00  | 8,510,000   | 貸付株式数 | 800株               |
| C I J          | 4,900   | 841.00    | 4,120,900   |       |                    |
| ビジネスエンジニアリング   | 800     | 2,616.00  | 2,092,800   | 貸付株式数 | 300株               |
| 日本エンタープライズ     | 7,300   | 246.00    | 1,795,800   | 貸付株式数 | 100株               |
| WOWOW          | 2,800   | 2,455.00  | 6,874,000   | 貸付株式数 | 1,200株             |
| スカラ            | 4,600   | 653.00    | 3,003,800   | 貸付株式数 | 1,700株<br>(100株)   |
| インテリジェント ウェイブ  | 3,100   | 773.00    | 2,396,300   | 貸付株式数 | 1,200株             |
| フルキャストホールディングス | 6,400   | 1,447.00  | 9,260,800   | 貸付株式数 | 2,400株             |
| エン・ジャパン        | 11,300  | 2,737.00  | 30,928,100  |       |                    |
| 富士フイルムHLDGS    | 125,500 | 4,766.00  | 598,133,000 |       |                    |
| コニカミノルタ        | 145,100 | 396.00    | 57,459,600  |       |                    |
| 資生堂            | 130,200 | 6,833.00  | 889,656,600 |       |                    |
| ライオン           | 85,300  | 2,470.00  | 210,691,000 |       |                    |
| 高砂香料           | 4,200   | 2,259.00  | 9,487,800   | 貸付株式数 | 800株               |
| マンダム           | 14,700  | 2,002.00  | 29,429,400  | 貸付株式数 | 5,600株             |
| ミルボン           | 8,900   | 5,040.00  | 44,856,000  |       |                    |
| ファンケル          | 26,800  | 3,015.00  | 80,802,000  | 貸付株式数 | 5,700株             |
| コーセー           | 12,400  | 13,860.00 | 171,864,000 |       |                    |
| コタ             | 3,800   | 1,198.00  | 4,552,400   |       |                    |
| シーボン           | 800     | 2,104.00  | 1,683,200   |       |                    |
| ポーラ・オルビスHD     | 28,000  | 2,027.00  | 56,756,000  |       |                    |
| ノエビアホールディングス   | 5,500   | 4,470.00  | 24,585,000  |       |                    |
| アジュバンコスメジャパン   | 1,400   | 933.00    | 1,306,200   |       |                    |
| エステー           | 4,100   | 1,665.00  | 6,826,500   |       |                    |
| アグロカネショウ       | 2,100   | 1,308.00  | 2,746,800   |       |                    |
| コニシ            | 10,900  | 1,393.00  | 15,183,700  |       |                    |
| 長谷川香料          | 8,900   | 2,279.00  | 20,283,100  |       |                    |
| 星光PMC          | 3,500   | 695.00    | 2,432,500   | 貸付株式数 | 1,400株             |
| 小林製薬           | 18,400  | 9,800.00  | 180,320,000 | 貸付株式数 | 400株               |
| 荒川化学工業         | 5,900   | 1,171.00  | 6,908,900   |       |                    |
| メック            | 4,600   | 1,863.00  | 8,569,800   | 貸付株式数 | 1,800株<br>(1,500株) |
| 日本高純度化学        | 1,800   | 2,484.00  | 4,471,200   | 貸付株式数 | 700株               |
| タカラバイオ         | 17,400  | 3,090.00  | 53,766,000  | 貸付株式数 | 6,900株             |

|                      |         |          |             |       |                |
|----------------------|---------|----------|-------------|-------|----------------|
| J C U                | 8,100   | 3,100.00 | 25,110,000  |       |                |
| 新田ゼラチン               | 3,900   | 699.00   | 2,726,100   | 貸付株式数 | 500株           |
| O A T アグリオ           | 1,200   | 1,067.00 | 1,280,400   |       |                |
| デクセリアルズ              | 17,300  | 817.00   | 14,134,100  |       |                |
| アース製薬                | 5,000   | 7,170.00 | 35,850,000  | 貸付株式数 | 1,900株         |
| 北興化学                 | 6,600   | 597.00   | 3,940,200   | 貸付株式数 | 2,600株         |
| 大成ラミック               | 2,200   | 2,628.00 | 5,781,600   | 貸付株式数 | 800株           |
| クミアイ化学               | 27,400  | 863.00   | 23,646,200  | 貸付株式数 | 10,900株        |
| 日本農薬                 | 11,900  | 456.00   | 5,426,400   | 貸付株式数 | 4,700株         |
| 富士興産                 | 2,200   | 434.00   | 954,800     | 貸付株式数 | 300株<br>(300株) |
| ニチレキ                 | 8,000   | 1,572.00 | 12,576,000  |       |                |
| ユシロ化学                | 3,700   | 1,253.00 | 4,636,100   |       |                |
| ビーピー・カストロール          | 2,300   | 1,187.00 | 2,730,100   |       |                |
| 富士石油                 | 17,700  | 172.00   | 3,044,400   |       |                |
| M O R E S C O        | 2,300   | 1,008.00 | 2,318,400   | 貸付株式数 | 900株           |
| 出光興産                 | 72,400  | 2,370.00 | 171,588,000 |       |                |
| J X T Gホールディングス      | 980,600 | 393.40   | 385,768,040 | 貸付株式数 | 392,700株       |
| コスモエネルギーH L D G<br>S | 19,200  | 1,589.00 | 30,508,800  | 貸付株式数 | 2,300株         |
| 横浜ゴム                 | 38,200  | 1,521.00 | 58,102,200  | 貸付株式数 | 15,000株        |
| T O Y O T I R E      | 37,900  | 1,451.00 | 54,992,900  |       |                |
| ブリヂストン               | 187,500 | 3,468.00 | 650,250,000 |       |                |
| 住友ゴム                 | 57,300  | 1,096.00 | 62,800,800  |       |                |
| 藤倉コンポジット             | 6,200   | 355.00   | 2,201,000   |       |                |
| オカモト                 | 4,000   | 3,850.00 | 15,400,000  |       |                |
| アキレス                 | 4,700   | 1,607.00 | 7,552,900   |       |                |
| フ コ ク                | 3,000   | 686.00   | 2,058,000   | 貸付株式数 | 1,100株         |
| ニッタ                  | 7,100   | 2,224.00 | 15,790,400  |       |                |
| クリエートメディック           | 2,000   | 943.00   | 1,886,000   |       |                |
| 住友理工                 | 12,900  | 642.00   | 8,281,800   |       |                |
| 三ツ星ベルト               | 8,600   | 1,695.00 | 14,577,000  |       |                |
| バンドー化学               | 10,800  | 595.00   | 6,426,000   |       |                |
| A G C                | 64,700  | 3,160.00 | 204,452,000 | 貸付株式数 | 26,000株        |
| 日本板硝子                | 32,100  | 407.00   | 13,064,700  |       |                |
| 石塚硝子                 | 1,200   | 1,985.00 | 2,382,000   |       |                |
| 有沢製作所                | 10,500  | 785.00   | 8,242,500   | 貸付株式数 | 1,300株         |
| 日本山村硝子               | 2,300   | 845.00   | 1,943,500   |       |                |
| 日本電気硝子               | 26,400  | 1,732.00 | 45,724,800  |       |                |
| オハラ                  | 2,700   | 999.00   | 2,697,300   | 貸付株式数 | 900株           |

|              |         |          |             |                |
|--------------|---------|----------|-------------|----------------|
| 住友大阪セメント     | 12,300  | 3,630.00 | 44,649,000  |                |
| 太平洋セメント      | 41,800  | 2,380.00 | 99,484,000  |                |
| リソルホールディングス  | 700     | 3,380.00 | 2,366,000   |                |
| 日本ヒュ-ム       | 6,400   | 728.00   | 4,659,200   | 貸付株式数 2,400株   |
| 日本コンクリ-ト     | 14,600  | 262.00   | 3,825,200   |                |
| 三谷セキサン       | 3,200   | 5,170.00 | 16,544,000  | 貸付株式数 1,200株   |
| アジアパイルHD     | 8,900   | 449.00   | 3,996,100   |                |
| 東海カーボン       | 69,700  | 1,037.00 | 72,278,900  | 貸付株式数 22,200株  |
| 日本カーボン       | 3,500   | 3,510.00 | 12,285,000  | 貸付株式数 1,300株   |
| 東洋炭素         | 3,900   | 1,634.00 | 6,372,600   |                |
| ノリタケ         | 3,500   | 3,315.00 | 11,602,500  |                |
| TOTO         | 46,700  | 4,170.00 | 194,739,000 |                |
| 日本碍子         | 77,900  | 1,509.00 | 117,551,100 |                |
| 日本特殊陶業       | 49,500  | 1,577.00 | 78,061,500  |                |
| ダントーホールディングス | 8,100   | 87.00    | 704,700     |                |
| MARUWA       | 2,600   | 7,900.00 | 20,540,000  |                |
| 品川リフラクトリーズ   | 1,600   | 2,273.00 | 3,636,800   |                |
| 黒崎播磨         | 1,300   | 3,775.00 | 4,907,500   |                |
| ヨータイ         | 5,300   | 679.00   | 3,598,700   | 貸付株式数 2,000株   |
| イソライト        | 3,400   | 460.00   | 1,564,000   |                |
| 東京窯業         | 8,200   | 285.00   | 2,337,000   | 貸付株式数 2,200株   |
| ニッカトー        | 3,000   | 650.00   | 1,950,000   | 貸付株式数 900株     |
| フジインコーポレーテッド | 5,900   | 3,025.00 | 17,847,500  |                |
| クニミネ工業       | 2,800   | 971.00   | 2,718,800   |                |
| エーアンドエーマテリアル | 1,000   | 1,103.00 | 1,103,000   |                |
| ニチアス         | 18,100  | 2,199.00 | 39,801,900  |                |
| 日本製鉄         | 290,400 | 1,009.00 | 293,013,600 | 貸付株式数 120,200株 |
| 神戸製鋼所        | 119,900 | 400.00   | 47,960,000  | 貸付株式数 47,900株  |
| 中山製鋼所        | 7,300   | 362.00   | 2,642,600   |                |
| 合同製鐵         | 3,600   | 1,862.00 | 6,703,200   |                |
| JFEホールディングス  | 175,900 | 795.00   | 139,840,500 | 貸付株式数 70,300株  |
| 東京製鐵         | 31,700  | 615.00   | 19,495,500  |                |
| 共英製鋼         | 7,500   | 1,288.00 | 9,660,000   |                |
| 大和工業         | 13,900  | 2,088.00 | 29,023,200  |                |
| 東京鐵鋼         | 2,600   | 1,265.00 | 3,289,000   |                |
| 大阪製鐵         | 3,300   | 1,200.00 | 3,960,000   |                |
| 淀川製鋼所        | 8,200   | 1,733.00 | 14,210,600  |                |
| 丸一鋼管         | 21,100  | 2,646.00 | 55,830,600  | 貸付株式数 500株     |
| モリ工業         | 2,000   | 2,419.00 | 4,838,000   |                |

|              |         |          |             |                        |
|--------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 大同特殊鋼        | 10,500  | 3,500.00 | 36,750,000  |                        |
| 日本高周波        | 2,400   | 374.00   | 897,600     |                        |
| 日本冶金工        | 5,400   | 1,655.00 | 8,937,000   |                        |
| 山陽特殊製鋼       | 4,300   | 959.00   | 4,123,700   |                        |
| 愛知製鋼         | 3,400   | 2,946.00 | 10,016,400  | 貸付株式数 900株             |
| 日立金属         | 70,200  | 1,305.00 | 91,611,000  |                        |
| 日本金属         | 1,600   | 647.00   | 1,035,200   |                        |
| 大平洋金属        | 4,400   | 1,671.00 | 7,352,400   | 貸付株式数 1,700株           |
| 新日本電工        | 43,600  | 162.00   | 7,063,200   | 貸付株式数 9,100株           |
| 栗本鉄工所        | 3,200   | 1,736.00 | 5,555,200   |                        |
| 虹 技          | 1,000   | 1,197.00 | 1,197,000   | 貸付株式数 300株             |
| 日本鑄鉄管        | 800     | 1,264.00 | 1,011,200   |                        |
| 日本製鋼所        | 20,100  | 1,487.00 | 29,888,700  |                        |
| 三菱製鋼         | 4,600   | 678.00   | 3,118,800   |                        |
| 日亜鋼業         | 9,500   | 274.00   | 2,603,000   |                        |
| 日本精線         | 1,100   | 3,385.00 | 3,723,500   | 貸付株式数 100株             |
| エンビプロHD      | 3,000   | 598.00   | 1,794,000   | 貸付株式数 1,100株<br>(100株) |
| 大紀アルミニウム     | 10,200  | 564.00   | 5,752,800   |                        |
| 日本軽金属HD      | 162,100 | 176.00   | 28,529,600  |                        |
| 三井金属         | 17,600  | 2,205.00 | 38,808,000  | 貸付株式数 6,900株           |
| 東邦亜鉛         | 3,300   | 1,490.00 | 4,917,000   |                        |
| 三菱マテリアル      | 42,300  | 2,258.00 | 95,513,400  |                        |
| 住友鉱山         | 82,800  | 2,900.00 | 240,120,000 |                        |
| DOWAホールディングス | 16,600  | 3,290.00 | 54,614,000  |                        |
| 古河機金         | 11,300  | 1,064.00 | 12,023,200  |                        |
| エス・サイエンス     | 37,600  | 44.00    | 1,654,400   | 貸付株式数 5,800株           |
| 大阪チタニウム      | 6,800   | 931.00   | 6,330,800   | 貸付株式数 2,700株           |
| 東邦チタニウム      | 11,800  | 640.00   | 7,552,000   | 貸付株式数 4,700株           |
| U A C J      | 9,900   | 1,870.00 | 18,513,000  |                        |
| C K サンエツ     | 1,400   | 3,295.00 | 4,613,000   | 貸付株式数 500株             |
| 古河電工         | 20,400  | 2,562.00 | 52,264,800  |                        |
| 住友電工         | 239,300 | 1,274.00 | 304,868,200 |                        |
| フジクラ         | 80,300  | 315.00   | 25,294,500  |                        |
| 昭和電線HLDGS    | 7,700   | 1,003.00 | 7,723,100   |                        |
| 東京特殊電線       | 1,000   | 2,157.00 | 2,157,000   | 貸付株式数 400株             |
| タツタ電線        | 12,900  | 561.00   | 7,236,900   |                        |
| カナレ電気        | 1,000   | 1,826.00 | 1,826,000   | 貸付株式数 400株             |
| 平河ヒューテック     | 2,400   | 992.00   | 2,380,800   |                        |
| リョービ         | 7,900   | 1,283.00 | 10,135,700  |                        |

|               |        |          |             |              |
|---------------|--------|----------|-------------|--------------|
| アーレステイ        | 8,600  | 357.00   | 3,070,200   |              |
| アサヒHD         | 11,600 | 2,701.00 | 31,331,600  |              |
| 東洋製罐グループHD    | 41,600 | 1,264.00 | 52,582,400  |              |
| ホッカンホールディングス  | 3,500  | 1,654.00 | 5,789,000   |              |
| コロナ           | 3,600  | 1,001.00 | 3,603,600   |              |
| 横河ブリッジHLDGS   | 12,200 | 2,173.00 | 26,510,600  |              |
| OSJBHD        | 33,200 | 236.00   | 7,835,200   |              |
| 駒井ハルテック       | 1,200  | 1,413.00 | 1,695,600   |              |
| 高田機工          | 500    | 2,301.00 | 1,150,500   |              |
| 三和ホールディングス    | 61,700 | 925.00   | 57,072,500  |              |
| 文化シャッタ-       | 19,600 | 740.00   | 14,504,000  |              |
| 三協立山          | 8,700  | 965.00   | 8,395,500   |              |
| アルインコ         | 4,900  | 911.00   | 4,463,900   |              |
| 東洋シャッタ-       | 1,700  | 708.00   | 1,203,600   |              |
| LIXILグループ     | 95,500 | 1,555.00 | 148,502,500 |              |
| 日本ファイルコン      | 4,900  | 513.00   | 2,513,700   | 貸付株式数 1,700株 |
| ノーリツ          | 13,700 | 1,191.00 | 16,316,700  |              |
| 長府製作所         | 6,700  | 2,244.00 | 15,034,800  |              |
| リンナイ          | 12,600 | 8,860.00 | 111,636,000 |              |
| ユニプレス         | 12,400 | 958.00   | 11,879,200  |              |
| ダイニチ工業        | 3,500  | 627.00   | 2,194,500   |              |
| 日東精工          | 9,000  | 450.00   | 4,050,000   |              |
| 三洋工業          | 800    | 1,863.00 | 1,490,400   |              |
| 岡部            | 13,600 | 811.00   | 11,029,600  | 貸付株式数 5,500株 |
| ジーテクト         | 7,800  | 1,075.00 | 8,385,000   | 貸付株式数 3,100株 |
| 東プレ           | 11,900 | 1,261.00 | 15,005,900  |              |
| 高周波熱錬         | 12,700 | 522.00   | 6,629,400   |              |
| 東京製綱          | 4,700  | 553.00   | 2,599,100   |              |
| サンコール         | 3,600  | 408.00   | 1,468,800   |              |
| モリテックスチル      | 5,400  | 296.00   | 1,598,400   | 貸付株式数 2,100株 |
| パイオラックス       | 9,600  | 1,615.00 | 15,504,000  | 貸付株式数 3,700株 |
| エイチワン         | 6,400  | 551.00   | 3,526,400   |              |
| 日本発条          | 68,900 | 716.00   | 49,332,400  |              |
| 中央発條          | 800    | 2,689.00 | 2,151,200   |              |
| アドバネクス        | 900    | 1,201.00 | 1,080,900   | 貸付株式数 300株   |
| 三浦工業          | 28,100 | 4,370.00 | 122,797,000 |              |
| タクマ           | 22,300 | 1,439.00 | 32,089,700  |              |
| テクノプロ・ホールディング | 12,700 | 5,990.00 | 76,073,000  |              |
| アトラ           | 1,700  | 241.00   | 409,700     | 貸付株式数 500株   |

|                 |         |          |               |       |                  |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------|------------------|
| インターワークス        | 1,600   | 368.00   | 588,800       |       |                  |
| アイ・アールジャパンHD    | 2,600   | 9,670.00 | 25,142,000    | 貸付株式数 | 1,000株           |
| K e e P e r 技研  | 2,400   | 1,591.00 | 3,818,400     | 貸付株式数 | 900株             |
| ファーストロジック       | 1,400   | 565.00   | 791,000       | 貸付株式数 | 500株             |
| 三機サービス          | 1,300   | 951.00   | 1,236,300     |       |                  |
| G u n o s y     | 3,900   | 914.00   | 3,564,600     | 貸付株式数 | 1,500株           |
| デザインワン・ジャパン     | 1,300   | 249.00   | 323,700       | 貸付株式数 | 500株             |
| イー・ガーディアン       | 3,200   | 2,430.00 | 7,776,000     |       |                  |
| リブセンス           | 4,500   | 274.00   | 1,233,000     | 貸付株式数 | 1,600株           |
| ジャパンマテリアル       | 19,400  | 1,575.00 | 30,555,000    | 貸付株式数 | 7,500株           |
| ベクトル            | 8,200   | 846.00   | 6,937,200     | 貸付株式数 | 2,100株<br>(200株) |
| ウチヤマホールディングス    | 3,200   | 333.00   | 1,065,600     |       |                  |
| チャームケアコーポレーション  | 5,500   | 788.00   | 4,334,000     | 貸付株式数 | 600株<br>(200株)   |
| ライクキッズ          | 1,200   | 1,003.00 | 1,203,600     | 貸付株式数 | 400株             |
| キャリアリンク         | 2,400   | 533.00   | 1,279,200     | 貸付株式数 | 900株             |
| I B J           | 4,500   | 732.00   | 3,294,000     | 貸付株式数 | 1,700株           |
| アサンテ            | 2,700   | 1,436.00 | 3,877,200     | 貸付株式数 | 900株             |
| N・フィールド         | 4,300   | 529.00   | 2,274,700     | 貸付株式数 | 1,600株           |
| バリューHR          | 2,600   | 1,385.00 | 3,601,000     | 貸付株式数 | 900株             |
| M & Aキャピタルパートナー | 4,500   | 3,820.00 | 17,190,000    | 貸付株式数 | 1,800株           |
| ライドオンエクスプレスHD   | 2,400   | 1,997.00 | 4,792,800     | 貸付株式数 | 900株<br>(900株)   |
| E R Iホールディングス   | 1,800   | 645.00   | 1,161,000     | 貸付株式数 | 700株             |
| アビスト            | 900     | 2,553.00 | 2,297,700     | 貸付株式数 | 300株<br>(300株)   |
| シグマクシス          | 4,400   | 1,672.00 | 7,356,800     |       |                  |
| ウィルグループ         | 4,300   | 632.00   | 2,717,600     | 貸付株式数 | 1,600株           |
| エスクローAJ         | 9,000   | 198.00   | 1,782,000     | 貸付株式数 | 3,600株           |
| リクルートホールディングス   | 448,900 | 3,538.00 | 1,588,208,200 |       |                  |
| エラン             | 3,800   | 1,782.00 | 6,771,600     | 貸付株式数 | 1,400株           |
| ツガミ             | 13,700  | 876.00   | 12,001,200    | 貸付株式数 | 5,200株           |
| オークマ            | 7,600   | 4,540.00 | 34,504,000    |       |                  |
| 芝浦機械            | 7,500   | 2,234.00 | 16,755,000    |       |                  |
| アマダ             | 78,900  | 882.00   | 69,589,800    |       |                  |
| アイダエンジニア        | 16,800  | 726.00   | 12,196,800    |       |                  |
| 滝澤鉄工所           | 2,000   | 994.00   | 1,988,000     |       |                  |

|                 |         |           |             |       |                  |
|-----------------|---------|-----------|-------------|-------|------------------|
| F U J I         | 28,000  | 1,818.00  | 50,904,000  | 貸付株式数 | 11,200株          |
| 牧野フライス          | 7,800   | 3,265.00  | 25,467,000  |       |                  |
| オーエスジー          | 30,400  | 1,583.00  | 48,123,200  | 貸付株式数 | 12,200株          |
| ダイジェット          | 700     | 1,271.00  | 889,700     | 貸付株式数 | 200株             |
| 旭ダイヤモンド         | 16,800  | 492.00    | 8,265,600   |       |                  |
| D M G 森精機       | 41,500  | 1,308.00  | 54,282,000  |       |                  |
| ソデイツク           | 15,600  | 796.00    | 12,417,600  |       |                  |
| ディスコ            | 8,700   | 23,510.00 | 204,537,000 |       |                  |
| 日東工器            | 3,700   | 1,926.00  | 7,126,200   |       |                  |
| 日進工具            | 1,900   | 2,430.00  | 4,617,000   | 貸付株式数 | 700株             |
| パンチ工業           | 5,900   | 390.00    | 2,301,000   | 貸付株式数 | 2,300株           |
| 富士ダイス           | 2,700   | 640.00    | 1,728,000   | 貸付株式数 | 1,100株           |
| 土木管理総合試験        | 2,900   | 360.00    | 1,044,000   |       |                  |
| ネットマーケティング      | 2,200   | 606.00    | 1,333,200   | 貸付株式数 | 800株             |
| 日本郵政            | 509,000 | 776.00    | 394,984,000 |       |                  |
| ベルシステム24HLDGS   | 10,900  | 1,340.00  | 14,606,000  | 貸付株式数 | 200株             |
| 鎌倉新書            | 4,900   | 1,116.00  | 5,468,400   | 貸付株式数 | 1,800株           |
| S M N           | 1,000   | 985.00    | 985,000     |       |                  |
| 一蔵              | 700     | 380.00    | 266,000     | 貸付株式数 | 200株             |
| L I T A L I C O | 2,200   | 2,364.00  | 5,200,800   | 貸付株式数 | 300株             |
| グローバルキッズCOMP    | 900     | 551.00    | 495,900     | 貸付株式数 | 300株             |
| エアトリ            | 2,800   | 1,114.00  | 3,119,200   | 貸付株式数 | 1,100株           |
| アトラエ            | 1,700   | 3,165.00  | 5,380,500   | 貸付株式数 | 600株             |
| ストライク           | 2,400   | 4,650.00  | 11,160,000  | 貸付株式数 | 900株             |
| ソラスト            | 17,500  | 1,128.00  | 19,740,000  |       |                  |
| セラク             | 2,200   | 915.00    | 2,013,000   | 貸付株式数 | 700株             |
| インソース           | 3,200   | 2,713.00  | 8,681,600   | 貸付株式数 | 1,200株<br>(900株) |
| 豊田自動織機          | 52,400  | 5,620.00  | 294,488,000 |       |                  |
| 豊和工業            | 3,900   | 791.00    | 3,084,900   | 貸付株式数 | 1,400株           |
| O K K           | 2,700   | 416.00    | 1,123,200   |       |                  |
| 石川製作所           | 1,700   | 1,687.00  | 2,867,900   | 貸付株式数 | 600株<br>(600株)   |
| 東洋機械金属          | 4,300   | 405.00    | 1,741,500   | 貸付株式数 | 1,600株           |
| 津田駒工業           | 1,200   | 900.00    | 1,080,000   | 貸付株式数 | 400株             |
| エンシュウ           | 1,500   | 884.00    | 1,326,000   |       |                  |
| 島精機製作所          | 10,400  | 1,492.00  | 15,516,800  |       |                  |
| オプトラン           | 7,300   | 2,255.00  | 16,461,500  | 貸付株式数 | 2,800株           |
| N C ホールディングス    | 2,000   | 532.00    | 1,064,000   | 貸付株式数 | 700株             |

|                |         |           |               |       |                    |
|----------------|---------|-----------|---------------|-------|--------------------|
| イワキポンプ         | 3,100   | 986.00    | 3,056,600     |       |                    |
| フリーー           | 6,400   | 932.00    | 5,964,800     | 貸付株式数 | 2,400株             |
| ヤマシンフィルタ       | 14,400  | 989.00    | 14,241,600    | 貸付株式数 | 5,600株             |
| 日阪製作所          | 7,600   | 744.00    | 5,654,400     |       |                    |
| やまびこ           | 12,900  | 899.00    | 11,597,100    |       |                    |
| 平田機工           | 3,100   | 5,590.00  | 17,329,000    | 貸付株式数 | 1,200株             |
| ペガサスミシン製造      | 6,300   | 327.00    | 2,060,100     | 貸付株式数 | 2,500株             |
| マルマエ           | 2,700   | 955.00    | 2,578,500     | 貸付株式数 | 1,000株<br>(1,000株) |
| タツモ            | 3,100   | 1,585.00  | 4,913,500     | 貸付株式数 | 1,200株             |
| ナプテスコ          | 38,100  | 3,185.00  | 121,348,500   |       |                    |
| 三井海洋開発         | 7,000   | 1,518.00  | 10,626,000    |       |                    |
| レオン自動機         | 6,400   | 1,240.00  | 7,936,000     | 貸付株式数 | 2,600株             |
| S M C          | 20,500  | 52,500.00 | 1,076,250,000 | 貸付株式数 | 3,400株             |
| ホソカワミクロン       | 2,300   | 5,600.00  | 12,880,000    |       |                    |
| ユニオンツール        | 2,100   | 2,670.00  | 5,607,000     | 貸付株式数 | 1,000株             |
| オイレス工業         | 8,500   | 1,373.00  | 11,670,500    |       |                    |
| 日精エーエスピー       | 2,100   | 3,175.00  | 6,667,500     |       |                    |
| サト - ホールディングス  | 9,400   | 2,380.00  | 22,372,000    |       |                    |
| 技研製作所          | 5,800   | 4,860.00  | 28,188,000    | 貸付株式数 | 2,200株             |
| 日本エアーテック       | 2,300   | 976.00    | 2,244,800     | 貸付株式数 | 900株               |
| カワタ            | 1,900   | 742.00    | 1,409,800     | 貸付株式数 | 700株               |
| 日精樹脂工業         | 5,400   | 796.00    | 4,298,400     |       |                    |
| オカダアイヨン        | 2,000   | 898.00    | 1,796,000     | 貸付株式数 | 800株               |
| ワイエイシーホールディングス | 2,800   | 446.00    | 1,248,800     |       |                    |
| 小松製作所          | 296,300 | 2,100.00  | 622,230,000   | 貸付株式数 | 117,000株           |
| 住友重機械          | 37,700  | 2,385.00  | 89,914,500    |       |                    |
| 日立建機           | 26,500  | 2,820.00  | 74,730,000    |       |                    |
| 日工             | 9,200   | 629.00    | 5,786,800     |       |                    |
| 巴工業            | 2,800   | 1,807.00  | 5,059,600     | 貸付株式数 | 1,100株             |
| 井関農機           | 6,700   | 1,115.00  | 7,470,500     |       |                    |
| T O W A        | 6,700   | 1,102.00  | 7,383,400     |       |                    |
| 丸山製作所          | 1,800   | 1,128.00  | 2,030,400     |       |                    |
| 北川鉄工所          | 2,800   | 1,627.00  | 4,555,600     |       |                    |
| シンニッタン         | 10,400  | 244.00    | 2,537,600     |       |                    |
| ローツェ           | 2,900   | 4,915.00  | 14,253,500    | 貸付株式数 | 1,100株             |
| タカキタ           | 2,500   | 585.00    | 1,462,500     | 貸付株式数 | 500株               |
| クボタ            | 346,400 | 1,558.50  | 539,864,400   | 貸付株式数 | 139,200株           |
| 荏原実業           | 1,700   | 2,566.00  | 4,362,200     |       |                    |

|              |        |           |               |       |         |
|--------------|--------|-----------|---------------|-------|---------|
| 東洋エンジニア      | 8,700  | 383.00    | 3,332,100     | 貸付株式数 | 200株    |
| 三菱化工機        | 2,200  | 1,670.00  | 3,674,000     |       |         |
| 月島機械         | 12,200 | 1,174.00  | 14,322,800    |       |         |
| 帝国電機製作所      | 5,500  | 1,199.00  | 6,594,500     |       |         |
| 東京機械         | 3,100  | 281.00    | 871,100       | 貸付株式数 | 1,200株  |
| 新東工業         | 15,800 | 750.00    | 11,850,000    | 貸付株式数 | 300株    |
| 渋谷工業         | 5,800  | 2,908.00  | 16,866,400    |       |         |
| アイチ コーポレーション | 11,500 | 709.00    | 8,153,500     | 貸付株式数 | 4,100株  |
| 小森コーポレーション   | 15,500 | 680.00    | 10,540,000    | 貸付株式数 | 6,200株  |
| 鶴見製作所        | 5,100  | 1,785.00  | 9,103,500     |       |         |
| 住友精密         | 1,000  | 2,222.00  | 2,222,000     |       |         |
| 日本ギア工業       | 2,000  | 286.00    | 572,000       | 貸付株式数 | 700株    |
| 酒井重工業        | 1,200  | 2,135.00  | 2,562,000     |       |         |
| 荏原製作所        | 27,000 | 2,433.00  | 65,691,000    |       |         |
| 石井鉄工所        | 900    | 2,504.00  | 2,253,600     |       |         |
| 西島製作所        | 6,700  | 789.00    | 5,286,300     |       |         |
| 北越工業         | 7,000  | 1,064.00  | 7,448,000     |       |         |
| ダイキン工業       | 83,400 | 15,915.00 | 1,327,311,000 | 貸付株式数 | 32,700株 |
| オルガノ         | 2,400  | 5,250.00  | 12,600,000    |       |         |
| ト - ヨ - カネツ  | 3,000  | 2,052.00  | 6,156,000     |       |         |
| 栗田工業         | 35,600 | 2,887.00  | 102,777,200   |       |         |
| 椿本チエイン       | 9,100  | 2,640.00  | 24,024,000    |       |         |
| 大同工業         | 3,100  | 678.00    | 2,101,800     |       |         |
| 日 機 装        | 20,000 | 951.00    | 19,020,000    |       |         |
| 木村化工機        | 5,700  | 422.00    | 2,405,400     | 貸付株式数 | 300株    |
| レイズネクスト      | 11,100 | 1,196.00  | 13,275,600    |       |         |
| アネスト岩田       | 10,500 | 839.00    | 8,809,500     |       |         |
| ダイフク         | 33,600 | 8,410.00  | 282,576,000   | 貸付株式数 | 13,400株 |
| サムコ          | 1,900  | 1,819.00  | 3,456,100     | 貸付株式数 | 700株    |
| 加藤製作所        | 3,700  | 1,133.00  | 4,192,100     |       |         |
| 油研工業         | 1,000  | 1,447.00  | 1,447,000     |       |         |
| タダノ          | 32,300 | 857.00    | 27,681,100    |       |         |
| フジテック        | 23,900 | 1,739.00  | 41,562,100    |       |         |
| C K D        | 18,500 | 1,750.00  | 32,375,000    |       |         |
| キトー          | 5,100  | 1,250.00  | 6,375,000     |       |         |
| 平和           | 17,000 | 1,809.00  | 30,753,000    |       |         |
| 理想科学工業       | 5,900  | 1,381.00  | 8,147,900     |       |         |
| S A N K Y O  | 14,500 | 2,719.00  | 39,425,500    |       |         |
| 日本金銭機械       | 7,300  | 585.00    | 4,270,500     | 貸付株式数 | 2,900株  |
| マースグループHLDGS | 3,900  | 1,608.00  | 6,271,200     |       |         |

|               |         |          |               |              |
|---------------|---------|----------|---------------|--------------|
| フクシマガリレイ      | 4,100   | 3,580.00 | 14,678,000    |              |
| オーイズミ         | 2,800   | 368.00   | 1,030,400     |              |
| ダイコク電機        | 2,900   | 1,236.00 | 3,584,400     |              |
| 竹内製作所         | 11,200  | 1,683.00 | 18,849,600    |              |
| アマノ           | 17,400  | 2,262.00 | 39,358,800    |              |
| JUKI          | 8,900   | 597.00   | 5,313,300     |              |
| サンデンホールディングス  | 9,000   | 363.00   | 3,267,000     | 貸付株式数 3,400株 |
| 蛇の目ミシン        | 5,900   | 434.00   | 2,560,600     | 貸付株式数 2,200株 |
| ブラザー工業        | 79,700  | 1,958.00 | 156,052,600   |              |
| マックス          | 10,200  | 1,571.00 | 16,024,200    |              |
| モリタホールディングス   | 11,300  | 1,743.00 | 19,695,900    |              |
| グローリー         | 16,400  | 2,467.00 | 40,458,800    |              |
| 新晃工業          | 6,200   | 1,411.00 | 8,748,200     | 貸付株式数 2,200株 |
| 大和冷機工業        | 9,700   | 955.00   | 9,263,500     |              |
| セガサミーホールディングス | 64,200  | 1,330.00 | 85,386,000    |              |
| 日本ピストンリング     | 2,300   | 1,162.00 | 2,672,600     |              |
| リケン           | 3,000   | 2,727.00 | 8,181,000     |              |
| TPR           | 8,600   | 1,386.00 | 11,919,600    | 貸付株式数 3,400株 |
| ツバキ・ナカシマ      | 13,600  | 898.00   | 12,212,800    |              |
| ホシザキ          | 19,200  | 8,950.00 | 171,840,000   | 貸付株式数 800株   |
| 大豊工業          | 5,200   | 551.00   | 2,865,200     |              |
| 日本精工          | 122,600 | 792.00   | 97,099,200    |              |
| NTN           | 154,700 | 224.00   | 34,652,800    |              |
| ジェイテクト        | 62,500  | 849.00   | 53,062,500    |              |
| 不二越           | 6,200   | 3,255.00 | 20,181,000    |              |
| ミネベアミツミ       | 121,700 | 1,920.00 | 233,664,000   |              |
| 日本トムソン        | 19,600  | 348.00   | 6,820,800     |              |
| THK           | 38,400  | 2,648.00 | 101,683,200   |              |
| ユーシン精機        | 5,100   | 704.00   | 3,590,400     |              |
| 前澤給装工業        | 2,400   | 1,949.00 | 4,677,600     |              |
| イーグル工業        | 7,900   | 719.00   | 5,680,100     |              |
| 前澤工業          | 4,000   | 336.00   | 1,344,000     | 貸付株式数 200株   |
| 日本ピラ-工業       | 6,800   | 1,302.00 | 8,853,600     | 貸付株式数 2,600株 |
| キッツ           | 26,800  | 705.00   | 18,894,000    |              |
| 日立            | 314,200 | 3,425.00 | 1,076,135,000 |              |
| 三菱電機          | 652,300 | 1,389.00 | 906,044,700   |              |
| 富士電機          | 39,500  | 2,717.00 | 107,321,500   |              |
| 東洋電機製造        | 2,300   | 1,169.00 | 2,688,700     | 貸付株式数 500株   |
| 安川電機          | 70,700  | 3,575.00 | 252,752,500   | 貸付株式数 1,600株 |

|                     |         |          |               |       |         |
|---------------------|---------|----------|---------------|-------|---------|
| シンフォニア テクノロ<br>ジー   | 8,600   | 1,009.00 | 8,677,400     |       |         |
| 明電舎                 | 12,100  | 1,642.00 | 19,868,200    |       |         |
| オリジン                | 1,700   | 1,413.00 | 2,402,100     |       |         |
| 山洋電気                | 3,200   | 4,375.00 | 14,000,000    |       |         |
| デンヨー                | 5,800   | 1,788.00 | 10,370,400    |       |         |
| ベイカレントコンサルティ<br>ング  | 3,900   | 9,030.00 | 35,217,000    |       |         |
| ORCHESTRA HL<br>DGS | 1,600   | 1,285.00 | 2,056,000     | 貸付株式数 | 500株    |
| アイモバイル              | 1,800   | 664.00   | 1,195,200     | 貸付株式数 | 500株    |
| キャリアインデックス          | 2,800   | 313.00   | 876,400       | 貸付株式数 | 1,000株  |
| MS - J a p a n      | 2,200   | 761.00   | 1,674,200     |       |         |
| 船場                  | 1,100   | 970.00   | 1,067,000     |       |         |
| グレイステクノロジー          | 2,900   | 4,780.00 | 13,862,000    | 貸付株式数 | 1,100株  |
| ジャパンエレベーターSH<br>D   | 6,800   | 3,095.00 | 21,046,000    | 貸付株式数 | 2,600株  |
| フルテック               | 900     | 1,247.00 | 1,122,300     |       |         |
| グリーンズ               | 1,800   | 487.00   | 876,600       |       |         |
| ツナググループHLDGS        | 900     | 416.00   | 374,400       | 貸付株式数 | 300株    |
| ソウルドアウト             | 1,000   | 2,283.00 | 2,283,000     | 貸付株式数 | 400株    |
| MS&CONSULTIN<br>G   | 1,000   | 534.00   | 534,000       | 貸付株式数 | 300株    |
| 日総工産                | 4,500   | 639.00   | 2,875,500     |       |         |
| キュービーネットHLDG<br>S   | 2,900   | 2,076.00 | 6,020,400     | 貸付株式数 | 1,000株  |
| RPAホールディングス         | 3,800   | 740.00   | 2,812,000     | 貸付株式数 | 1,500株  |
| 三桜工業                | 8,600   | 665.00   | 5,719,000     |       |         |
| マキタ                 | 85,200  | 3,775.00 | 321,630,000   | 貸付株式数 | 33,500株 |
| 東芝テック               | 8,500   | 3,890.00 | 33,065,000    |       |         |
| 芝浦メカトロニクス           | 1,100   | 2,708.00 | 2,978,800     |       |         |
| マブチモーター             | 18,000  | 3,345.00 | 60,210,000    |       |         |
| 日本電産                | 157,700 | 6,430.00 | 1,014,011,000 |       |         |
| ユーエムシーエレクトロニ<br>クス  | 4,200   | 347.00   | 1,457,400     | 貸付株式数 | 1,500株  |
| トレックス・セミコンダク<br>ター  | 3,800   | 1,264.00 | 4,803,200     |       |         |
| 東光高岳                | 3,600   | 1,001.00 | 3,603,600     |       |         |
| ダブル・スコープ            | 10,600  | 647.00   | 6,858,200     | 貸付株式数 | 4,100株  |
| 宮越ホールディングス          | 2,900   | 630.00   | 1,827,000     | 貸付株式数 | 900株    |

|              |         |           |             |                      |
|--------------|---------|-----------|-------------|----------------------|
| ダイヘン         | 7,300   | 3,410.00  | 24,893,000  |                      |
| ヤーマン         | 11,000  | 813.00    | 8,943,000   | 貸付株式数 4,300株         |
| JVCケンウッド     | 55,100  | 168.00    | 9,256,800   |                      |
| ミマキエンジニアリング  | 5,500   | 379.00    | 2,084,500   |                      |
| 第一精工         | 2,800   | 2,273.00  | 6,364,400   | 貸付株式数 900株<br>(500株) |
| 日新電機         | 15,400  | 1,039.00  | 16,000,600  |                      |
| 大崎電気         | 13,200  | 485.00    | 6,402,000   |                      |
| オムロン         | 58,500  | 6,920.00  | 404,820,000 |                      |
| 日東工業         | 9,600   | 1,787.00  | 17,155,200  |                      |
| I D E C      | 9,700   | 1,640.00  | 15,908,000  | 貸付株式数 2,400株         |
| 正興電機製作所      | 1,800   | 927.00    | 1,668,600   | 貸付株式数 500株           |
| 不二電機工業       | 700     | 1,283.00  | 898,100     | 貸付株式数 200株<br>(200株) |
| ジーエス・ユアサ コーポ | 22,300  | 1,731.00  | 38,601,300  |                      |
| サクサホールディングス  | 1,500   | 1,741.00  | 2,611,500   |                      |
| メルコホールディングス  | 2,300   | 2,700.00  | 6,210,000   |                      |
| テクノメディカ      | 1,500   | 1,815.00  | 2,722,500   | 貸付株式数 300株           |
| 日本電気         | 79,400  | 4,835.00  | 383,899,000 | 貸付株式数 13,200株        |
| 富士通          | 63,100  | 11,615.00 | 732,906,500 |                      |
| 沖電気          | 25,700  | 1,022.00  | 26,265,400  |                      |
| 岩崎通信機        | 2,900   | 840.00    | 2,436,000   |                      |
| 電気興業         | 3,200   | 2,512.00  | 8,038,400   |                      |
| サンケン電気       | 7,100   | 2,206.00  | 15,662,600  |                      |
| ナカヨ          | 1,200   | 1,485.00  | 1,782,000   |                      |
| アイホン         | 3,700   | 1,509.00  | 5,583,300   |                      |
| ルネサスエレクトロニクス | 312,800 | 591.00    | 184,864,800 |                      |
| セイコーエプソン     | 81,000  | 1,281.00  | 103,761,000 |                      |
| ワコム          | 45,100  | 534.00    | 24,083,400  |                      |
| アルバック        | 12,100  | 2,998.00  | 36,275,800  |                      |
| アクセル         | 2,700   | 670.00    | 1,809,000   | 貸付株式数 900株           |
| E I Z O      | 5,100   | 4,065.00  | 20,731,500  |                      |
| ジャパンディスプレイ   | 61,700  | 45.00     | 2,776,500   |                      |
| 日本信号         | 16,900  | 1,131.00  | 19,113,900  |                      |
| 京三製作所        | 15,800  | 502.00    | 7,931,600   | 貸付株式数 6,200株         |
| 能美防災         | 8,700   | 1,989.00  | 17,304,300  |                      |
| ホーチキ         | 4,900   | 1,263.00  | 6,188,700   |                      |
| 星和電機         | 3,500   | 588.00    | 2,058,000   |                      |
| エレコム         | 7,400   | 4,920.00  | 36,408,000  |                      |
| パナソニック       | 747,200 | 928.20    | 693,551,040 |                      |

|                     |         |           |               |       |                    |
|---------------------|---------|-----------|---------------|-------|--------------------|
| シャープ                | 75,900  | 1,136.00  | 86,222,400    | 貸付株式数 | 30,500株            |
| アンリツ                | 42,400  | 2,314.00  | 98,113,600    | 貸付株式数 | 16,900株<br>(200株)  |
| 富士通ゼネラル             | 17,700  | 2,151.00  | 38,072,700    |       |                    |
| ソニー                 | 409,800 | 7,317.00  | 2,998,506,600 | 貸付株式数 | 162,400株           |
| T D K               | 31,700  | 10,270.00 | 325,559,000   | 貸付株式数 | 12,300株            |
| 帝国通信工業              | 2,800   | 1,203.00  | 3,368,400     |       |                    |
| タムラ製作所              | 22,100  | 421.00    | 9,304,100     |       |                    |
| アルプスアルパイン           | 58,800  | 1,381.00  | 81,202,800    |       |                    |
| 池上通信機               | 2,000   | 836.00    | 1,672,000     |       |                    |
| 日本電波工業              | 6,300   | 356.00    | 2,242,800     | 貸付株式数 | 2,400株             |
| 鈴木                  | 3,200   | 732.00    | 2,342,400     | 貸付株式数 | 1,300株             |
| 日本トリム               | 900     | 2,963.00  | 2,666,700     | 貸付株式数 | 300株               |
| ローランド ディー .<br>ジー . | 3,700   | 1,210.00  | 4,477,000     | 貸付株式数 | 1,400株             |
| フオスタ - 電機           | 7,000   | 1,102.00  | 7,714,000     |       |                    |
| S M K               | 1,700   | 2,416.00  | 4,107,200     | 貸付株式数 | 600株               |
| ヨコオ                 | 4,300   | 2,476.00  | 10,646,800    |       |                    |
| ティアック               | 4,900   | 139.00    | 681,100       | 貸付株式数 | 1,800株             |
| ホシデン                | 18,000  | 920.00    | 16,560,000    |       |                    |
| ヒロセ電機               | 10,000  | 11,680.00 | 116,800,000   |       |                    |
| 日本航空電子              | 15,200  | 1,440.00  | 21,888,000    |       |                    |
| T O A               | 7,000   | 713.00    | 4,991,000     |       |                    |
| マクセルホールディングス        | 14,500  | 981.00    | 14,224,500    |       |                    |
| 古野電気                | 8,600   | 918.00    | 7,894,800     |       |                    |
| ユニデンホールディングス        | 1,900   | 1,816.00  | 3,450,400     | 貸付株式数 | 600株               |
| スミダコーポレーション         | 5,100   | 750.00    | 3,825,000     | 貸付株式数 | 1,900株<br>(100株)   |
| アイコム                | 3,800   | 2,955.00  | 11,229,000    |       |                    |
| リオン                 | 2,800   | 2,280.00  | 6,384,000     |       |                    |
| 本多通信工業              | 5,800   | 431.00    | 2,499,800     |       |                    |
| 船井電機                | 6,800   | 481.00    | 3,270,800     | 貸付株式数 | 2,500株<br>(1,700株) |
| 横河電機                | 60,600  | 1,562.00  | 94,657,200    |       |                    |
| 新電元工業               | 2,300   | 2,263.00  | 5,204,900     |       |                    |
| アズビル                | 41,500  | 2,919.00  | 121,138,500   |       |                    |
| 東亜ディーケーケー           | 3,300   | 838.00    | 2,765,400     | 貸付株式数 | 1,200株             |
| 日本光電工業              | 27,200  | 3,410.00  | 92,752,000    |       |                    |
| チノール                | 2,200   | 1,290.00  | 2,838,000     | 貸付株式数 | 700株               |
| 共和電業                | 6,800   | 388.00    | 2,638,400     |       |                    |

|               |         |           |               |                          |
|---------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 日本電子材料        | 2,700   | 878.00    | 2,370,600     |                          |
| 堀場製作所         | 12,800  | 5,270.00  | 67,456,000    |                          |
| アドバンテスト       | 48,900  | 5,480.00  | 267,972,000   | 貸付株式数 19,100株            |
| 小野測器          | 2,500   | 507.00    | 1,267,500     |                          |
| エスペック         | 5,900   | 1,653.00  | 9,752,700     |                          |
| キーエンス         | 59,300  | 42,120.00 | 2,497,716,000 | 貸付株式数 23,200株            |
| 日置電機          | 3,400   | 2,859.00  | 9,720,600     | 貸付株式数 700株               |
| シスメックス        | 46,700  | 7,656.00  | 357,535,200   |                          |
| 日本マイクロニクス     | 11,600  | 992.00    | 11,507,200    |                          |
| メガチップス        | 6,200   | 2,071.00  | 12,840,200    | 貸付株式数 2,400株<br>(2,400株) |
| OBARA GROUP   | 3,400   | 3,265.00  | 11,101,000    | 貸付株式数 1,400株             |
| IMAGICA GROUP | 5,700   | 382.00    | 2,177,400     | 貸付株式数 2,100株<br>(2,000株) |
| 澤藤電機          | 900     | 1,518.00  | 1,366,200     | 貸付株式数 300株               |
| デンソー          | 143,900 | 3,903.00  | 561,641,700   |                          |
| 原田工業          | 3,200   | 793.00    | 2,537,600     | 貸付株式数 1,200株             |
| コーセル          | 8,700   | 875.00    | 7,612,500     | 貸付株式数 3,100株             |
| イリソ電子工業       | 5,600   | 3,470.00  | 19,432,000    | 貸付株式数 2,200株             |
| オプテックスグループ    | 10,800  | 1,254.00  | 13,543,200    |                          |
| 千代田インテグレ      | 3,000   | 1,757.00  | 5,271,000     | 貸付株式数 1,100株             |
| アイ・オー・データ     | 2,300   | 955.00    | 2,196,500     | 貸付株式数 800株               |
| レーザーテック       | 28,900  | 9,350.00  | 270,215,000   |                          |
| スタンレー電気       | 46,000  | 2,554.00  | 117,484,000   |                          |
| 岩崎電気          | 2,600   | 1,856.00  | 4,825,600     |                          |
| ウシオ電機         | 36,900  | 1,331.00  | 49,113,900    |                          |
| 岡谷電機          | 5,100   | 333.00    | 1,698,300     |                          |
| ヘリオステクノH      | 6,300   | 324.00    | 2,041,200     | 貸付株式数 100株               |
| エノモト          | 2,000   | 989.00    | 1,978,000     |                          |
| 日本セラミック       | 6,800   | 2,231.00  | 15,170,800    |                          |
| 遠藤照明          | 3,200   | 603.00    | 1,929,600     |                          |
| 古河電池          | 4,600   | 1,492.00  | 6,863,200     | 貸付株式数 1,700株             |
| 双信電機          | 3,300   | 355.00    | 1,171,500     | 貸付株式数 1,200株             |
| 山一電機          | 4,800   | 1,439.00  | 6,907,200     |                          |
| 図研            | 4,400   | 2,557.00  | 11,250,800    |                          |
| 日本電子          | 13,100  | 2,680.00  | 35,108,000    |                          |
| カシオ           | 58,400  | 1,801.00  | 105,178,400   |                          |
| ファナック         | 62,200  | 18,855.00 | 1,172,781,000 | 貸付株式数 24,400株            |
| 日本シイエムケイ      | 15,700  | 405.00    | 6,358,500     | 貸付株式数 3,600株             |
| エンプラス         | 3,400   | 2,396.00  | 8,146,400     |                          |

|              |         |          |               |                           |
|--------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| 大真空          | 2,500   | 1,831.00 | 4,577,500     |                           |
| ローム          | 29,000  | 7,070.00 | 205,030,000   |                           |
| 浜松ホトニクス      | 46,900  | 4,645.00 | 217,850,500   |                           |
| 三井ハイテック      | 7,400   | 1,551.00 | 11,477,400    | 貸付株式数<br>2,700株<br>(100株) |
| 新光電気工業       | 22,100  | 1,464.00 | 32,354,400    |                           |
| 京セラ          | 91,600  | 5,722.00 | 524,135,200   |                           |
| 協栄産業         | 700     | 1,197.00 | 837,900       | 貸付株式数<br>200株             |
| 太陽誘電         | 29,300  | 3,135.00 | 91,855,500    | 貸付株式数<br>11,700株          |
| 村田製作所        | 192,100 | 6,160.00 | 1,183,336,000 |                           |
| 双葉電子工業       | 10,300  | 955.00   | 9,836,500     |                           |
| 日東電工         | 44,900  | 5,840.00 | 262,216,000   |                           |
| 北陸電気工業       | 2,700   | 890.00   | 2,403,000     | 貸付株式数<br>1,000株           |
| 東海理化電機       | 17,100  | 1,565.00 | 26,761,500    |                           |
| ニチコン         | 22,600  | 731.00   | 16,520,600    |                           |
| 日本ケミコン       | 5,100   | 1,672.00 | 8,527,200     |                           |
| K O A        | 10,100  | 969.00   | 9,786,900     |                           |
| 三井E & S H D  | 21,700  | 509.00   | 11,045,300    |                           |
| 日立造船         | 50,100  | 390.00   | 19,539,000    |                           |
| 三菱重工業        | 109,000 | 2,691.50 | 293,373,500   |                           |
| 川崎重工業        | 50,900  | 1,660.00 | 84,494,000    |                           |
| I H I        | 47,800  | 1,535.00 | 73,373,000    |                           |
| 名村造船所        | 22,200  | 165.00   | 3,663,000     |                           |
| サノヤスホールディングス | 9,400   | 149.00   | 1,400,600     |                           |
| スプリックス       | 2,200   | 770.00   | 1,694,000     | 貸付株式数<br>500株             |
| カープスホールディングス | 15,900  | 601.00   | 9,555,900     | 貸付株式数<br>6,300株           |
| 日本車輛         | 2,400   | 2,599.00 | 6,237,600     |                           |
| 三菱ロジスネクスト    | 8,900   | 986.00   | 8,775,400     |                           |
| 近畿車輛         | 1,000   | 1,231.00 | 1,231,000     | 貸付株式数<br>300株             |
| F P G        | 20,200  | 625.00   | 12,625,000    | 貸付株式数<br>8,000株<br>(200株) |
| 島根銀行         | 1,500   | 517.00   | 775,500       |                           |
| じもとホールディングス  | 45,000  | 94.00    | 4,230,000     |                           |
| 全国保証         | 18,400  | 3,940.00 | 72,496,000    | 貸付株式数<br>7,500株           |
| めぶきフィナンシャルG  | 337,500 | 242.00   | 81,675,000    |                           |
| 東京きらぼしFG     | 9,000   | 1,127.00 | 10,143,000    |                           |
| 九州フィナンシャルG   | 108,200 | 446.00   | 48,257,200    |                           |
| かんぽ生命保険      | 22,300  | 1,365.00 | 30,439,500    | 貸付株式数<br>9,500株           |
| ゆうちょ銀行       | 180,700 | 871.00   | 157,389,700   | 貸付株式数<br>72,800株          |
| 富山第一銀行       | 15,500  | 256.00   | 3,968,000     |                           |

|                 |         |          |               |       |                |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------|----------------|
| コンコルディア・フィナンシャル | 369,600 | 345.00   | 127,512,000   |       |                |
| ジェイリース          | 2,500   | 344.00   | 860,000       | 貸付株式数 | 800株           |
| 西日本フィナンシャルHD    | 44,700  | 718.00   | 32,094,600    |       |                |
| マーキュリアインベストメント  | 2,800   | 565.00   | 1,582,000     | 貸付株式数 | 1,100株         |
| イントラスト          | 2,500   | 705.00   | 1,762,500     | 貸付株式数 | 900株           |
| 日本モーゲージサービス     | 1,400   | 1,861.00 | 2,605,400     | 貸付株式数 | 500株<br>(500株) |
| C a s a         | 2,300   | 1,083.00 | 2,490,900     | 貸付株式数 | 900株           |
| アルヒ             | 10,500  | 1,432.00 | 15,036,000    | 貸付株式数 | 4,200株         |
| プレミアグループ        | 3,600   | 1,747.00 | 6,289,200     | 貸付株式数 | 1,400株         |
| 日産自動車           | 775,500 | 408.30   | 316,636,650   | 貸付株式数 | 320,800株       |
| いすゞ自動車          | 191,300 | 955.00   | 182,691,500   |       |                |
| トヨタ自動車          | 729,700 | 6,700.00 | 4,888,990,000 | 貸付株式数 | 286,800株       |
| 日野自動車           | 82,900  | 712.00   | 59,024,800    |       |                |
| 三菱自動車工業         | 239,100 | 296.00   | 70,773,600    |       |                |
| エフテック           | 4,800   | 501.00   | 2,404,800     | 貸付株式数 | 1,600株         |
| レシップホールディングス    | 2,600   | 573.00   | 1,489,800     |       |                |
| GMB             | 1,500   | 672.00   | 1,008,000     |       |                |
| ファルテック          | 1,400   | 650.00   | 910,000       |       |                |
| 武蔵精密工業          | 15,000  | 974.00   | 14,610,000    |       |                |
| 日産車体            | 13,100  | 964.00   | 12,628,400    | 貸付株式数 | 3,100株         |
| 新明和工業           | 18,000  | 1,023.00 | 18,414,000    |       |                |
| 極東開発工業          | 12,200  | 1,291.00 | 15,750,200    |       |                |
| 日信工業            | 13,300  | 2,201.00 | 29,273,300    |       |                |
| トピー工業           | 5,600   | 1,241.00 | 6,949,600     |       |                |
| ティラド            | 2,400   | 1,384.00 | 3,321,600     |       |                |
| タチエス            | 10,900  | 878.00   | 9,570,200     |       |                |
| N O K           | 34,800  | 1,340.00 | 46,632,000    |       |                |
| フタバ産業           | 18,800  | 456.00   | 8,572,800     |       |                |
| K Y B           | 7,500   | 2,125.00 | 15,937,500    | 貸付株式数 | 2,800株         |
| 市光工業            | 10,100  | 508.00   | 5,130,800     |       |                |
| 大同メタル工業         | 13,100  | 540.00   | 7,074,000     | 貸付株式数 | 800株           |
| プレス工業           | 32,000  | 270.00   | 8,640,000     |       |                |
| ミクニ             | 8,400   | 282.00   | 2,368,800     |       |                |
| 太平洋工業           | 13,900  | 961.00   | 13,357,900    |       |                |
| ケーヒン            | 15,000  | 2,542.00 | 38,130,000    |       |                |
| 河西工業            | 9,200   | 450.00   | 4,140,000     | 貸付株式数 | 3,400株         |
| アイシン精機          | 54,100  | 3,220.00 | 174,202,000   |       |                |

|               |         |           |               |       |                    |
|---------------|---------|-----------|---------------|-------|--------------------|
| マ ッ ダ         | 193,900 | 710.00    | 137,669,000   | 貸付株式数 | 77,500株            |
| 今仙電機製作所       | 6,100   | 737.00    | 4,495,700     |       |                    |
| 本田技研          | 514,500 | 2,741.00  | 1,410,244,500 |       |                    |
| スズキ           | 130,000 | 3,581.00  | 465,530,000   |       |                    |
| S U B A R U   | 203,000 | 2,322.00  | 471,366,000   |       |                    |
| 安永            | 3,300   | 968.00    | 3,194,400     |       |                    |
| ヤマハ発動機        | 85,200  | 1,569.00  | 133,678,800   |       |                    |
| ショーワ          | 15,400  | 2,242.00  | 34,526,800    |       |                    |
| 小糸製作所         | 39,500  | 4,360.00  | 172,220,000   |       |                    |
| T B K         | 7,900   | 423.00    | 3,341,700     | 貸付株式数 | 3,000株             |
| エクセディ         | 9,200   | 1,629.00  | 14,986,800    | 貸付株式数 | 2,400株             |
| ミツバ           | 12,200  | 484.00    | 5,904,800     |       |                    |
| 豊田合成          | 21,400  | 2,223.00  | 47,572,200    |       |                    |
| 愛三工業          | 10,600  | 561.00    | 5,946,600     |       |                    |
| 盟和産業          | 1,000   | 961.00    | 961,000       | 貸付株式数 | 300株               |
| 日本プラスト        | 5,000   | 455.00    | 2,275,000     |       |                    |
| ヨ ロ ズ         | 6,400   | 1,082.00  | 6,924,800     |       |                    |
| エフ・シー・シー      | 10,800  | 1,882.00  | 20,325,600    |       |                    |
| 新家工業          | 1,500   | 1,166.00  | 1,749,000     |       |                    |
| シマノ           | 24,500  | 20,220.00 | 495,390,000   |       |                    |
| テイ・エス テック     | 15,000  | 2,961.00  | 44,415,000    | 貸付株式数 | 5,500株             |
| 関西みらいF G      | 37,700  | 411.00    | 15,494,700    |       |                    |
| 3 3 F G       | 6,000   | 1,404.00  | 8,424,000     | 貸付株式数 | 2,300株             |
| 第四北越フィナンシャルG  | 11,300  | 2,211.00  | 24,984,300    | 貸付株式数 | 100株               |
| ジャムコ          | 3,300   | 745.00    | 2,458,500     | 貸付株式数 | 1,300株<br>(100株)   |
| 小 野 建         | 5,700   | 1,178.00  | 6,714,600     |       |                    |
| はるやまH L D G S | 2,900   | 734.00    | 2,128,600     | 貸付株式数 | 1,000株             |
| 南 陽           | 1,400   | 1,448.00  | 2,027,200     |       |                    |
| ノ ジ マ         | 11,500  | 2,538.00  | 29,187,000    | 貸付株式数 | 200株               |
| 佐鳥電機          | 4,400   | 798.00    | 3,511,200     | 貸付株式数 | 700株               |
| カップ・クリエイト     | 9,400   | 1,464.00  | 13,761,600    | 貸付株式数 | 2,500株<br>(1,600株) |
| エコートレーディング    | 1,500   | 518.00    | 777,000       | 貸付株式数 | 500株               |
| 伯東            | 3,900   | 949.00    | 3,701,100     |       |                    |
| コンドーテック       | 5,000   | 1,066.00  | 5,330,000     | 貸付株式数 | 1,800株             |
| 中山福           | 3,400   | 504.00    | 1,713,600     |       |                    |
| ライトオン         | 4,900   | 557.00    | 2,729,300     | 貸付株式数 | 1,800株<br>(1,400株) |
| ナガイレーベン       | 8,600   | 2,604.00  | 22,394,400    | 貸付株式数 | 800株               |

|               |         |           |             |       |                    |
|---------------|---------|-----------|-------------|-------|--------------------|
| ジーンズメイト       | 2,700   | 219.00    | 591,300     | 貸付株式数 | 700株               |
| 三菱食品          | 6,800   | 2,768.00  | 18,822,400  |       |                    |
| 良品計画          | 86,400  | 1,443.00  | 124,675,200 |       |                    |
| 三城ホールディングス    | 6,400   | 298.00    | 1,907,200   |       |                    |
| 松田産業          | 4,800   | 1,312.00  | 6,297,600   |       |                    |
| 第一興商          | 9,700   | 3,390.00  | 32,883,000  | 貸付株式数 | 3,700株             |
| メディパルHD       | 69,200  | 2,072.00  | 143,382,400 |       |                    |
| アドヴァン         | 10,000  | 1,308.00  | 13,080,000  | 貸付株式数 | 700株               |
| S P K         | 2,800   | 1,350.00  | 3,780,000   |       |                    |
| 萩原電気HLDGS     | 2,300   | 2,036.00  | 4,682,800   |       |                    |
| アルビス          | 2,400   | 2,126.00  | 5,102,400   |       |                    |
| アズワン          | 4,300   | 11,020.00 | 47,386,000  |       |                    |
| スズデン          | 2,200   | 1,131.00  | 2,488,200   | 貸付株式数 | 800株               |
| 尾家産業          | 1,900   | 1,513.00  | 2,874,700   | 貸付株式数 | 800株               |
| シモジマ          | 4,000   | 1,207.00  | 4,828,000   |       |                    |
| ドウシシャ         | 6,000   | 1,565.00  | 9,390,000   |       |                    |
| 小津産業          | 1,500   | 1,681.00  | 2,521,500   |       |                    |
| コナカ           | 7,100   | 286.00    | 2,030,600   |       |                    |
| 高速            | 3,900   | 1,430.00  | 5,577,000   |       |                    |
| ハウス ローゼ       | 700     | 1,596.00  | 1,117,200   |       |                    |
| G - 7ホールディングス | 3,900   | 2,418.00  | 9,430,200   |       |                    |
| たけびし          | 2,200   | 1,403.00  | 3,086,600   | 貸付株式数 | 900株               |
| イオン北海道        | 8,200   | 790.00    | 6,478,000   | 貸付株式数 | 2,400株             |
| コジマ           | 10,800  | 534.00    | 5,767,200   | 貸付株式数 | 4,300株             |
| ヒマラヤ          | 2,100   | 798.00    | 1,675,800   | 貸付株式数 | 800株               |
| コーナン商事        | 9,200   | 3,025.00  | 27,830,000  | 貸付株式数 | 300株               |
| ネットワンシステムズ    | 24,900  | 3,325.00  | 82,792,500  |       |                    |
| エコス           | 2,400   | 1,808.00  | 4,339,200   | 貸付株式数 | 900株               |
| ワタミ           | 7,800   | 986.00    | 7,690,800   | 貸付株式数 | 3,000株             |
| マルシェ          | 1,500   | 600.00    | 900,000     | 貸付株式数 | 600株               |
| リックス          | 1,400   | 1,535.00  | 2,149,000   | 貸付株式数 | 500株               |
| システムソフト       | 22,400  | 92.00     | 2,060,800   |       |                    |
| パンパシフィックHD    | 142,500 | 2,266.00  | 322,905,000 |       |                    |
| 丸文            | 5,200   | 461.00    | 2,397,200   |       |                    |
| 西松屋チェーン       | 14,400  | 939.00    | 13,521,600  | 貸付株式数 | 5,600株             |
| ゼンショーホールディングス | 31,300  | 2,141.00  | 67,013,300  | 貸付株式数 | 12,800株            |
| ハピネット         | 5,300   | 1,089.00  | 5,771,700   | 貸付株式数 | 2,100株             |
| 幸楽苑ホールディングス   | 4,200   | 1,510.00  | 6,342,000   | 貸付株式数 | 1,600株<br>(1,600株) |

|             |        |          |             |       |                  |
|-------------|--------|----------|-------------|-------|------------------|
| ハークスレイ      | 1,200  | 960.00   | 1,152,000   | 貸付株式数 | 500株             |
| 橋本総業HLDGS   | 1,300  | 2,025.00 | 2,632,500   |       |                  |
| 日本ライフライン    | 19,400 | 1,346.00 | 26,112,400  |       |                  |
| サイゼリヤ       | 10,000 | 2,062.00 | 20,620,000  | 貸付株式数 | 3,800株           |
| タカショー       | 3,500  | 462.00   | 1,617,000   |       |                  |
| V Tホールディングス | 27,500 | 332.00   | 9,130,000   |       |                  |
| マルカ         | 2,300  | 1,828.00 | 4,204,400   | 貸付株式数 | 900株             |
| アルゴグラフィックス  | 5,500  | 3,560.00 | 19,580,000  |       |                  |
| 魚力          | 1,700  | 1,568.00 | 2,665,600   |       |                  |
| IDOM        | 17,900 | 515.00   | 9,218,500   | 貸付株式数 | 7,100株           |
| 日本エム・ディ・エム  | 3,900  | 1,555.00 | 6,064,500   |       |                  |
| ポプラ         | 1,800  | 423.00   | 761,400     | 貸付株式数 | 700株             |
| フジ・コーポレーション | 1,700  | 1,941.00 | 3,299,700   |       |                  |
| ユナイテッドアローズ  | 6,900  | 1,792.00 | 12,364,800  |       |                  |
| 進和          | 3,700  | 1,860.00 | 6,882,000   | 貸付株式数 | 1,400株           |
| エスケイジャパン    | 1,600  | 305.00   | 488,000     |       |                  |
| ダイترون      | 2,700  | 1,661.00 | 4,484,700   | 貸付株式数 | 1,000株           |
| ハイデイ日高      | 9,200  | 1,773.00 | 16,311,600  | 貸付株式数 | 3,800株<br>(900株) |
| シークス        | 8,300  | 1,020.00 | 8,466,000   | 貸付株式数 | 3,200株           |
| 京都きもの友禅     | 3,900  | 228.00   | 889,200     | 貸付株式数 | 1,600株           |
| コロワイド       | 21,900 | 1,540.00 | 33,726,000  | 貸付株式数 | 8,600株           |
| ピーシーデポコーポ   | 8,700  | 660.00   | 5,742,000   | 貸付株式数 | 3,400株           |
| 田中商事        | 2,100  | 672.00   | 1,411,200   |       |                  |
| オーハシテクニカ    | 3,700  | 1,547.00 | 5,723,900   |       |                  |
| 壱番屋         | 4,600  | 5,090.00 | 23,414,000  | 貸付株式数 | 400株             |
| 白銅          | 2,300  | 1,354.00 | 3,114,200   | 貸付株式数 | 800株             |
| トップカルチャー    | 2,400  | 332.00   | 796,800     |       |                  |
| PLANT       | 1,300  | 562.00   | 730,600     | 貸付株式数 | 500株             |
| スギホールディングス  | 13,000 | 6,990.00 | 90,870,000  |       |                  |
| 薬王堂ホールディングス | 2,900  | 2,430.00 | 7,047,000   | 貸付株式数 | 1,100株           |
| 島津製作所       | 78,200 | 2,678.00 | 209,419,600 |       |                  |
| J M S       | 5,700  | 788.00   | 4,491,600   |       |                  |
| クボテック       | 1,900  | 332.00   | 630,800     | 貸付株式数 | 500株             |
| 長野計器        | 5,000  | 944.00   | 4,720,000   |       |                  |
| ブイ・テクノロジー   | 3,100  | 3,600.00 | 11,160,000  | 貸付株式数 | 1,200株           |
| スター精密       | 10,300 | 1,240.00 | 12,772,000  |       |                  |
| 東京計器        | 4,100  | 914.00   | 3,747,400   | 貸付株式数 | 1,600株           |
| 愛知時計        | 900    | 4,350.00 | 3,915,000   |       |                  |
| インターアクション   | 3,600  | 1,935.00 | 6,966,000   | 貸付株式数 | 1,400株           |

|                     |         |          |               |       |                    |
|---------------------|---------|----------|---------------|-------|--------------------|
| オーバル                | 6,400   | 220.00   | 1,408,000     | 貸付株式数 | 1,200株             |
| 東京精密                | 11,900  | 3,340.00 | 39,746,000    |       |                    |
| マニー                 | 26,300  | 2,810.00 | 73,903,000    | 貸付株式数 | 900株               |
| ニコン                 | 99,100  | 923.00   | 91,469,300    | 貸付株式数 | 39,600株            |
| トプコン                | 33,600  | 858.00   | 28,828,800    |       |                    |
| オリンパス               | 362,300 | 1,774.50 | 642,901,350   |       |                    |
| 理研計器                | 5,800   | 2,359.00 | 13,682,200    |       |                    |
| S C R E E Nホールディングス | 11,500  | 4,780.00 | 54,970,000    |       |                    |
| キヤノン電子              | 6,900   | 1,645.00 | 11,350,500    |       |                    |
| タムロン                | 5,300   | 1,818.00 | 9,635,400     |       |                    |
| HOYA                | 130,600 | 9,750.00 | 1,273,350,000 |       |                    |
| シード                 | 2,700   | 710.00   | 1,917,000     | 貸付株式数 | 1,000株             |
| ノーリツ鋼機              | 4,500   | 1,370.00 | 6,165,000     |       |                    |
| エー・アンド・デイ           | 6,100   | 677.00   | 4,129,700     |       |                    |
| 朝日インテック             | 74,600  | 3,020.00 | 225,292,000   | 貸付株式数 | 23,000株            |
| キヤノン                | 350,800 | 2,190.00 | 768,252,000   | 貸付株式数 | 146,500株           |
| リコー                 | 167,700 | 827.00   | 138,687,900   |       |                    |
| シチズン時計              | 78,700  | 363.00   | 28,568,100    | 貸付株式数 | 30,500株            |
| リズム時計               | 2,000   | 623.00   | 1,246,000     |       |                    |
| 大研医器                | 5,100   | 575.00   | 2,932,500     |       |                    |
| メニコン                | 9,400   | 5,100.00 | 47,940,000    | 貸付株式数 | 2,400株             |
| シンシア                | 900     | 422.00   | 379,800       | 貸付株式数 | 300株<br>(300株)     |
| 中本パックス              | 1,600   | 1,434.00 | 2,294,400     | 貸付株式数 | 600株               |
| スノーピーク              | 3,400   | 1,002.00 | 3,406,800     | 貸付株式数 | 1,300株             |
| パラマウントベッドHD         | 6,600   | 4,115.00 | 27,159,000    |       |                    |
| トランザクション            | 4,400   | 1,025.00 | 4,510,000     | 貸付株式数 | 1,400株             |
| 粧美堂                 | 2,000   | 350.00   | 700,000       | 貸付株式数 | 600株               |
| ニホンフラッシュ            | 6,200   | 1,308.00 | 8,109,600     |       |                    |
| 前田工織                | 7,300   | 2,339.00 | 17,074,700    | 貸付株式数 | 2,800株             |
| 永大産業                | 7,500   | 311.00   | 2,332,500     |       |                    |
| アートネイチャー            | 7,000   | 595.00   | 4,165,000     |       |                    |
| バンダイナムコHLDGS        | 67,800  | 5,941.00 | 402,799,800   |       |                    |
| アイフィスジャパン           | 1,800   | 695.00   | 1,251,000     | 貸付株式数 | 600株               |
| 共立印刷                | 11,300  | 137.00   | 1,548,100     |       |                    |
| SHOEI               | 6,200   | 2,426.00 | 15,041,200    |       |                    |
| フランスベッドHLDGS        | 9,700   | 836.00   | 8,109,200     | 貸付株式数 | 3,600株             |
| マーベラス               | 9,500   | 690.00   | 6,555,000     | 貸付株式数 | 2,800株<br>(2,800株) |

|                  |        |          |             |                           |
|------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| パイロットコーポレーション    | 10,400 | 3,345.00 | 34,788,000  |                           |
| 萩原工業             | 3,600  | 1,378.00 | 4,960,800   | 貸付株式数<br>1,400株<br>(300株) |
| エイベックス           | 11,500 | 854.00   | 9,821,000   |                           |
| トッパン・フォームズ       | 14,500 | 1,094.00 | 15,863,000  |                           |
| フジシールインターナショナル   | 14,800 | 2,071.00 | 30,650,800  | 貸付株式数<br>1,800株           |
| タカラトミー           | 29,600 | 865.00   | 25,604,000  |                           |
| 廣濟堂              | 4,900  | 781.00   | 3,826,900   |                           |
| エステールホールディングス    | 2,200  | 604.00   | 1,328,800   |                           |
| アーク              | 26,400 | 117.00   | 3,088,800   |                           |
| レック              | 7,100  | 1,614.00 | 11,459,400  | 貸付株式数<br>2,700株           |
| タカノ              | 2,500  | 712.00   | 1,780,000   |                           |
| 三光合成             | 7,500  | 279.00   | 2,092,500   |                           |
| プロネクサス           | 5,800  | 1,091.00 | 6,327,800   |                           |
| ホクシン             | 5,700  | 119.00   | 678,300     |                           |
| ウッドワン            | 2,400  | 1,146.00 | 2,750,400   |                           |
| 大建工業             | 4,500  | 1,640.00 | 7,380,000   |                           |
| きもと              | 12,400 | 154.00   | 1,909,600   |                           |
| 凸版印刷             | 92,800 | 1,789.00 | 166,019,200 |                           |
| 大日本印刷            | 85,800 | 2,426.00 | 208,150,800 |                           |
| 共同印刷             | 2,100  | 2,801.00 | 5,882,100   |                           |
| N I S S H A      | 13,900 | 1,003.00 | 13,941,700  | 貸付株式数<br>200株<br>(200株)   |
| 光村印刷             | 600    | 1,479.00 | 887,400     | 貸付株式数<br>200株             |
| 藤森工業             | 5,900  | 3,650.00 | 21,535,000  |                           |
| ヴィア・ホールディングス     | 8,100  | 451.00   | 3,653,100   |                           |
| TAKARA & COMPANY | 3,300  | 1,796.00 | 5,926,800   | 貸付株式数<br>1,300株<br>(100株) |
| 前澤化成工業           | 4,000  | 996.00   | 3,984,000   |                           |
| 未来工業             | 3,500  | 1,895.00 | 6,632,500   |                           |
| アシックス            | 54,600 | 1,222.00 | 66,721,200  | 貸付株式数<br>22,800株          |
| ツツミ              | 2,200  | 1,803.00 | 3,966,600   |                           |
| ウェーブロックHLDGS     | 2,300  | 699.00   | 1,607,700   | 貸付株式数<br>800株             |
| ジェイ エス ピー        | 4,000  | 1,469.00 | 5,876,000   | 貸付株式数<br>1,400株           |
| ニチハ              | 9,200  | 2,161.00 | 19,881,200  |                           |
| エフピコ             | 7,200  | 7,990.00 | 57,528,000  |                           |
| 小松ウオール工業         | 2,100  | 1,773.00 | 3,723,300   |                           |

|               |         |           |               |       |         |
|---------------|---------|-----------|---------------|-------|---------|
| ヤマハ           | 39,100  | 5,270.00  | 206,057,000   |       |         |
| 河合楽器          | 2,100   | 2,655.00  | 5,575,500     |       |         |
| クリナップ         | 5,900   | 501.00    | 2,955,900     |       |         |
| ビジョン          | 39,600  | 3,955.00  | 156,618,000   | 貸付株式数 | 15,900株 |
| 天馬            | 4,400   | 1,619.00  | 7,123,600     |       |         |
| 兼松サステック       | 400     | 1,406.00  | 562,400       |       |         |
| キングジム         | 5,700   | 940.00    | 5,358,000     | 貸付株式数 | 2,200株  |
| 象印マホービン       | 19,400  | 1,579.00  | 30,632,600    | 貸付株式数 | 600株    |
| リンテック         | 15,000  | 2,481.00  | 37,215,000    |       |         |
| 信越ポリマー        | 12,000  | 867.00    | 10,404,000    |       |         |
| 東リ            | 15,800  | 266.00    | 4,202,800     |       |         |
| イトーキ          | 14,400  | 352.00    | 5,068,800     |       |         |
| 任天堂           | 40,100  | 46,970.00 | 1,883,497,000 | 貸付株式数 | 15,700株 |
| 三菱鉛筆          | 10,000  | 1,420.00  | 14,200,000    |       |         |
| 松風            | 3,000   | 1,484.00  | 4,452,000     | 貸付株式数 | 1,100株  |
| タカラスタンダード     | 13,200  | 1,472.00  | 19,430,400    | 貸付株式数 | 4,700株  |
| コクヨ           | 30,600  | 1,266.00  | 38,739,600    |       |         |
| ナカバヤシ         | 6,600   | 579.00    | 3,821,400     | 貸付株式数 | 300株    |
| ニフコ           | 24,100  | 2,311.00  | 55,695,100    |       |         |
| 立川ブラインド       | 2,800   | 1,196.00  | 3,348,800     | 貸付株式数 | 1,100株  |
| グローブライド       | 3,000   | 2,106.00  | 6,318,000     |       |         |
| オカムラ          | 22,400  | 766.00    | 17,158,400    |       |         |
| バルカー          | 5,500   | 1,858.00  | 10,219,000    |       |         |
| MUTOHホールディングス | 1,000   | 1,508.00  | 1,508,000     |       |         |
| 伊藤忠           | 450,300 | 2,270.00  | 1,022,181,000 |       |         |
| 丸紅            | 671,800 | 500.60    | 336,303,080   |       |         |
| スクロール         | 9,600   | 401.00    | 3,849,600     | 貸付株式数 | 3,400株  |
| 高島            | 1,000   | 1,700.00  | 1,700,000     |       |         |
| ヨンドシーホールディングス | 6,700   | 1,840.00  | 12,328,000    |       |         |
| 三陽商会          | 3,500   | 833.00    | 2,915,500     | 貸付株式数 | 1,300株  |
| 長瀬産業          | 35,400  | 1,267.00  | 44,851,800    |       |         |
| ナイガイ          | 2,500   | 379.00    | 947,500       |       |         |
| 蝶理            | 4,100   | 1,771.00  | 7,261,100     |       |         |
| 豊田通商          | 72,200  | 2,699.00  | 194,867,800   |       |         |
| オンワードホールディングス | 38,300  | 352.00    | 13,481,600    | 貸付株式数 | 5,000株  |
| 三共生興          | 10,000  | 427.00    | 4,270,000     |       |         |
| 兼松            | 24,500  | 1,287.00  | 31,531,500    |       |         |

|                |         |           |               |               |
|----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| 美津濃            | 5,900   | 1,976.00  | 11,658,400    |               |
| ツカモトコーポレーション   | 1,300   | 1,121.00  | 1,457,300     | 貸付株式数 400株    |
| ファミリーマート       | 51,900  | 1,837.00  | 95,340,300    | 貸付株式数 20,200株 |
| ルックホールディングス    | 2,100   | 730.00    | 1,533,000     | 貸付株式数 100株    |
| 三井物産           | 557,600 | 1,635.00  | 911,676,000   |               |
| 日本紙パルプ         | 3,800   | 3,820.00  | 14,516,000    |               |
| 東京エレクトロン       | 41,500  | 21,880.00 | 908,020,000   | 貸付株式数 16,300株 |
| カメイ            | 8,100   | 1,008.00  | 8,164,800     |               |
| 東都水産           | 800     | 3,335.00  | 2,668,000     |               |
| OUGホールディングス    | 1,100   | 2,560.00  | 2,816,000     | 貸付株式数 400株    |
| スターゼン          | 2,400   | 4,370.00  | 10,488,000    |               |
| セイコーHD         | 9,400   | 1,793.00  | 16,854,200    | 貸付株式数 3,600株  |
| 山善             | 25,500  | 888.00    | 22,644,000    |               |
| 椿本興業           | 1,200   | 3,640.00  | 4,368,000     |               |
| 住友商事           | 404,200 | 1,238.00  | 500,399,600   |               |
| 日本ユニシス         | 20,500  | 3,150.00  | 64,575,000    |               |
| 内田洋行           | 2,700   | 6,180.00  | 16,686,000    | 貸付株式数 1,000株  |
| 三菱商事           | 451,600 | 2,341.50  | 1,057,421,400 |               |
| 第一実業           | 3,300   | 3,615.00  | 11,929,500    |               |
| キヤノンマーケティングJPN | 16,000  | 2,193.00  | 35,088,000    |               |
| 西華産業           | 3,500   | 1,190.00  | 4,165,000     |               |
| 佐藤商事           | 4,900   | 863.00    | 4,228,700     | 貸付株式数 100株    |
| 菱洋エレクトロ        | 6,600   | 2,671.00  | 17,628,600    | 貸付株式数 2,400株  |
| 東京産業           | 5,700   | 524.00    | 2,986,800     |               |
| ユアサ商事          | 6,200   | 2,903.00  | 17,998,600    |               |
| 神鋼商事           | 1,600   | 1,916.00  | 3,065,600     |               |
| トルク            | 3,900   | 337.00    | 1,314,300     |               |
| 阪和興業           | 12,400  | 1,913.00  | 23,721,200    |               |
| 正栄食品           | 4,200   | 4,280.00  | 17,976,000    |               |
| カナデン           | 5,300   | 1,269.00  | 6,725,700     | 貸付株式数 1,900株  |
| 菱電商事           | 4,700   | 1,434.00  | 6,739,800     | 貸付株式数 1,600株  |
| ニプロ            | 44,400  | 1,140.00  | 50,616,000    | 貸付株式数 500株    |
| フルサト工業         | 3,400   | 1,379.00  | 4,688,600     | 貸付株式数 1,300株  |
| 岩谷産業           | 14,100  | 3,740.00  | 52,734,000    | 貸付株式数 5,900株  |
| ナイス            | 2,500   | 780.00    | 1,950,000     |               |
| 昭光通商           | 2,300   | 608.00    | 1,398,400     |               |
| ニチモウ           | 1,000   | 1,797.00  | 1,797,000     | 貸付株式数 300株    |
| 極東貿易           | 1,900   | 1,464.00  | 2,781,600     | 貸付株式数 600株    |
| イワキ            | 8,700   | 441.00    | 3,836,700     | 貸付株式数 3,300株  |

|               |         |          |             |                          |
|---------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 兼松エレクトロニクス    | 3,600   | 3,720.00 | 13,392,000  |                          |
| 三愛石油          | 16,200  | 991.00   | 16,054,200  |                          |
| 稲畑産業          | 14,100  | 1,227.00 | 17,300,700  |                          |
| G S Iクレオス     | 1,600   | 1,094.00 | 1,750,400   |                          |
| 明和産業          | 6,300   | 450.00   | 2,835,000   | 貸付株式数 2,500株             |
| クワザワ          | 2,400   | 518.00   | 1,243,200   |                          |
| ゴ-ルドウイン       | 11,800  | 6,190.00 | 73,042,000  | 貸付株式数 2,800株<br>(2,800株) |
| ユニ・チャ-ム       | 125,900 | 4,137.00 | 520,848,300 | 貸付株式数 49,500株            |
| デサント          | 12,600  | 1,571.00 | 19,794,600  |                          |
| キ ン グ         | 2,900   | 507.00   | 1,470,300   |                          |
| ワ キ タ         | 13,900  | 939.00   | 13,052,100  |                          |
| ヤマトインタ-ナショナル  | 3,800   | 364.00   | 1,383,200   | 貸付株式数 1,500株             |
| 東邦ホールディングス    | 20,600  | 2,006.00 | 41,323,600  |                          |
| サンゲツ          | 17,200  | 1,383.00 | 23,787,600  |                          |
| ミツウロコグループ     | 9,700   | 1,120.00 | 10,864,000  | 貸付株式数 1,000株             |
| シナネンホールディングス  | 2,800   | 2,585.00 | 7,238,000   |                          |
| 伊藤忠エネクス       | 12,900  | 845.00   | 10,900,500  |                          |
| サンリオ          | 18,000  | 1,618.00 | 29,124,000  | 貸付株式数 7,200株             |
| サンワ テクノス      | 4,400   | 792.00   | 3,484,800   | 貸付株式数 1,700株             |
| リョ-サン         | 6,800   | 2,264.00 | 15,395,200  |                          |
| 新光商事          | 10,100  | 842.00   | 8,504,200   |                          |
| トーホ-          | 2,900   | 1,754.00 | 5,086,600   | 貸付株式数 1,200株<br>(1,200株) |
| 三信電気          | 3,400   | 1,507.00 | 5,123,800   |                          |
| 東陽テクニカ        | 7,600   | 1,022.00 | 7,767,200   |                          |
| モスフード サービス    | 8,700   | 2,909.00 | 25,308,300  | 貸付株式数 3,200株<br>(100株)   |
| 加賀電子          | 6,400   | 1,961.00 | 12,550,400  |                          |
| 三益半導体         | 5,000   | 2,105.00 | 10,525,000  |                          |
| ソーダニツカ        | 6,800   | 519.00   | 3,529,200   | 貸付株式数 2,300株             |
| 立花エレテック       | 4,600   | 1,662.00 | 7,645,200   | 貸付株式数 1,800株             |
| 木曾路           | 8,600   | 2,476.00 | 21,293,600  | 貸付株式数 3,300株             |
| S R Sホールディングス | 8,100   | 896.00   | 7,257,600   | 貸付株式数 3,000株             |
| 千 趣 会         | 12,200  | 370.00   | 4,514,000   | 貸付株式数 4,800株             |
| タカキュー         | 6,100   | 142.00   | 866,200     | 貸付株式数 1,800株<br>(1,600株) |
| ケーヨー          | 13,200  | 633.00   | 8,355,600   | 貸付株式数 3,300株             |
| 上新電機          | 7,600   | 2,050.00 | 15,580,000  | 貸付株式数 2,800株             |
| 日本瓦斯          | 10,300  | 4,515.00 | 46,504,500  |                          |

|                     |         |          |             |                             |
|---------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| ロイヤルホールディングス        | 11,600  | 1,895.00 | 21,982,000  | 貸付株式数<br>4,600株<br>(300株)   |
| 東 天 紅               | 500     | 968.00   | 484,000     |                             |
| いなげや                | 8,100   | 1,645.00 | 13,324,500  |                             |
| 島 忠                 | 12,200  | 2,778.00 | 33,891,600  |                             |
| チヨダ                 | 6,800   | 1,090.00 | 7,412,000   |                             |
| ライフコーポレーション         | 5,000   | 3,360.00 | 16,800,000  |                             |
| リンガーハット             | 8,200   | 2,368.00 | 19,417,600  | 貸付株式数<br>3,200株<br>(1,700株) |
| Mr M a x H D        | 8,400   | 464.00   | 3,897,600   | 貸付株式数<br>3,400株             |
| テナライド               | 5,800   | 382.00   | 2,215,600   | 貸付株式数<br>2,300株             |
| A O K Iホールディングス     | 13,100  | 629.00   | 8,239,900   |                             |
| オークワ                | 10,200  | 1,549.00 | 15,799,800  |                             |
| コメリ                 | 10,100  | 2,563.00 | 25,886,300  |                             |
| 青山商事                | 13,100  | 785.00   | 10,283,500  |                             |
| しまむら                | 7,600   | 7,340.00 | 55,784,000  |                             |
| はせがわ                | 3,100   | 331.00   | 1,026,100   | 貸付株式数<br>300株               |
| 高 島 屋               | 46,200  | 946.00   | 43,705,200  | 貸付株式数<br>19,500株            |
| 松 屋                 | 13,200  | 650.00   | 8,580,000   | 貸付株式数<br>5,400株             |
| エイチ・ツー・オーリテイ<br>リング | 30,800  | 785.00   | 24,178,000  |                             |
| 近鉄百貨店               | 2,400   | 3,175.00 | 7,620,000   |                             |
| 丸井グループ              | 59,700  | 1,976.00 | 117,967,200 |                             |
| クレディセゾン             | 45,500  | 1,295.00 | 58,922,500  |                             |
| アクシアル リテイリング        | 5,200   | 4,130.00 | 21,476,000  |                             |
| 井 筒 屋               | 4,000   | 190.00   | 760,000     | 貸付株式数<br>400株               |
| イオン                 | 248,100 | 2,376.00 | 589,485,600 | 貸付株式数<br>97,400株            |
| イ ズ ミ               | 13,200  | 3,230.00 | 42,636,000  |                             |
| フォーバル               | 2,900   | 988.00   | 2,865,200   |                             |
| 平 和 堂               | 12,500  | 1,881.00 | 23,512,500  | 貸付株式数<br>5,100株             |
| フ ジ                 | 7,100   | 1,851.00 | 13,142,100  | 貸付株式数<br>2,800株             |
| ヤオコー                | 7,500   | 7,420.00 | 55,650,000  | 貸付株式数<br>2,900株             |
| ゼビオホールディングス         | 8,000   | 861.00   | 6,888,000   |                             |
| ケーズホールディングス         | 62,900  | 1,424.00 | 89,569,600  |                             |
| P A L T A C         | 10,500  | 4,865.00 | 51,082,500  |                             |
| 三谷産業                | 8,700   | 334.00   | 2,905,800   |                             |
| O L Y M P I Cグループ   | 3,200   | 877.00   | 2,806,400   |                             |
| 日産東京販売H D           | 8,400   | 240.00   | 2,016,000   |                             |
| 新生銀行                | 47,800  | 1,366.00 | 65,294,800  |                             |
| あおぞら銀行              | 39,000  | 1,940.00 | 75,660,000  | 貸付株式数<br>15,600株            |

|               |           |          |               |       |                    |
|---------------|-----------|----------|---------------|-------|--------------------|
| 三菱UFJフィナンシャルG | 4,409,700 | 429.10   | 1,892,202,270 |       |                    |
| りそなホールディングス   | 710,500   | 373.90   | 265,655,950   |       |                    |
| 三井住友トラストHD    | 121,800   | 3,005.00 | 366,009,000   |       |                    |
| 三井住友フィナンシャルG  | 446,100   | 3,105.00 | 1,385,140,500 |       |                    |
| 千葉銀行          | 215,700   | 503.00   | 108,497,100   |       |                    |
| 群馬銀行          | 126,300   | 331.00   | 41,805,300    |       |                    |
| 武蔵野銀行         | 9,200     | 1,528.00 | 14,057,600    |       |                    |
| 千葉興業銀行        | 17,700    | 240.00   | 4,248,000     |       |                    |
| 筑波銀行          | 28,100    | 167.00   | 4,692,700     |       |                    |
| 七十七銀行         | 21,800    | 1,522.00 | 33,179,600    |       |                    |
| 青森銀行          | 5,100     | 2,208.00 | 11,260,800    |       |                    |
| 秋田銀行          | 4,100     | 1,496.00 | 6,133,600     |       |                    |
| 山形銀行          | 7,500     | 1,286.00 | 9,645,000     | 貸付株式数 | 1,000株             |
| 岩手銀行          | 4,400     | 2,578.00 | 11,343,200    | 貸付株式数 | 1,600株             |
| 東邦銀行          | 59,400    | 222.00   | 13,186,800    | 貸付株式数 | 5,900株             |
| 東北銀行          | 3,100     | 933.00   | 2,892,300     |       |                    |
| みちのく銀行        | 4,400     | 1,147.00 | 5,046,800     | 貸付株式数 | 1,600株<br>(1,600株) |
| ふくおかフィナンシャルG  | 54,800    | 1,693.00 | 92,776,400    |       |                    |
| 静岡銀行          | 159,900   | 694.00   | 110,970,600   |       |                    |
| 十六銀行          | 8,100     | 1,997.00 | 16,175,700    |       |                    |
| スルガ銀行         | 63,000    | 392.00   | 24,696,000    |       |                    |
| 八十二銀行         | 157,500   | 400.00   | 63,000,000    | 貸付株式数 | 24,200株            |
| 山梨中央銀行        | 7,500     | 838.00   | 6,285,000     |       |                    |
| 大垣共立銀行        | 13,100    | 2,202.00 | 28,846,200    | 貸付株式数 | 5,000株             |
| 福井銀行          | 5,700     | 1,587.00 | 9,045,900     |       |                    |
| 北國銀行          | 6,700     | 2,759.00 | 18,485,300    |       |                    |
| 清水銀行          | 2,700     | 1,756.00 | 4,741,200     |       |                    |
| 富山銀行          | 1,300     | 2,291.00 | 2,978,300     |       |                    |
| 滋賀銀行          | 13,300    | 2,370.00 | 31,521,000    |       |                    |
| 南都銀行          | 10,700    | 2,092.00 | 22,384,400    |       |                    |
| 百五銀行          | 58,600    | 318.00   | 18,634,800    | 貸付株式数 | 19,200株            |
| 京都銀行          | 23,300    | 3,870.00 | 90,171,000    |       |                    |
| 紀陽銀行          | 23,500    | 1,612.00 | 37,882,000    | 貸付株式数 | 2,100株             |
| ほくほくフィナンシャルG  | 43,700    | 888.00   | 38,805,600    |       |                    |
| 広島銀行          | 96,800    | 502.00   | 48,593,600    | 貸付株式数 | 37,300株            |
| 山陰合同銀行        | 39,200    | 518.00   | 20,305,600    |       |                    |
| 中国銀行          | 55,800    | 953.00   | 53,177,400    |       |                    |
| 鳥取銀行          | 2,200     | 1,264.00 | 2,780,800     |       |                    |

|                    |           |          |               |       |         |
|--------------------|-----------|----------|---------------|-------|---------|
| 伊予銀行               | 93,000    | 626.00   | 58,218,000    | 貸付株式数 | 36,000株 |
| 百十四銀行              | 7,100     | 1,923.00 | 13,653,300    | 貸付株式数 | 2,600株  |
| 四国銀行               | 10,000    | 808.00   | 8,080,000     | 貸付株式数 | 2,900株  |
| 阿波銀行               | 10,500    | 2,562.00 | 26,901,000    | 貸付株式数 | 3,600株  |
| 大分銀行               | 3,700     | 2,280.00 | 8,436,000     |       |         |
| 宮崎銀行               | 4,400     | 2,301.00 | 10,124,400    |       |         |
| 佐賀銀行               | 3,800     | 1,157.00 | 4,396,600     |       |         |
| 沖縄銀行               | 5,900     | 3,095.00 | 18,260,500    |       |         |
| 琉球銀行               | 15,000    | 930.00   | 13,950,000    |       |         |
| セブン銀行              | 215,000   | 292.00   | 62,780,000    |       |         |
| みずほフィナンシャルG        | 8,762,900 | 133.70   | 1,171,599,730 |       |         |
| 高知銀行               | 2,500     | 681.00   | 1,702,500     |       |         |
| 山口フィナンシャルG         | 80,800    | 648.00   | 52,358,400    |       |         |
| 芙蓉総合リース            | 6,800     | 5,710.00 | 38,828,000    |       |         |
| みずほリース             | 10,000    | 2,314.00 | 23,140,000    |       |         |
| 東京センチュリー           | 13,100    | 5,480.00 | 71,788,000    | 貸付株式数 | 5,200株  |
| SBIホールディングス        | 72,600    | 2,146.00 | 155,799,600   | 貸付株式数 | 30,300株 |
| 日本証券金融             | 29,500    | 492.00   | 14,514,000    |       |         |
| アイフル               | 101,600   | 236.00   | 23,977,600    |       |         |
| 日本アジア投資            | 6,300     | 229.00   | 1,442,700     |       |         |
| 長野銀行               | 2,100     | 1,101.00 | 2,312,100     |       |         |
| 名古屋銀行              | 5,300     | 2,397.00 | 12,704,100    |       |         |
| 北洋銀行               | 97,500    | 212.00   | 20,670,000    |       |         |
| 愛知銀行               | 2,300     | 2,878.00 | 6,619,400     |       |         |
| 中京銀行               | 2,700     | 2,139.00 | 5,775,300     | 貸付株式数 | 1,000株  |
| 大光銀行               | 2,200     | 1,441.00 | 3,170,200     |       |         |
| 愛媛銀行               | 9,300     | 1,137.00 | 10,574,100    | 貸付株式数 | 2,900株  |
| トマト銀行              | 2,500     | 1,027.00 | 2,567,500     |       |         |
| 京葉銀行               | 27,500    | 495.00   | 13,612,500    | 貸付株式数 | 6,200株  |
| 栃木銀行               | 30,200    | 165.00   | 4,983,000     |       |         |
| 北日本銀行              | 2,000     | 1,922.00 | 3,844,000     |       |         |
| 東和銀行               | 11,400    | 694.00   | 7,911,600     |       |         |
| 福島銀行               | 7,300     | 179.00   | 1,306,700     |       |         |
| 大東銀行               | 3,200     | 605.00   | 1,936,000     |       |         |
| リコーリース             | 5,000     | 2,927.00 | 14,635,000    |       |         |
| イオンフィナンシャルサー<br>ビス | 40,100    | 1,228.00 | 49,242,800    | 貸付株式数 | 15,400株 |
| アコム                | 132,200   | 419.00   | 55,391,800    |       |         |
| ジャックス              | 7,200     | 1,762.00 | 12,686,400    |       |         |
| オリコ                | 173,600   | 123.00   | 21,352,800    |       |         |

|               |           |          |               |                |
|---------------|-----------|----------|---------------|----------------|
| 日立キャピタル       | 15,600    | 2,250.00 | 35,100,000    |                |
| アプラスフィナンシャル   | 34,100    | 67.00    | 2,284,700     | 貸付株式数 12,900株  |
| オリックス         | 403,700   | 1,373.00 | 554,280,100   |                |
| 三菱UFJリース      | 161,000   | 499.00   | 80,339,000    |                |
| ジャフコ          | 10,000    | 3,425.00 | 34,250,000    |                |
| 九州 リースサービス    | 2,900     | 484.00   | 1,403,600     | 貸付株式数 1,200株   |
| トモニホールディングス   | 51,100    | 340.00   | 17,374,000    |                |
| 大和証券G本社       | 516,100   | 447.60   | 231,006,360   |                |
| 野村ホールディングス    | 1,138,700 | 463.40   | 527,673,580   |                |
| 岡三証券グループ      | 54,400    | 331.00   | 18,006,400    |                |
| 丸三証券          | 19,400    | 434.00   | 8,419,600     | 貸付株式数 6,300株   |
| 東洋証券          | 24,300    | 125.00   | 3,037,500     | 貸付株式数 9,300株   |
| 東海東京HD        | 73,500    | 238.00   | 17,493,000    |                |
| 光世証券          | 1,800     | 519.00   | 934,200       | 貸付株式数 600株     |
| 水戸証券          | 18,600    | 196.00   | 3,645,600     |                |
| いちよし証券        | 11,600    | 440.00   | 5,104,000     |                |
| 松井証券          | 37,100    | 821.00   | 30,459,100    | 貸付株式数 14,400株  |
| SOMPOホールディングス | 121,700   | 3,601.00 | 438,241,700   |                |
| だいこう証券ビジ      | 3,200     | 916.00   | 2,931,200     |                |
| 日本取引所グループ     | 185,600   | 2,336.00 | 433,561,600   |                |
| マネックスG        | 50,000    | 217.00   | 10,850,000    |                |
| 極東証券          | 8,400     | 525.00   | 4,410,000     |                |
| 岩井コスモホールディング  | 5,800     | 1,002.00 | 5,811,600     |                |
| 藍澤証券          | 11,800    | 695.00   | 8,201,000     |                |
| フィデアホール       | 63,100    | 106.00   | 6,688,600     |                |
| 池田泉州HD        | 75,500    | 165.00   | 12,457,500    |                |
| アニコムホールディングス  | 5,400     | 4,675.00 | 25,245,000    | 貸付株式数 2,100株   |
| MS&AD         | 167,900   | 3,117.00 | 523,344,300   |                |
| SONY FH       | 53,600    | 2,592.00 | 138,931,200   |                |
| マネーパートナーズGP   | 6,600     | 193.00   | 1,273,800     | 貸付株式数 2,600株   |
| スパークス・グループ    | 22,900    | 204.00   | 4,671,600     |                |
| 小林洋行          | 2,800     | 250.00   | 700,000       | 貸付株式数 700株     |
| 第一生命HLDGS     | 365,100   | 1,342.00 | 489,964,200   | 貸付株式数 146,900株 |
| 東京海上HD        | 228,200   | 4,726.00 | 1,078,473,200 |                |
| アドバンテッジリスクマネ  | 3,300     | 804.00   | 2,653,200     | 貸付株式数 1,000株   |
| イー・ギャランティ     | 7,100     | 2,030.00 | 14,413,000    | 貸付株式数 2,700株   |
| アサックス         | 3,600     | 648.00   | 2,332,800     | 貸付株式数 1,200株   |

|                 |         |          |             |              |
|-----------------|---------|----------|-------------|--------------|
| NECキャピタルソリューション | 2,600   | 1,966.00 | 5,111,600   |              |
| T&Dホールディングス     | 193,500 | 949.00   | 183,631,500 |              |
| アドバンスクリエイト      | 1,600   | 2,090.00 | 3,344,000   |              |
| 三井不動産           | 318,000 | 2,044.50 | 650,151,000 |              |
| 三菱地所            | 451,800 | 1,648.00 | 744,566,400 |              |
| 平和不動産           | 11,900  | 2,967.00 | 35,307,300  |              |
| 東京建物            | 67,900  | 1,263.00 | 85,757,700  |              |
| ダイビル            | 17,000  | 968.00   | 16,456,000  |              |
| 京阪神ビルディング       | 10,600  | 1,352.00 | 14,331,200  |              |
| 住友不動産           | 144,900 | 2,849.50 | 412,892,550 |              |
| 太平洋興発           | 2,600   | 602.00   | 1,565,200   | 貸付株式数 200株   |
| テーオーシー          | 12,900  | 672.00   | 8,668,800   | 貸付株式数 4,900株 |
| 東京楽天地           | 1,200   | 4,485.00 | 5,382,000   | 貸付株式数 400株   |
| スターツコーポレーション    | 7,900   | 2,115.00 | 16,708,500  |              |
| フジ住宅            | 8,400   | 511.00   | 4,292,400   | 貸付株式数 2,900株 |
| 空港施設            | 7,200   | 405.00   | 2,916,000   |              |
| 明和地所            | 5,100   | 401.00   | 2,045,100   |              |
| ゴールドクレスト        | 5,000   | 1,462.00 | 7,310,000   | 貸付株式数 2,100株 |
| リログループ          | 34,500  | 2,125.00 | 73,312,500  |              |
| エスリード           | 2,700   | 1,345.00 | 3,631,500   |              |
| 日神グループHLDGS     | 10,300  | 369.00   | 3,800,700   | 貸付株式数 3,700株 |
| 日本エスコ           | 12,200  | 780.00   | 9,516,000   |              |
| タカラレーベン         | 30,200  | 332.00   | 10,026,400  |              |
| A V A N T I A   | 3,800   | 717.00   | 2,724,600   | 貸付株式数 1,400株 |
| イオンモール          | 31,700  | 1,423.00 | 45,109,100  |              |
| 毎日コムネット         | 2,000   | 770.00   | 1,540,000   |              |
| ファースト住建         | 3,100   | 913.00   | 2,830,300   | 貸付株式数 1,000株 |
| ランド             | 378,100 | 10.00    | 3,781,000   |              |
| カチタス            | 16,400  | 2,629.00 | 43,115,600  | 貸付株式数 200株   |
| 東祥              | 3,900   | 1,282.00 | 4,999,800   | 貸付株式数 400株   |
| トーセイ            | 9,400   | 1,068.00 | 10,039,200  |              |
| 穴吹興産            | 1,700   | 1,760.00 | 2,992,000   | 貸付株式数 500株   |
| サンフロンティア不動産     | 9,500   | 850.00   | 8,075,000   |              |
| インテリックス         | 2,900   | 481.00   | 1,394,900   | 貸付株式数 100株   |
| ランドビジネス         | 3,000   | 375.00   | 1,125,000   | 貸付株式数 1,000株 |
| 日本社宅サービス        | 1,900   | 1,076.00 | 2,044,400   | 貸付株式数 700株   |
| グランディハウス        | 5,800   | 378.00   | 2,192,400   |              |
| 東武鉄道            | 68,400  | 3,695.00 | 252,738,000 |              |
| 相鉄ホールディングス      | 21,000  | 2,901.00 | 60,921,000  |              |

|               |         |           |             |       |         |
|---------------|---------|-----------|-------------|-------|---------|
| 東急            | 164,400 | 1,581.00  | 259,916,400 |       |         |
| 京浜急行          | 83,800  | 1,694.00  | 141,957,200 | 貸付株式数 | 12,300株 |
| 小田急電鉄         | 97,600  | 2,626.00  | 256,297,600 | 貸付株式数 | 4,400株  |
| 京王電鉄          | 34,100  | 6,140.00  | 209,374,000 |       |         |
| 京成電鉄          | 45,800  | 3,390.00  | 155,262,000 |       |         |
| 富士急行          | 9,000   | 3,075.00  | 27,675,000  | 貸付株式数 | 3,600株  |
| 新京成電鉄         | 1,700   | 2,207.00  | 3,751,900   |       |         |
| 東日本旅客鉄道       | 114,800 | 8,153.00  | 935,964,400 |       |         |
| 西日本旅客鉄道       | 58,400  | 6,391.00  | 373,234,400 |       |         |
| 東海旅客鉄道        | 54,300  | 17,705.00 | 961,381,500 |       |         |
| 西武ホールディングス    | 87,600  | 1,270.00  | 111,252,000 |       |         |
| 鴻池運輸          | 9,800   | 1,151.00  | 11,279,800  |       |         |
| 西日本鉄道         | 18,200  | 2,862.00  | 52,088,400  | 貸付株式数 | 3,500株  |
| ハマキョウレックス     | 5,000   | 3,150.00  | 15,750,000  |       |         |
| サカイ引越センター     | 3,500   | 5,800.00  | 20,300,000  |       |         |
| 近鉄グループHLDGS   | 62,000  | 5,010.00  | 310,620,000 |       |         |
| 阪急阪神HLDGS     | 82,200  | 3,730.00  | 306,606,000 |       |         |
| 南海電鉄          | 29,100  | 2,504.00  | 72,866,400  |       |         |
| 京阪ホールディングス    | 27,500  | 4,850.00  | 133,375,000 | 貸付株式数 | 400株    |
| 神戸電鉄          | 1,500   | 3,670.00  | 5,505,000   | 貸付株式数 | 600株    |
| 名古屋鉄道         | 50,700  | 3,075.00  | 155,902,500 | 貸付株式数 | 11,400株 |
| 山陽電鉄          | 4,700   | 2,160.00  | 10,152,000  | 貸付株式数 | 1,700株  |
| トランコム         | 1,800   | 6,900.00  | 12,420,000  |       |         |
| 日本通運          | 21,500  | 5,680.00  | 122,120,000 |       |         |
| ヤマトホールディングス   | 109,200 | 2,394.00  | 261,424,800 |       |         |
| 山 九           | 17,200  | 4,035.00  | 69,402,000  |       |         |
| 日 新           | 5,400   | 1,601.00  | 8,645,400   |       |         |
| 丸 運           | 3,500   | 234.00    | 819,000     |       |         |
| 丸全昭和運輸        | 5,100   | 2,872.00  | 14,647,200  |       |         |
| センコーグループHLDGS | 33,400  | 801.00    | 26,753,400  |       |         |
| トナミホールディングス   | 1,500   | 6,030.00  | 9,045,000   |       |         |
| ニッコンホールディングス  | 21,900  | 2,146.00  | 46,997,400  |       |         |
| 日石輸送          | 600     | 3,005.00  | 1,803,000   |       |         |
| 福山通運          | 7,900   | 3,575.00  | 28,242,500  | 貸付株式数 | 3,200株  |
| セイノーホールディングス  | 46,300  | 1,424.00  | 65,931,200  |       |         |
| エスライン         | 1,800   | 1,010.00  | 1,818,000   | 貸付株式数 | 100株    |
| 神奈川中央交通       | 1,600   | 4,125.00  | 6,600,000   |       |         |
| 日立物流          | 11,300  | 2,839.00  | 32,080,700  |       |         |

|                                  |         |          |             |                             |
|----------------------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| 丸和運輸機関                           | 6,600   | 2,823.00 | 18,631,800  | 貸付株式数<br>2,600株<br>(1,400株) |
| C & F ロジホールディングス                 | 6,400   | 1,400.00 | 8,960,000   |                             |
| 日本郵船                             | 51,400  | 1,472.00 | 75,660,800  |                             |
| 商船三井                             | 39,000  | 1,836.00 | 71,604,000  |                             |
| 川崎汽船                             | 19,500  | 980.00   | 19,110,000  | 貸付株式数<br>7,800株             |
| N S ユナイテッド海運                     | 3,300   | 1,463.00 | 4,827,900   |                             |
| 明治海運                             | 6,300   | 320.00   | 2,016,000   |                             |
| 飯野海運                             | 29,300  | 333.00   | 9,756,900   | 貸付株式数<br>3,700株             |
| 共栄タンカー                           | 1,200   | 795.00   | 954,000     |                             |
| 九州旅客鉄道                           | 54,600  | 2,899.00 | 158,285,400 |                             |
| S G ホールディングス                     | 65,400  | 3,455.00 | 225,957,000 | 貸付株式数<br>26,200株            |
| 日本航空                             | 110,200 | 2,092.00 | 230,538,400 |                             |
| A N A ホールディングス                   | 114,600 | 2,565.50 | 294,006,300 |                             |
| パスコ                              | 1,300   | 1,465.00 | 1,904,500   |                             |
| 西本W I S M E T T A C<br>H D       | 1,200   | 2,037.00 | 2,444,400   | 貸付株式数<br>100株               |
| ヤマシタヘルスケアH L D<br>G S            | 700     | 1,767.00 | 1,236,900   |                             |
| G E N K Y D R U G S T<br>O R E S | 2,900   | 3,270.00 | 9,483,000   | 貸付株式数<br>1,100株             |
| 国際紙パルプ商事                         | 15,900  | 286.00   | 4,547,400   |                             |
| ブックオフG H D                       | 3,900   | 802.00   | 3,127,800   | 貸付株式数<br>1,500株<br>(100株)   |
| 三菱倉庫                             | 19,300  | 2,701.00 | 52,129,300  |                             |
| 三井倉庫H O L D                      | 7,100   | 1,501.00 | 10,657,100  |                             |
| 住友倉庫                             | 21,500  | 1,295.00 | 27,842,500  |                             |
| 渋沢倉庫                             | 3,400   | 2,019.00 | 6,864,600   | 貸付株式数<br>1,200株             |
| ヤマタネ                             | 3,200   | 1,169.00 | 3,740,800   |                             |
| 東陽倉庫                             | 11,000  | 320.00   | 3,520,000   |                             |
| 乾汽船                              | 3,700   | 930.00   | 3,441,000   | 貸付株式数<br>1,300株             |
| 日本トランスシティ                        | 13,900  | 538.00   | 7,478,200   |                             |
| ケイヒン                             | 1,000   | 1,281.00 | 1,281,000   |                             |
| 中央倉庫                             | 3,600   | 959.00   | 3,452,400   |                             |
| 川西倉庫                             | 1,100   | 1,017.00 | 1,118,700   | 貸付株式数<br>400株               |
| 安田倉庫                             | 4,800   | 880.00   | 4,224,000   |                             |
| ファイズホールディングス                     | 1,400   | 1,174.00 | 1,643,600   | 貸付株式数<br>300株               |
| 東洋埠頭                             | 1,900   | 1,323.00 | 2,513,700   |                             |
| 宇徳                               | 5,400   | 455.00   | 2,457,000   |                             |

|                 |         |           |               |                           |
|-----------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 上組              | 34,700  | 2,092.00  | 72,592,400    |                           |
| サンリツ            | 1,400   | 601.00    | 841,400       | 貸付株式数 300株                |
| キムラユニティー        | 1,500   | 994.00    | 1,491,000     |                           |
| キューソー流通システム     | 1,600   | 1,563.00  | 2,500,800     | 貸付株式数 300株<br>(300株)      |
| 近鉄エクスプレス        | 13,300  | 1,744.00  | 23,195,200    |                           |
| 東海運             | 3,600   | 265.00    | 954,000       | 貸付株式数 1,300株              |
| エーアイテイナー        | 4,400   | 753.00    | 3,313,200     |                           |
| 内外トランスライン       | 2,100   | 999.00    | 2,097,900     |                           |
| ショーエイコーポ        | 700     | 853.00    | 597,100       | 貸付株式数 200株                |
| 日本コンセプト         | 2,000   | 1,312.00  | 2,624,000     |                           |
| 東京放送HD          | 39,500  | 1,672.00  | 66,044,000    | 貸付株式数 15,700株             |
| 日本テレビHLDS       | 52,700  | 1,171.00  | 61,711,700    |                           |
| 朝日放送グループHD      | 6,200   | 788.00    | 4,885,600     | 貸付株式数 300株                |
| テレビ朝日HD         | 17,800  | 1,543.00  | 27,465,400    | 貸付株式数 7,300株              |
| スカパーJSA THD     | 41,200  | 430.00    | 17,716,000    |                           |
| テレビ東京HD         | 5,300   | 2,369.00  | 12,555,700    |                           |
| 日本BS放送          | 2,100   | 1,037.00  | 2,177,700     | 貸付株式数 800株                |
| ビジョン            | 6,100   | 747.00    | 4,556,700     | 貸付株式数 2,400株              |
| スマートバリュー        | 1,800   | 1,128.00  | 2,030,400     | 貸付株式数 600株                |
| USEN-NEXT HLDGS | 2,600   | 1,226.00  | 3,187,600     | 貸付株式数 900株                |
| ワイヤレスゲート        | 3,200   | 603.00    | 1,929,600     | 貸付株式数 1,200株              |
| コネクシオ           | 3,700   | 1,400.00  | 5,180,000     |                           |
| 日本通信            | 51,500  | 151.00    | 7,776,500     | 貸付株式数 20,100株<br>(1,000株) |
| クロップス           | 1,300   | 715.00    | 929,500       |                           |
| 日本電信電話          | 858,100 | 2,474.00  | 2,122,939,400 | 貸付株式数 337,000株            |
| KDDI            | 478,400 | 3,141.00  | 1,502,654,400 | 貸付株式数 187,900株            |
| ソフトバンク          | 583,400 | 1,346.00  | 785,256,400   |                           |
| 光通信             | 6,700   | 23,610.00 | 158,187,000   |                           |
| NTTドコモ          | 458,400 | 2,895.00  | 1,327,068,000 | 貸付株式数 186,200株            |
| エムティーアイ         | 6,300   | 605.00    | 3,811,500     |                           |
| GMOインターネット      | 25,700  | 2,680.00  | 68,876,000    | 貸付株式数 10,200株             |
| ファイバーゲート        | 1,700   | 1,329.00  | 2,259,300     | 貸付株式数 600株                |
| アイドママーケティングコム   | 2,100   | 474.00    | 995,400       |                           |
| KADOKAWA        | 17,600  | 1,774.00  | 31,222,400    |                           |
| 学研ホールディングス      | 8,800   | 1,458.00  | 12,830,400    |                           |
| ゼンリン            | 12,900  | 1,221.00  | 15,750,900    |                           |

|               |         |           |             |       |        |
|---------------|---------|-----------|-------------|-------|--------|
| 昭文社ホールディングス   | 3,100   | 404.00    | 1,252,400   | 貸付株式数 | 1,100株 |
| インプレスホールディングス | 5,300   | 141.00    | 747,300     |       |        |
| 東京電力HD        | 526,300 | 344.00    | 181,047,200 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 中部電力          | 199,000 | 1,412.50  | 281,087,500 |       |        |
| 関西電力          | 247,600 | 1,070.00  | 264,932,000 |       |        |
| 中国電力          | 94,100  | 1,440.00  | 135,504,000 |       |        |
| 北陸電力          | 60,100  | 690.00    | 41,469,000  |       |        |
| 東北電力          | 161,900 | 1,051.00  | 170,156,900 |       |        |
| 四国電力          | 58,600  | 809.00    | 47,407,400  |       |        |
| 九州電力          | 135,300 | 904.00    | 122,311,200 |       |        |
| 北海道電力         | 61,900  | 420.00    | 25,998,000  |       |        |
| 沖縄電力          | 12,700  | 1,792.00  | 22,758,400  |       |        |
| 電源開発          | 51,900  | 1,999.00  | 103,748,100 |       |        |
| エフオン          | 3,700   | 546.00    | 2,020,200   | 貸付株式数 | 1,200株 |
| イーレックス        | 9,600   | 1,339.00  | 12,854,400  |       |        |
| レノバ           | 11,200  | 891.00    | 9,979,200   | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 東京瓦斯          | 125,900 | 2,469.50  | 310,910,050 |       |        |
| 大阪瓦斯          | 126,800 | 2,078.00  | 263,490,400 |       |        |
| 東邦瓦斯          | 32,400  | 5,530.00  | 179,172,000 |       |        |
| 北海道瓦斯         | 3,600   | 1,589.00  | 5,720,400   |       |        |
| 広島ガス          | 12,800  | 348.00    | 4,454,400   | 貸付株式数 | 4,500株 |
| 西部瓦斯          | 7,400   | 2,543.00  | 18,818,200  |       |        |
| 静岡ガス          | 18,400  | 968.00    | 17,811,200  |       |        |
| メタウォーター       | 3,200   | 4,635.00  | 14,832,000  |       |        |
| アイネット         | 3,400   | 1,405.00  | 4,777,000   |       |        |
| 松竹            | 4,200   | 14,160.00 | 59,472,000  | 貸付株式数 | 1,300株 |
| 東宝            | 37,700  | 3,890.00  | 146,653,000 |       |        |
| エイチ・アイ・エス     | 10,000  | 1,768.00  | 17,680,000  | 貸付株式数 | 4,000株 |
| 東映            | 2,400   | 14,340.00 | 34,416,000  |       |        |
| ラックランド        | 1,500   | 2,145.00  | 3,217,500   | 貸付株式数 | 500株   |
| NTTデータ        | 172,800 | 1,185.00  | 204,768,000 |       |        |
| 共立メンテナンス      | 10,600  | 3,520.00  | 37,312,000  | 貸付株式数 | 4,100株 |
| イチネンホールディングス  | 7,200   | 1,186.00  | 8,539,200   |       |        |
| 建設技術研究所       | 4,400   | 1,645.00  | 7,238,000   |       |        |
| スペース          | 3,900   | 983.00    | 3,833,700   |       |        |
| 長大            | 2,400   | 1,028.00  | 2,467,200   |       |        |
| アインホールディングス   | 8,000   | 6,910.00  | 55,280,000  | 貸付株式数 | 3,200株 |
| 燦ホールディングス     | 2,700   | 1,180.00  | 3,186,000   |       |        |

|                     |        |          |             |       |                  |
|---------------------|--------|----------|-------------|-------|------------------|
| ピー・シー・エー            | 900    | 4,195.00 | 3,775,500   | 貸付株式数 | 300株             |
| スバル興業               | 400    | 7,350.00 | 2,940,000   |       |                  |
| 東京テアトル              | 3,100  | 1,225.00 | 3,797,500   | 貸付株式数 | 900株             |
| タナベ経営               | 1,100  | 1,271.00 | 1,398,100   |       |                  |
| ビジネスB太田昭和           | 1,100  | 2,570.00 | 2,827,000   | 貸付株式数 | 200株             |
| ナガワ                 | 2,000  | 7,260.00 | 14,520,000  | 貸付株式数 | 800株             |
| よみうりランド             | 1,400  | 3,615.00 | 5,061,000   | 貸付株式数 | 500株             |
| 東京都競馬               | 4,200  | 3,525.00 | 14,805,000  | 貸付株式数 | 1,600株           |
| 常磐興産                | 2,600  | 1,454.00 | 3,780,400   | 貸付株式数 | 1,000株           |
| カナモト                | 10,100 | 2,245.00 | 22,674,500  | 貸付株式数 | 4,100株           |
| 東京ドーム               | 26,400 | 784.00   | 20,697,600  | 貸付株式数 | 8,400株           |
| D T S               | 14,700 | 2,250.00 | 33,075,000  |       |                  |
| スクウェア・エニックス・HD      | 27,600 | 5,440.00 | 150,144,000 | 貸付株式数 | 11,000株          |
| シーイーシー              | 7,100  | 1,731.00 | 12,290,100  |       |                  |
| カプコン                | 30,500 | 3,850.00 | 117,425,000 |       |                  |
| 西尾レントオール            | 5,600  | 2,158.00 | 12,084,800  |       |                  |
| アイ・エス・ビー            | 1,400  | 1,959.00 | 2,742,600   | 貸付株式数 | 500株             |
| アゴーラ・ホスピタリティーG      | 47,500 | 27.00    | 1,282,500   |       |                  |
| 日本空港ビルデング           | 20,900 | 4,680.00 | 97,812,000  | 貸付株式数 | 8,300株           |
| トランス・コスモス           | 6,100  | 2,200.00 | 13,420,000  |       |                  |
| 乃村工藝社               | 26,900 | 909.00   | 24,452,100  |       |                  |
| ジャステック              | 4,200  | 1,203.00 | 5,052,600   |       |                  |
| S C S K             | 15,100 | 5,220.00 | 78,822,000  |       |                  |
| 藤田観光                | 2,900  | 1,754.00 | 5,086,600   | 貸付株式数 | 1,100株<br>(100株) |
| K N T - C Tホールディングス | 3,900  | 1,022.00 | 3,985,800   |       |                  |
| 日本管財                | 7,200  | 1,869.00 | 13,456,800  | 貸付株式数 | 2,500株           |
| トーカイ                | 6,200  | 2,556.00 | 15,847,200  |       |                  |
| 白洋舎                 | 800    | 2,906.00 | 2,324,800   | 貸付株式数 | 300株             |
| セコム                 | 66,500 | 9,326.00 | 620,179,000 | 貸付株式数 | 26,000株          |
| 日本システムウエア           | 2,200  | 2,161.00 | 4,754,200   |       |                  |
| セントラル警備保障           | 3,100  | 4,180.00 | 12,958,000  |       |                  |
| アイネス                | 6,500  | 1,301.00 | 8,456,500   |       |                  |
| 丹青社                 | 11,900 | 765.00   | 9,103,500   |       |                  |
| メイテック               | 7,900  | 5,150.00 | 40,685,000  |       |                  |
| T K C               | 5,600  | 5,430.00 | 30,408,000  |       |                  |
| 富士ソフト               | 8,500  | 4,210.00 | 35,785,000  |       |                  |

|                 |         |           |             |                          |
|-----------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 応用地質            | 6,900   | 1,336.00  | 9,218,400   |                          |
| 船井総研ホールディング     | 13,000  | 2,346.00  | 30,498,000  |                          |
| N S D           | 21,300  | 1,595.00  | 33,973,500  |                          |
| 進学会ホールディングス     | 2,500   | 499.00    | 1,247,500   | 貸付株式数 100株               |
| 丸紅建材リース         | 700     | 1,540.00  | 1,078,000   | 貸付株式数 200株               |
| オ オ バ           | 4,800   | 604.00    | 2,899,200   |                          |
| コナミホールディングス     | 23,500  | 3,530.00  | 82,955,000  |                          |
| いであ             | 1,300   | 1,745.00  | 2,268,500   | 貸付株式数 400株               |
| 学 究 社           | 1,800   | 1,100.00  | 1,980,000   |                          |
| ベネッセホールディングス    | 20,700  | 2,774.00  | 57,421,800  |                          |
| イオンディライト        | 7,800   | 3,140.00  | 24,492,000  |                          |
| ナック             | 4,000   | 857.00    | 3,428,000   |                          |
| 福井コンピュータH L D S | 2,600   | 2,644.00  | 6,874,400   | 貸付株式数 1,000株             |
| ニチイ学館           | 9,200   | 1,600.00  | 14,720,000  |                          |
| ダイセキ            | 10,700  | 2,594.00  | 27,755,800  |                          |
| ステップ            | 2,300   | 1,423.00  | 3,272,900   |                          |
| 日鉄物産            | 4,600   | 3,505.00  | 16,123,000  |                          |
| 泉州電業            | 2,000   | 2,720.00  | 5,440,000   |                          |
| 元気寿司            | 1,700   | 2,363.00  | 4,017,100   |                          |
| トラスコ中山          | 13,600  | 2,563.00  | 34,856,800  |                          |
| ヤマダ電機           | 199,100 | 542.00    | 107,912,200 |                          |
| オートバックスセブン      | 23,900  | 1,377.00  | 32,910,300  |                          |
| モリト             | 4,700   | 655.00    | 3,078,500   | 貸付株式数 1,800株             |
| アークランドサカモト      | 10,100  | 1,604.00  | 16,200,400  |                          |
| ニトリホールディングス     | 28,000  | 19,085.00 | 534,380,000 |                          |
| グルメ杵屋           | 4,500   | 964.00    | 4,338,000   | 貸付株式数 1,800株<br>(200株)   |
| 愛 眼             | 5,400   | 216.00    | 1,166,400   | 貸付株式数 1,300株             |
| ケーユーホールディングス    | 3,400   | 808.00    | 2,747,200   | 貸付株式数 200株               |
| 吉野家ホールディングス     | 21,700  | 2,253.00  | 48,890,100  | 貸付株式数 8,500株             |
| 加藤産業            | 9,600   | 3,615.00  | 34,704,000  |                          |
| 北恵              | 1,300   | 943.00    | 1,225,900   |                          |
| イノテック           | 3,900   | 943.00    | 3,677,700   |                          |
| イエローハット         | 12,300  | 1,412.00  | 17,367,600  |                          |
| 松屋フーズH L D G S  | 3,200   | 3,650.00  | 11,680,000  | 貸付株式数 1,100株<br>(1,100株) |
| J B C Cホールディングス | 4,500   | 1,471.00  | 6,619,500   |                          |
| J Kホールディングス     | 6,000   | 785.00    | 4,710,000   | 貸付株式数 2,100株             |
| サガミホールディングス     | 8,800   | 1,239.00  | 10,903,200  | 貸付株式数 3,500株             |
| 日 伝             | 6,000   | 2,261.00  | 13,566,000  | 貸付株式数 2,200株             |

|                    |         |           |                 |                             |
|--------------------|---------|-----------|-----------------|-----------------------------|
| 関西スーパーマーケット        | 5,500   | 1,078.00  | 5,929,000       |                             |
| ミロク情報サービス          | 5,900   | 2,339.00  | 13,800,100      | 貸付株式数<br>1,500株<br>(100株)   |
| 北沢産業               | 5,200   | 271.00    | 1,409,200       | 貸付株式数<br>200株               |
| 杉本商事               | 3,400   | 1,831.00  | 6,225,400       | 貸付株式数<br>1,300株             |
| 因幡電機産業             | 18,400  | 2,332.00  | 42,908,800      |                             |
| 王将フードサービス          | 4,800   | 6,000.00  | 28,800,000      |                             |
| プレナス               | 7,100   | 1,784.00  | 12,666,400      | 貸付株式数<br>3,000株<br>(1,700株) |
| ミニストップ             | 4,700   | 1,530.00  | 7,191,000       | 貸付株式数<br>1,700株             |
| アークス               | 13,000  | 2,140.00  | 27,820,000      |                             |
| バローホールディングス        | 14,400  | 2,145.00  | 30,888,000      |                             |
| 東 テ ク              | 2,100   | 2,010.00  | 4,221,000       |                             |
| ミスミグループ本社          | 80,900  | 2,682.00  | 216,973,800     |                             |
| 藤 久                | 600     | 1,000.00  | 600,000         | 貸付株式数<br>200株               |
| アルテック              | 5,600   | 220.00    | 1,232,000       |                             |
| ベ ル ク              | 3,200   | 6,700.00  | 21,440,000      |                             |
| 大 庄                | 3,400   | 1,271.00  | 4,321,400       | 貸付株式数<br>1,300株             |
| タキヒヨー              | 2,000   | 1,755.00  | 3,510,000       | 貸付株式数<br>700株               |
| ファーストリテイリング        | 8,700   | 60,800.00 | 528,960,000     | 貸付株式数<br>3,500株             |
| ソフトバンクグループ         | 510,100 | 4,905.00  | 2,502,040,500   | 貸付株式数<br>200,000株           |
| 蔵王産業               | 1,200   | 1,415.00  | 1,698,000       |                             |
| スズケン               | 27,400  | 3,960.00  | 108,504,000     |                             |
| サンドラッグ             | 24,400  | 3,525.00  | 86,010,000      |                             |
| サックスパーホールディング<br>グ | 5,200   | 576.00    | 2,995,200       | 貸付株式数<br>1,600株             |
| ジェコス               | 4,200   | 875.00    | 3,675,000       |                             |
| ヤマザワ               | 1,400   | 1,696.00  | 2,374,400       | 貸付株式数<br>100株               |
| や ま や              | 1,300   | 2,266.00  | 2,945,800       |                             |
| グローセル              | 6,300   | 444.00    | 2,797,200       |                             |
| ベルーナ               | 13,500  | 609.00    | 8,221,500       |                             |
| 合計                 |         |           | 140,637,428,520 |                             |

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

|               |          |        |         |
|---------------|----------|--------|---------|
| ソ ニ ー         | 20,000株  | トヨタ自動車 | 40,000株 |
| 三菱UFJフィナンシャルG | 200,000株 |        |         |

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

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類     | 銘 柄            | 券面総額   | 評価額<br>(円) | 備考 |
|---------|----------------|--------|------------|----|
| 新株予約権証券 | 千葉興業銀行第7回新株予約権 | 17,700 | 0          |    |
| 新株予約権証券 | 合計             |        | 0          |    |
| 合計      |                |        | 0          |    |

新株予約権証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 23,471,509          | 32,565,668          |
| 親投資信託受益証券       | 8,150,957,344       | 11,208,631,490      |
| 未収入金            | 4,080,000           | -                   |
| 流動資産合計          | 8,178,508,853       | 11,241,197,158      |
| 資産合計            | 8,178,508,853       | 11,241,197,158      |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 14,077,007          | 12,275,583          |
| 未払受託者報酬         | 767,469             | 1,165,534           |
| 未払委託者報酬         | 11,128,790          | 16,900,933          |
| その他未払費用         | 193,744             | 291,306             |
| 流動負債合計          | 26,167,010          | 30,633,356          |
| 負債合計            | 26,167,010          | 30,633,356          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,616,193,495       | 1,815,504,515       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,989,148,348       | 3,057,059,287       |
| （分配準備積立金）       | 608,929,059         | 476,041,784         |
| 元本等合計           | 8,152,341,843       | 11,210,563,802      |
| 純資産合計           | 8,152,341,843       | 11,210,563,802      |
| 負債純資産合計         | 8,178,508,853       | 11,241,197,158      |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |                      | 第4期                          |                      |
|---|------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |                      | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |                      |
| <b>営業収益</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 受取利息                                      |                              | -                    |                              | 54                   |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 359,039,325          |                              | 333,364,146          |
| <b>営業収益合計</b>                             |                              | <b>359,039,325</b>   |                              | <b>333,364,200</b>   |
| <b>営業費用</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 支払利息                                      |                              | 7,391                |                              | 11,605               |
| 受託者報酬                                     |                              | 1,489,948            |                              | 2,177,339            |
| 委託者報酬                                     |                              | 21,605,307           |                              | 31,572,809           |
| その他費用                                     |                              | 378,368              |                              | 547,353              |
| <b>営業費用合計</b>                             |                              | <b>23,481,014</b>    |                              | <b>34,309,106</b>    |
| <b>営業利益又は営業損失（ ）</b>                      |                              | <b>382,520,339</b>   |                              | <b>299,055,094</b>   |
| <b>経常利益又は経常損失（ ）</b>                      |                              | <b>382,520,339</b>   |                              | <b>299,055,094</b>   |
| <b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>                    |                              | <b>382,520,339</b>   |                              | <b>299,055,094</b>   |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） |                              | 28,349,437           |                              | 60,215,420           |
| <b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>                    |                              | <b>1,911,487,885</b> |                              | <b>1,989,148,348</b> |
| <b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>                     |                              | <b>942,530,739</b>   |                              | <b>1,431,147,797</b> |
| <b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>            |                              | <b>942,530,739</b>   |                              | <b>1,431,147,797</b> |
| <b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>                     |                              | <b>510,699,374</b>   |                              | <b>602,076,532</b>   |
| <b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>            |                              | <b>510,699,374</b>   |                              | <b>602,076,532</b>   |
| <b>分配金</b>                                |                              | <b>1 -</b>           |                              | <b>1 -</b>           |
| <b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>                    |                              | <b>1,989,148,348</b> |                              | <b>3,057,059,287</b> |

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 4,712,067,908円 | 6,163,193,495円 |
| 期中追加設定元本額           | 2,731,635,338円 | 3,775,885,438円 |
| 期中一部解約元本額           | 1,280,509,751円 | 1,785,574,418円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 6,163,193,495口 | 8,153,504,515口 |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,380,229,956円)及び分配準備積立金(608,929,059円)より分配対象額は1,989,159,015円(1万口当たり3,227.48円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,619,060,612円)及び分配準備積立金(476,041,784円)より分配対象額は3,095,102,396円(1万口当たり3,796.04円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                  | 第4期                  |
|-----------|----------------------|----------------------|
|           | 2019年6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 351,802,133          | 313,344,362          |
| 合計        | 351,802,133          | 313,344,362          |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3227円<br>(13,227円) | 1.3749円<br>(13,749円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                   | 券面総額          | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|--------------|-----------------------|---------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | ストックインデックス225・マザーファンド | 4,073,792,066 | 11,208,631,490 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                       |               | 11,208,631,490 |    |
| 合計           |                       |               | 11,208,631,490 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金 額 (円)      | 金 額 (円)      |
| 資産の部 |              |              |

|                 |     |                 |
|-----------------|-----|-----------------|
| 流動資産            |     |                 |
| コール・ローン         |     | 2,801,951,624   |
| 株式              | 2 3 | 168,003,484,800 |
| 派生商品評価勘定        |     | 38,920          |
| 未収配当金           |     | 1,161,828,720   |
| 未収利息            |     | -               |
| 前払金             |     | 19,270,000      |
| その他未収収益         | 4   | -               |
| 差入委託証拠金         |     | -               |
| 流動資産合計          |     | 171,986,574,064 |
| 資産合計            |     | 171,986,574,064 |
| 負債の部            |     |                 |
| 流動負債            |     |                 |
| 派生商品評価勘定        |     | 12,019,360      |
| 未払解約金           |     | 54,253,700      |
| 受入担保金           |     | -               |
| 流動負債合計          |     | 66,273,060      |
| 負債合計            |     | 66,273,060      |
| 純資産の部           |     |                 |
| 元本等             |     |                 |
| 元本              | 1   | 65,172,307,878  |
| 剰余金             |     |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) |     | 106,747,993,126 |
| 元本等合計           |     | 171,920,301,004 |
| 純資産合計           |     | 171,920,301,004 |
| 負債純資産合計         |     | 171,986,574,064 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式                           |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                       | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
|---|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                                   | 2018年6月16日      | 2019年6月18日      |
| 期首元本額                                     | 55,624,307,757円 | 65,172,307,878円 |
| 期中追加設定元本額                                 | 21,184,807,596円 | 16,033,323,039円 |
| 期中一部解約元本額                                 | 11,636,807,475円 | 23,206,224,212円 |
| 期末元本額の内訳                                  |                 |                 |
| ファンド名                                     |                 |                 |
| ストック インデックス ファ<br>ンド225                   | 32,941,137,853円 | 26,392,822,617円 |
| 適格機関投資家専用・ダイ<br>ワ・ストックインデックス<br>ファンド225VA | 668,369,882円    | 494,444,637円    |
| 大和 スtock インデックス<br>225 ファンド               | 11,548,166,311円 | 9,505,686,495円  |
| D-I's 日経225イン<br>デックス                     | 196,978,371円    | 159,930,107円    |
| iFree 日経225イン<br>デックス                     | 1,909,011,874円  | 3,558,988,869円  |

|    |  |   |   |
|----|--|---|---|
|    | DC・ダイワ・ストックイン<br>デックス225(確定拠出年<br>金専用ファンド) | 5,572,832,122円  | 5,445,218,527円  |
|    | ダイワ・ノーロード 日経2<br>25ファンド                    | 348,677,753円  | 322,149,773円  |
|    | ダイワファンドラップ 日経<br>225インデックス                 | 3,089,941,751円  | 4,073,792,066円  |
|    | ダイワ日経225インデック<br>ス(ダイワSMA専用)               | 13,075,654円   | 138,093,712円  |
|    | ダイワ・インデックスセレクト<br>日経225                    | 8,884,116,307円  | 7,908,279,902円  |
|    | 計  | 65,172,307,878円   | 57,999,406,705円   |
| 2. | 期末日における受益権の総数                              | 65,172,307,878口   | 57,999,406,705口   |
| 3. | 2 貸付有価証券                                   |   | 株券貸借取引契約により、以<br>下のとおり有価証券の貸付を<br>行っております。<br>株式 13,805,877,100円      |
| 4. | 3 差入委託証拠金代用有価証券                            | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>株式 2,771,150,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>株式 2,281,750,000円 |
| 5. | 4 その他未収収益                                  |   | 貸付有価証券に係る配当金相<br>当額の未入金分26,566,350円<br>が含まれております。                     |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区分              | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15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<br>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<br>の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15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<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類 | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|-----|------------------------|------------------------|
|     | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式  | 16,247,051,021         | 1,271,816,979          |

|    |                |               |
|----|----------------|---------------|
| 合計 | 16,247,051,021 | 1,271,816,979 |
|----|----------------|---------------|

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年9月20日から2019年6月17日まで、及び2019年9月20日から2020年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

| 種類   | 2019年6月17日 現在 |           |               |             | 2020年6月15日 現在 |           |               |             |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|      | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      | (円)           | うち<br>1年超 |               |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 株価指数 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買建   | 3,930,900,000 | -         | 3,919,020,000 | 11,880,000  | 3,199,403,200 | -         | 2,989,000,000 | 210,403,200 |
| 合計   | 3,930,900,000 | -         | 3,919,020,000 | 11,880,000  | 3,199,403,200 | -         | 2,989,000,000 | 210,403,200 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

|              | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.6379円      | 2.7514円      |
| (1万口当たり純資産額) | (26,379円)    | (27,514円)    |

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | 備考 |
|----|-----|--------|----|
|----|-----|--------|----|

|                 |         | 単 価      | 金 額           |               |
|-----------------|---------|----------|---------------|---------------|
| 日本水産            | 262,000 | 473.00   | 123,926,000   |               |
| マルハニチロ          | 26,200  | 2,129.00 | 55,779,800    |               |
| 国際石油開発帝石        | 104,800 | 706.10   | 73,999,280    |               |
| コムシスホールディングス    | 262,000 | 2,899.00 | 759,538,000   | 貸付株式数 50,000株 |
| 大成建設            | 52,400  | 3,790.00 | 198,596,000   |               |
| 大 林 組           | 262,000 | 996.00   | 260,952,000   |               |
| 清水建設            | 262,000 | 845.00   | 221,390,000   |               |
| 長谷工コーポレーション     | 52,400  | 1,294.00 | 67,805,600    | 貸付株式数 19,200株 |
| 鹿島建設            | 131,000 | 1,202.00 | 157,462,000   |               |
| 大和ハウス           | 262,000 | 2,646.50 | 693,383,000   |               |
| 積水ハウス           | 262,000 | 2,019.00 | 528,978,000   |               |
| 日揮ホールディングス      | 262,000 | 1,122.00 | 293,964,000   |               |
| 日清製粉G本社         | 262,000 | 1,632.00 | 427,584,000   | 貸付株式数 10,000株 |
| 明治ホールディングス      | 52,400  | 8,290.00 | 434,396,000   |               |
| 日本ハム            | 131,000 | 4,075.00 | 533,825,000   | 貸付株式数 39,100株 |
| エムスリー           | 628,800 | 4,330.00 | 2,722,704,000 |               |
| ディー・エヌ・エー       | 78,600  | 1,424.00 | 111,926,400   |               |
| サッポロホールディングス    | 52,400  | 1,962.00 | 102,808,800   |               |
| アサヒグループホールディングン | 262,000 | 3,896.00 | 1,020,752,000 | 貸付株式数 32,600株 |
| 麒麟HD            | 262,000 | 2,242.00 | 587,404,000   |               |
| 宝ホールディングス       | 262,000 | 930.00   | 243,660,000   | 貸付株式数 96,000株 |
| 双日              | 26,200  | 238.00   | 6,235,600     |               |
| キッコーマン          | 262,000 | 4,950.00 | 1,296,900,000 | 貸付株式数 96,000株 |
| 味の素             | 262,000 | 1,796.00 | 470,552,000   |               |
| ニチレイ            | 131,000 | 2,996.00 | 392,476,000   |               |
| 日本たばこ産業         | 262,000 | 2,104.50 | 551,379,000   |               |
| J. フロント リテイリング  | 131,000 | 861.00   | 112,791,000   |               |
| 三越伊勢丹HD         | 262,000 | 681.00   | 178,422,000   |               |
| 東洋紡             | 26,200  | 1,437.00 | 37,649,400    |               |
| ユニチカ            | 26,200  | 340.00   | 8,908,000     |               |
| 日清紡ホールディングス     | 262,000 | 775.00   | 203,050,000   | 貸付株式数 80,000株 |
| 東急不動産HD         | 262,000 | 521.00   | 136,502,000   |               |
| セブン&アイ・HLDGS    | 262,000 | 3,579.00 | 937,698,000   |               |
| 帝 人             | 52,400  | 1,710.00 | 89,604,000    |               |
| 東 レ             | 262,000 | 498.60   | 130,633,200   |               |
| ク ラ レ           | 262,000 | 1,158.00 | 303,396,000   |               |
| 旭 化 成           | 262,000 | 853.20   | 223,538,400   |               |

|              |           |           |               |                |
|--------------|-----------|-----------|---------------|----------------|
| SUMCO        | 26,200    | 1,517.00  | 39,745,400    |                |
| 王子ホールディングス   | 262,000   | 500.00    | 131,000,000   |                |
| 日本製紙         | 26,200    | 1,547.00  | 40,531,400    | 貸付株式数 10,800株  |
| 昭和電工         | 26,200    | 2,553.00  | 66,888,600    |                |
| 住友化学         | 262,000   | 325.00    | 85,150,000    |                |
| 日産化学         | 262,000   | 5,190.00  | 1,359,780,000 | 貸付株式数 108,000株 |
| 東ソー          | 131,000   | 1,465.00  | 191,915,000   |                |
| トクヤマ         | 52,400    | 2,378.00  | 124,607,200   |                |
| デンカ          | 52,400    | 2,581.00  | 135,244,400   | 貸付株式数 18,800株  |
| 信越化学         | 262,000   | 11,850.00 | 3,104,700,000 |                |
| 協和キリン        | 262,000   | 2,725.00  | 713,950,000   |                |
| 三井化学         | 52,400    | 2,287.00  | 119,838,800   |                |
| 三菱ケミカルHLDGS  | 131,000   | 633.10    | 82,936,100    |                |
| 宇部興産         | 26,200    | 1,843.00  | 48,286,600    |                |
| 日本化薬         | 262,000   | 1,069.00  | 280,078,000   | 貸付株式数 40,000株  |
| 電通グループ       | 262,000   | 2,674.00  | 700,588,000   |                |
| 花王           | 262,000   | 8,643.00  | 2,264,466,000 |                |
| 武田薬品         | 262,000   | 3,922.00  | 1,027,564,000 |                |
| アステラス製薬      | 1,310,000 | 1,741.50  | 2,281,365,000 |                |
| 大日本住友製薬      | 262,000   | 1,416.00  | 370,992,000   | 貸付株式数 63,800株  |
| 塩野義製薬        | 262,000   | 6,535.00  | 1,712,170,000 | 貸付株式数 96,000株  |
| 中外製薬         | 262,000   | 16,000.00 | 4,192,000,000 |                |
| エーザイ         | 262,000   | 8,161.00  | 2,138,182,000 |                |
| テルモ          | 1,048,000 | 3,941.00  | 4,130,168,000 |                |
| 第一三共         | 262,000   | 8,622.00  | 2,258,964,000 |                |
| 大塚ホールディングス   | 262,000   | 4,712.00  | 1,234,544,000 |                |
| DIC          | 26,200    | 2,639.00  | 69,141,800    |                |
| Zホールディングス    | 104,800   | 440.00    | 46,112,000    |                |
| トレンドマイクロ     | 262,000   | 5,960.00  | 1,561,520,000 | 貸付株式数 96,000株  |
| サイバーエージェント   | 52,400    | 4,990.00  | 261,476,000   | 貸付株式数 19,200株  |
| 楽天           | 262,000   | 923.00    | 241,826,000   | 貸付株式数 96,000株  |
| 富士フイルムHLDGS  | 262,000   | 4,766.00  | 1,248,692,000 |                |
| コニカミノルタ      | 262,000   | 396.00    | 103,752,000   |                |
| 資生堂          | 262,000   | 6,833.00  | 1,790,246,000 |                |
| 出光興産         | 104,800   | 2,370.00  | 248,376,000   |                |
| JXTGホールディングス | 262,000   | 393.40    | 103,070,800   |                |
| 横浜ゴム         | 131,000   | 1,521.00  | 199,251,000   |                |
| ブリヂストン       | 262,000   | 3,468.00  | 908,616,000   |                |
| AGC          | 52,400    | 3,160.00  | 165,584,000   |                |
| 日本板硝子        | 26,200    | 407.00    | 10,663,400    | 貸付株式数 10,800株  |

|               |         |           |               |                              |
|---------------|---------|-----------|---------------|------------------------------|
| 日本電気硝子        | 78,600  | 1,732.00  | 136,135,200   |                              |
| 住友大阪セメント      | 26,200  | 3,630.00  | 95,106,000    |                              |
| 太平洋セメント       | 26,200  | 2,380.00  | 62,356,000    |                              |
| 東海カーボン        | 262,000 | 1,037.00  | 271,694,000   |                              |
| TOTO          | 131,000 | 4,170.00  | 546,270,000   |                              |
| 日本碍子          | 262,000 | 1,509.00  | 395,358,000   |                              |
| 日本製鉄          | 26,200  | 1,009.00  | 26,435,800    | 貸付株式数 10,800株                |
| 神戸製鋼所         | 26,200  | 400.00    | 10,480,000    | 貸付株式数 10,800株                |
| JFEホールディングス   | 26,200  | 795.00    | 20,829,000    | 貸付株式数 10,800株                |
| 大太平洋金属        | 26,200  | 1,671.00  | 43,780,200    | 貸付株式数 10,800株                |
| 日本製鋼所         | 52,400  | 1,487.00  | 77,918,800    |                              |
| 日本軽金属HD       | 262,000 | 176.00    | 46,112,000    |                              |
| 三井金属          | 26,200  | 2,205.00  | 57,771,000    |                              |
| 東邦亜鉛          | 26,200  | 1,490.00  | 39,038,000    | 貸付株式数 1,800株                 |
| 三菱マテリアル       | 26,200  | 2,258.00  | 59,159,600    |                              |
| 住友鉱山          | 131,000 | 2,900.00  | 379,900,000   |                              |
| DOWAホールディングス  | 52,400  | 3,290.00  | 172,396,000   | 貸付株式数 19,200株                |
| 古河電工          | 26,200  | 2,562.00  | 67,124,400    |                              |
| 住友電工          | 262,000 | 1,274.00  | 333,788,000   |                              |
| フジクラ          | 262,000 | 315.00    | 82,530,000    |                              |
| 東洋製罐グループHD    | 262,000 | 1,264.00  | 331,168,000   | 貸付株式数 30,000株                |
| リクルートホールディングス | 786,000 | 3,538.00  | 2,780,868,000 |                              |
| オークマ          | 52,400  | 4,540.00  | 237,896,000   | 貸付株式数 19,200株                |
| アマダ           | 262,000 | 882.00    | 231,084,000   |                              |
| 日本郵政          | 262,000 | 776.00    | 203,312,000   |                              |
| 小松製作所         | 262,000 | 2,100.00  | 550,200,000   |                              |
| 住友重機械         | 52,400  | 2,385.00  | 124,974,000   |                              |
| 日立建機          | 262,000 | 2,820.00  | 738,840,000   | 貸付株式数 20,000株                |
| クボタ           | 262,000 | 1,558.50  | 408,327,000   | 貸付株式数 108,000株<br>(108,000株) |
| 荏原製作所         | 52,400  | 2,433.00  | 127,489,200   |                              |
| ダイキン工業        | 262,000 | 15,915.00 | 4,169,730,000 |                              |
| 日本精工          | 262,000 | 792.00    | 207,504,000   |                              |
| N T N         | 262,000 | 224.00    | 58,688,000    |                              |
| ジェイテクト        | 262,000 | 849.00    | 222,438,000   | 貸付株式数 108,000株               |
| ミネベアミツミ       | 262,000 | 1,920.00  | 503,040,000   |                              |
| 日立            | 52,400  | 3,425.00  | 179,470,000   |                              |
| 三菱電機          | 262,000 | 1,389.00  | 363,918,000   |                              |
| 富士電機          | 52,400  | 2,717.00  | 142,370,800   | 貸付株式数 21,600株                |

|                     |           |           |               |       |                      |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|-------|----------------------|
| 安川電機                | 262,000   | 3,575.00  | 936,650,000   | 貸付株式数 | 96,000株              |
| オムロン                | 262,000   | 6,920.00  | 1,813,040,000 |       |                      |
| ジーエス・ユアサ コーポ        | 52,400    | 1,731.00  | 90,704,400    |       |                      |
| 日本電気                | 26,200    | 4,835.00  | 126,677,000   |       |                      |
| 富士通                 | 26,200    | 11,615.00 | 304,313,000   |       |                      |
| 沖電気                 | 26,200    | 1,022.00  | 26,776,400    |       |                      |
| セイコーエプソン            | 524,000   | 1,281.00  | 671,244,000   | 貸付株式数 | 192,000株             |
| パナソニック              | 262,000   | 928.20    | 243,188,400   |       |                      |
| ソニー                 | 262,000   | 7,317.00  | 1,917,054,000 | 貸付株式数 | 96,000株<br>(96,000株) |
| T D K               | 262,000   | 10,270.00 | 2,690,740,000 |       |                      |
| アルプスアルパイン           | 262,000   | 1,381.00  | 361,822,000   |       |                      |
| 横河電機                | 262,000   | 1,562.00  | 409,244,000   |       |                      |
| アドバンテスト             | 524,000   | 5,480.00  | 2,871,520,000 | 貸付株式数 | 192,000株             |
| デンソー                | 262,000   | 3,903.00  | 1,022,586,000 |       |                      |
| カシオ                 | 262,000   | 1,801.00  | 471,862,000   | 貸付株式数 | 10,000株              |
| ファナック               | 262,000   | 18,855.00 | 4,940,010,000 |       |                      |
| 京セラ                 | 524,000   | 5,722.00  | 2,998,328,000 |       |                      |
| 太陽誘電                | 262,000   | 3,135.00  | 821,370,000   | 貸付株式数 | 96,000株              |
| 日東電工                | 262,000   | 5,840.00  | 1,530,080,000 | 貸付株式数 | 30,000株              |
| 三井E & S H D         | 26,200    | 509.00    | 13,335,800    |       |                      |
| 日立造船                | 52,400    | 390.00    | 20,436,000    |       |                      |
| 三菱重工業               | 26,200    | 2,691.50  | 70,517,300    |       |                      |
| 川崎重工業               | 26,200    | 1,660.00  | 43,492,000    |       |                      |
| I H I               | 26,200    | 1,535.00  | 40,217,000    | 貸付株式数 | 10,800株              |
| コンコルディア・フィナン<br>シャル | 262,000   | 345.00    | 90,390,000    |       |                      |
| 日産自動車               | 262,000   | 408.30    | 106,974,600   | 貸付株式数 | 96,000株              |
| いすゞ自動車              | 131,000   | 955.00    | 125,105,000   |       |                      |
| トヨタ自動車              | 262,000   | 6,700.00  | 1,755,400,000 |       |                      |
| 日野自動車               | 262,000   | 712.00    | 186,544,000   |       |                      |
| 三菱自動車工業             | 26,200    | 296.00    | 7,755,200     | 貸付株式数 | 10,800株              |
| マツダ                 | 52,400    | 710.00    | 37,204,000    | 貸付株式数 | 21,600株              |
| 本田技研                | 524,000   | 2,741.00  | 1,436,284,000 | 貸付株式数 | 192,000株             |
| スズキ                 | 262,000   | 3,581.00  | 938,222,000   | 貸付株式数 | 96,000株<br>(96,000株) |
| S U B A R U         | 262,000   | 2,322.00  | 608,364,000   |       |                      |
| ヤマハ発動機              | 262,000   | 1,569.00  | 411,078,000   |       |                      |
| ニコン                 | 262,000   | 923.00    | 241,826,000   | 貸付株式数 | 108,000株             |
| オリンパス               | 1,048,000 | 1,774.50  | 1,859,676,000 |       |                      |

|                |           |           |               |       |          |
|----------------|-----------|-----------|---------------|-------|----------|
| SCREENホールディングス | 52,400    | 4,780.00  | 250,472,000   |       |          |
| キヤノン           | 393,000   | 2,190.00  | 860,670,000   | 貸付株式数 | 144,000株 |
| リコー            | 262,000   | 827.00    | 216,674,000   | 貸付株式数 | 108,000株 |
| シチズン時計         | 262,000   | 363.00    | 95,106,000    | 貸付株式数 | 108,000株 |
| バンダイナムコHLDGS   | 262,000   | 5,941.00  | 1,556,542,000 |       |          |
| 凸版印刷           | 131,000   | 1,789.00  | 234,359,000   |       |          |
| 大日本印刷          | 131,000   | 2,426.00  | 317,806,000   |       |          |
| ヤマハ            | 262,000   | 5,270.00  | 1,380,740,000 | 貸付株式数 | 96,000株  |
| 伊藤忠            | 262,000   | 2,270.00  | 594,740,000   |       |          |
| 丸紅             | 262,000   | 500.60    | 131,157,200   |       |          |
| 豊田通商           | 262,000   | 2,699.00  | 707,138,000   |       |          |
| ファミリーマート       | 1,048,000 | 1,837.00  | 1,925,176,000 | 貸付株式数 | 384,000株 |
| 三井物産           | 262,000   | 1,635.00  | 428,370,000   |       |          |
| 東京エレクトロン       | 262,000   | 21,880.00 | 5,732,560,000 |       |          |
| 住友商事           | 262,000   | 1,238.00  | 324,356,000   |       |          |
| 三菱商事           | 262,000   | 2,341.50  | 613,473,000   |       |          |
| 高島屋            | 131,000   | 946.00    | 123,926,000   | 貸付株式数 | 54,000株  |
| 丸井グループ         | 262,000   | 1,976.00  | 517,712,000   |       |          |
| クレディセゾン        | 262,000   | 1,295.00  | 339,290,000   | 貸付株式数 | 96,000株  |
| イオン            | 262,000   | 2,376.00  | 622,512,000   | 貸付株式数 | 96,000株  |
| 新生銀行           | 26,200    | 1,366.00  | 35,789,200    |       |          |
| あおぞら銀行         | 26,200    | 1,940.00  | 50,828,000    | 貸付株式数 | 9,600株   |
| 三菱UFJフィナンシャルG  | 262,000   | 429.10    | 112,424,200   |       |          |
| りそなホールディングス    | 26,200    | 373.90    | 9,796,180     |       |          |
| 三井住友トラストHD     | 26,200    | 3,005.00  | 78,731,000    |       |          |
| 三井住友フィナンシャルG   | 26,200    | 3,105.00  | 81,351,000    |       |          |
| 千葉銀行           | 262,000   | 503.00    | 131,786,000   |       |          |
| ふくおかフィナンシャルG   | 52,400    | 1,693.00  | 88,713,200    | 貸付株式数 | 19,200株  |
| 静岡銀行           | 262,000   | 694.00    | 181,828,000   |       |          |
| みずほフィナンシャルG    | 262,000   | 133.70    | 35,029,400    |       |          |
| 大和証券G本社        | 262,000   | 447.60    | 117,271,200   |       |          |
| 野村ホールディングス     | 262,000   | 463.40    | 121,410,800   |       |          |
| 松井証券           | 262,000   | 821.00    | 215,102,000   |       |          |
| SOMPOホールディングス  | 65,500    | 3,601.00  | 235,865,500   |       |          |
| MS&AD          | 78,600    | 3,117.00  | 244,996,200   |       |          |
| SONY FH        | 52,400    | 2,592.00  | 135,820,800   |       |          |
| 第一生命HLDGS      | 26,200    | 1,342.00  | 35,160,400    |       |          |

|                 |           |           |                 |                |
|-----------------|-----------|-----------|-----------------|----------------|
| 東京海上HD          | 131,000   | 4,726.00  | 619,106,000     |                |
| T & Dホールディングス   | 52,400    | 949.00    | 49,727,600      |                |
| 三井不動産           | 262,000   | 2,044.50  | 535,659,000     | 貸付株式数 108,000株 |
| 三菱地所            | 262,000   | 1,648.00  | 431,776,000     |                |
| 東京建物            | 131,000   | 1,263.00  | 165,453,000     |                |
| 住友不動産           | 262,000   | 2,849.50  | 746,569,000     |                |
| 東武鉄道            | 52,400    | 3,695.00  | 193,618,000     |                |
| 東急              | 131,000   | 1,581.00  | 207,111,000     |                |
| 小田急電鉄           | 131,000   | 2,626.00  | 344,006,000     |                |
| 京王電鉄            | 52,400    | 6,140.00  | 321,736,000     | 貸付株式数 19,200株  |
| 京成電鉄            | 131,000   | 3,390.00  | 444,090,000     |                |
| 東日本旅客鉄道         | 26,200    | 8,153.00  | 213,608,600     |                |
| 西日本旅客鉄道         | 26,200    | 6,391.00  | 167,444,200     |                |
| 東海旅客鉄道          | 26,200    | 17,705.00 | 463,871,000     |                |
| 日本通運            | 26,200    | 5,680.00  | 148,816,000     |                |
| ヤマトホールディングス     | 262,000   | 2,394.00  | 627,228,000     |                |
| 日本郵船            | 26,200    | 1,472.00  | 38,566,400      |                |
| 商船三井            | 26,200    | 1,836.00  | 48,103,200      |                |
| 川崎汽船            | 26,200    | 980.00    | 25,676,000      | 貸付株式数 10,800株  |
| ANAホールディングス     | 26,200    | 2,565.50  | 67,216,100      |                |
| 三菱倉庫            | 131,000   | 2,701.00  | 353,831,000     | 貸付株式数 48,000株  |
| スカパーJ S A T H D | 26,200    | 430.00    | 11,266,000      |                |
| 日本電信電話          | 104,800   | 2,474.00  | 259,275,200     |                |
| K D D I         | 1,572,000 | 3,141.00  | 4,937,652,000   |                |
| N T T ドコモ       | 26,200    | 2,895.00  | 75,849,000      |                |
| 東京電力HD          | 26,200    | 344.00    | 9,012,800       |                |
| 中部電力            | 26,200    | 1,412.50  | 37,007,500      |                |
| 関西電力            | 26,200    | 1,070.00  | 28,034,000      |                |
| 東京瓦斯            | 52,400    | 2,469.50  | 129,401,800     |                |
| 大阪瓦斯            | 52,400    | 2,078.00  | 108,887,200     |                |
| 東 宝             | 26,200    | 3,890.00  | 101,918,000     |                |
| N T T データ       | 1,310,000 | 1,185.00  | 1,552,350,000   |                |
| セコム             | 262,000   | 9,326.00  | 2,443,412,000   |                |
| コナミホールディングス     | 262,000   | 3,530.00  | 924,860,000     | 貸付株式数 80,000株  |
| ファーストリテイリング     | 262,000   | 60,800.00 | 15,929,600,000  | 貸付株式数 13,000株  |
| ソフトバンクグループ      | 1,572,000 | 4,905.00  | 7,710,660,000   | 貸付株式数 491,000株 |
| 合計              |           |           | 156,597,158,960 |                |

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

|             |         |       |         |
|-------------|---------|-------|---------|
| 武田薬品        | 50,000株 | ファナック | 30,000株 |
| ファーストリテイリング | 25,000株 |       |         |

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 155,405,158         | 123,915,431         |
| 親投資信託受益証券       | 36,061,336,569      | 42,363,814,153      |
| 未収入金            | 22,100,000          | 9,900,000           |
| 流動資産合計          | 36,238,841,727      | 42,497,629,584      |
| <b>資産合計</b>     |                     |                     |
| 36,238,841,727  |                     |                     |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 97,961,037          | 37,843,820          |
| 未払受託者報酬         | 3,678,676           | 4,424,773           |
| 未払委託者報酬         | 70,815,327          | 85,177,800          |
| その他未払費用         | 929,204             | 1,094,870           |
| 流動負債合計          | 173,384,244         | 128,541,263         |
| <b>負債合計</b>     |                     |                     |
| 173,384,244     |                     |                     |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 28,513,883,705    | 1 33,035,419,266    |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 7,551,573,778       | 9,333,669,055       |
| （分配準備積立金）       | 3,262,261,400       | 2,831,808,530       |
| 元本等合計           | 36,065,457,483      | 42,369,088,321      |
| <b>純資産合計</b>    |                     |                     |
| 36,065,457,483  |                     |                     |
| <b>負債純資産合計</b>  |                     |                     |
| 36,238,841,727  |                     |                     |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |                      | 第4期                          |                      |
|---|------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |                      | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |                      |
| <b>営業収益</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 受取利息                                      |                              | 11                   |                              | 227                  |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 859,924,701          |                              | 708,747,584          |
| <b>営業収益合計</b>                             |                              | <b>859,924,712</b>   |                              | <b>708,747,811</b>   |
| <b>営業費用</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 支払利息                                      |                              | 66,496               |                              | 46,339               |
| 受託者報酬                                     |                              | 7,302,906            |                              | 8,579,670            |
| 委託者報酬                                     |                              | 140,582,536          |                              | 165,160,235          |
| その他費用                                     |                              | 1,832,049            |                              | 2,144,595            |
| <b>営業費用合計</b>                             |                              | <b>149,783,987</b>   |                              | <b>175,930,839</b>   |
| <b>営業利益</b>                               |                              | <b>710,140,725</b>   |                              | <b>532,816,972</b>   |
| 経常利益                                      |                              | 710,140,725          |                              | 532,816,972          |
| <b>当期純利益</b>                              |                              | <b>710,140,725</b>   |                              | <b>532,816,972</b>   |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |                              | 128,066,493          |                              | 187,107,264          |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |                              | 6,159,301,109        |                              | 7,551,573,778        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |                              | 2,235,370,830        |                              | 3,666,211,698        |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 2,235,370,830        |                              | 3,666,211,698        |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                              | 1,681,305,379        |                              | 2,229,826,129        |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | 1,681,305,379        |                              | 2,229,826,129        |
| 分配金                                       |                              | 1 -                  |                              | 1 -                  |
| <b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>                    |                              | <b>7,551,573,778</b> |                              | <b>9,333,669,055</b> |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期             | 第4期             |
|---------------------|-----------------|-----------------|
|                     | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
| 1. 1 期首元本額          | 25,661,230,421円 | 28,513,883,705円 |
| 期中追加設定元本額           | 9,938,067,643円  | 12,720,408,945円 |
| 期中一部解約元本額           | 7,085,414,359円  | 8,198,873,384円  |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 28,513,883,705口 | 33,035,419,266口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(838,238,043円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,289,371,259円)及び分配準備積立金(2,424,023,357円)より分配対象額は7,551,632,659円(1万口当たり2,648.41円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(345,705,686円)、投資信託約款に規定される収益調整金(6,501,901,376円)及び分配準備積立金(2,486,102,844円)より分配対象額は9,333,709,906円(1万口当たり2,825.36円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|-------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 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<br>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4期<br>2020年6月15日現在   |
|------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期<br>2019年6月17日現在      | 第4期<br>2020年6月15日現在      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 918,547,228              | 656,115,926              |
| 合計        | 918,547,228              | 656,115,926              |

## (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3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|---------------------|---------------------|
| 該当事項はありません。         | 該当事項はありません。         |

## (関連当事者との取引に関する注記)

|                                     |
|-------------------------------------|
| 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15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3期<br>2019年6月17日現在  | 第4期<br>2020年6月15日現在  |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.2648円<br>(12,648円) | 1.2825円<br>(12,825円) |

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                     | 券面総額           | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|--------------|-------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド | 21,439,177,203 | 42,363,814,153 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                         |                | 42,363,814,153 |    |
| 合計           |                         |                | 42,363,814,153 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 2019年6月17日現在     | 2020年6月15日現在   |
|-----------------|------------------|----------------|
|                 | 金額（円）            | 金額（円）          |
| 資産の部            |                  |                |
| 流動資産            |                  |                |
| 預金              | 240,579,815      | 55,312,019     |
| コール・ローン         | 1,793,690,309    | 762,067,925    |
| 株式              | 38,411,435,543   | 51,952,815,871 |
| 投資証券            | 1,158,437,168    | 1,477,281,376  |
| 派生商品評価勘定        | 77,540,850       | 249,970,415    |
| 未収入金            | 1,291,588        | 835,734        |
| 未収配当金           | 69,406,559       | 69,722,194     |
| 差入委託証拠金         | 486,011,851      | 201,733,778    |
| 流動資産合計          | 42,238,393,683   | 54,769,739,312 |
| 資産合計            | 42,238,393,683   | 54,769,739,312 |
| 負債の部            |                  |                |
| 流動負債            |                  |                |
| 派生商品評価勘定        | 163,149,270      | 99,323,100     |
| 未払金             | 74,328,925       | 1,459,901      |
| 未払解約金           | 49,780,000       | 10,750,000     |
| その他未払費用         | -                | 1,137          |
| 流動負債合計          | 287,258,195      | 111,534,138    |
| 負債合計            | 287,258,195      | 111,534,138    |
| 純資産の部           |                  |                |
| 元本等             |                  |                |
| 元本              | 1 21,623,237,931 | 27,661,024,245 |
| 剰余金             |                  |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 20,327,897,557   | 26,997,180,929 |
| 元本等合計           | 41,951,135,488   | 54,658,205,174 |
| 純資産合計           | 41,951,135,488   | 54,658,205,174 |
| 負債純資産合計         | 42,238,393,683   | 54,769,739,312 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                    | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>  |
| 3. 収益及び費用の計上基準         | 受取配当金   |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                                 | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
|-------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                             | 2018年6月16日      | 2019年6月18日      |
| 期首元本額                               | 19,059,528,948円 | 21,623,237,931円 |
| 期中追加設定元本額                           | 5,457,024,519円  | 13,228,872,441円 |
| 期中一部解約元本額                           | 2,893,315,536円  | 7,191,086,127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                       | 18,587,359,708円 | 21,439,177,203円 |
| 株式インデックス(為替ヘッジあり)                   |                 |                 |
| ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) | 1,137,083,572円  | 1,477,569,279円  |
| iFree 外国株式イン                        | 315,080,260円    | 660,563,226円    |
| デックス(為替ヘッジあり)                       |                 |                 |
| ダイワ・ワールド・バランス                       | 10,016,873円     | - 円             |
| ファンド75VA                            |                 |                 |
| ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)    | 1,573,697,518円  | 4,083,714,537円  |
| 計                                   | 21,623,237,931円 | 27,661,024,245円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                    | 21,623,237,931口 | 27,661,024,245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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15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<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> |

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種 類  | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 3,547,525,858          | 3,480,038,509          |
| 投資証券 | 161,117,811            | 151,745,151            |
| 合計   | 3,708,643,669          | 3,631,783,660          |

（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1月11日から2019年6月17日まで、及び2020年1月11日から2020年6月15日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

| 種 類          | 2019年6月17日 現在 |           |               |             | 2020年6月15日 現在 |           |               |             |
|--------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|              | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|              | (円)           | うち<br>1年超 |               |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引         |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 株価指数<br>先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買 建          | 2,462,016,448 | -         | 2,529,638,838 | 67,622,390  | 1,001,417,056 | -         | 1,065,633,872 | 64,216,816  |
| 合計           | 2,462,016,448 | -         | 2,529,638,838 | 67,622,390  | 1,001,417,056 | -         | 1,065,633,872 | 64,216,816  |

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

| 種 類             | 2019年6月17日 現在  |           |                |             | 2020年6月15日 現在  |           |                |             |
|-----------------|----------------|-----------|----------------|-------------|----------------|-----------|----------------|-------------|
|                 | 契約額等           |           | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) | 契約額等           |           | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) |
|                 | (円)            | うち<br>1年超 |                |             | (円)            | うち<br>1年超 |                |             |
| 市場取引以外<br>の取引   |                |           |                |             |                |           |                |             |
| 為替予約取引          |                |           |                |             |                |           |                |             |
| 売 建             | 38,413,104,193 | -         | 38,566,335,003 | 153,230,810 | 53,762,204,536 | -         | 53,675,774,037 | 86,430,499  |
| アメリカ・ドル         | 26,146,330,414 | -         | 26,254,580,450 | 108,250,036 | 38,386,244,034 | -         | 38,210,169,366 | 176,074,668 |
| イギリス・ポンド        | 2,425,285,401  | -         | 2,421,696,731  | 3,588,670   | 2,680,408,529  | -         | 2,696,388,992  | 15,980,463  |
| イスラエル・<br>シケル   | 45,546,318     | -         | 46,010,860     | 464,542     | 60,529,579     | -         | 60,822,648     | 293,069     |
| オーストラリア・<br>ドル  | 1,032,789,165  | -         | 1,026,589,932  | 6,199,233   | 1,188,494,961  | -         | 1,204,413,786  | 15,918,825  |
| カナダ・ドル          | 1,430,885,296  | -         | 1,446,209,613  | 15,324,317  | 1,850,809,809  | -         | 1,855,581,507  | 4,771,698   |
| シンガポール・<br>ドル   | 188,155,555    | -         | 189,200,160    | 1,044,605   | 206,327,963    | -         | 207,510,147    | 1,182,184   |
| スイス・フラン         | 1,311,901,005  | -         | 1,315,477,801  | 3,576,796   | 1,880,163,140  | -         | 1,888,847,515  | 8,684,375   |
| スウェーデン・<br>クローナ | 393,029,169    | -         | 394,147,930    | 1,118,761   | 568,963,476    | -         | 569,598,568    | 635,092     |
| デンマーク・<br>クローネ  | 254,942,021    | -         | 256,481,856    | 1,539,835   | 447,553,459    | -         | 450,545,034    | 2,991,575   |
| ニュージー<br>ランド・ドル | 35,515,898     | -         | 35,396,972     | 118,926     | 59,327,456     | -         | 60,797,519     | 1,470,063   |
| ノルウェー・<br>クローネ  | 104,338,301    | -         | 105,152,028    | 813,727     | 108,169,760    | -         | 107,821,728    | 348,032     |
| ユーロ             | 4,481,391,277  | -         | 4,509,864,700  | 28,473,423  | 5,759,200,721  | -         | 5,799,410,148  | 40,209,427  |
| 香港・ドル           | 562,994,373    | -         | 565,525,970    | 2,531,597   | 566,011,649    | -         | 563,867,079    | 2,144,570   |
| 合計              | 38,413,104,193 | -         | 38,566,335,003 | 153,230,810 | 53,762,204,536 | -         | 53,675,774,037 | 86,430,499  |

(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6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.9401円<br>(19,401円) | 1.9760円<br>(19,760円) |

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

| 通貨      | 銘柄                            | 株式数    | 評価額     |               | 備考 |
|---------|-------------------------------|--------|---------|---------------|----|
|         |                               |        | 単価      | 金額            |    |
| アメリカ・ドル | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION | 1,772  | 121.630 | 215,528.360   |    |
|         | PALO ALTO NETWORKS INC        | 1,558  | 221.850 | 345,642.300   |    |
|         | KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN      | 2,271  | 95.670  | 217,266.570   |    |
|         | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS  | 1,594  | 76.970  | 122,690.180   |    |
|         | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      | 1,176  | 104.680 | 123,103.680   |    |
|         | SYNCHRONY FINANCIAL           | 6,200  | 23.770  | 147,374.000   |    |
|         | ABBOTT LABORATORIES           | 23,399 | 89.020  | 2,082,978.980 |    |
|         | HOWMET AEROSPACE INC          | 3,950  | 14.000  | 55,300.000    |    |
|         | VERISK ANALYTICS INC          | 2,296  | 162.670 | 373,490.320   |    |
|         | LAS VEGAS SANDS CORP          | 4,729  | 49.870  | 235,835.230   |    |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| AMPHENOL CORP-CL A              | 4,167  | 95.010    | 395,906.670   |  |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV     | 8,210  | 137.080   | 1,125,426.800 |  |
| QORVO INC                       | 1,179  | 108.900   | 128,393.100   |  |
| AFLAC INC                       | 10,230 | 36.640    | 374,827.200   |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC          | 1,248  | 75.940    | 94,773.120    |  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT<br>IN | 1,835  | 49.120    | 90,135.200    |  |
| ADOBE INC                       | 6,341  | 406.540   | 2,577,870.140 |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC      | 2,872  | 29.400    | 84,436.800    |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC         | 1,607  | 296.360   | 476,250.520   |  |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL       | 4,409  | 12.200    | 53,789.800    |  |
| GARMIN LTD                      | 2,167  | 91.670    | 198,648.890   |  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS<br>INC | 2,819  | 235.040   | 662,577.760   |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC     | 9,435  | 144.510   | 1,363,451.850 |  |
| WR BERKLEY CORP                 | 1,771  | 57.020    | 100,982.420   |  |
| AUTOZONE INC                    | 291    | 1,100.510 | 320,248.410   |  |
| DOLLAR TREE INC                 | 3,398  | 87.770    | 298,242.460   |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR      | 12,365 | 11.250    | 139,106.250   |  |
| PINNACLE WEST CAPITAL           | 1,508  | 75.600    | 114,004.800   |  |
| CELANESE CORP                   | 1,297  | 88.520    | 114,810.440   |  |
| DR HORTON INC                   | 4,397  | 54.000    | 237,438.000   |  |
| DENTSPLY SIRONA INC             | 2,450  | 43.380    | 106,281.000   |  |
| AUTODESK INC                    | 2,966  | 222.960   | 661,299.360   |  |
| MOODY'S CORP                    | 2,143  | 266.980   | 572,138.140   |  |
| ALBEMARLE CORP                  | 1,668  | 77.320    | 128,969.760   |  |
| ATMOS ENERGY CORP               | 1,654  | 100.430   | 166,111.220   |  |
| ALLIANT ENERGY CORP             | 3,614  | 48.550    | 175,459.700   |  |
| CITIGROUP INC                   | 27,573 | 52.250    | 1,440,689.250 |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING       | 5,836  | 147.010   | 857,950.360   |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER         | 6,727  | 81.800    | 550,268.600   |  |
| ALLEGHANY CORP                  | 303    | 504.280   | 152,796.840   |  |
| DOMINO'S PIZZA INC              | 526    | 378.150   | 198,906.900   |  |
| HESS CORP                       | 2,896  | 49.610    | 143,670.560   |  |
| DAVITA INC                      | 1,000  | 78.250    | 78,250.000    |  |
| DANAHER CORP                    | 8,130  | 168.380   | 1,368,929.400 |  |
| FORTIVE CORP                    | 4,335  | 63.650    | 275,922.750   |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE<br>IN | 7,719  | 93.260    | 719,873.940   |  |

|                                 |        |         |                |  |
|---------------------------------|--------|---------|----------------|--|
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO       | 7,945  | 39.430  | 313,271.350    |  |
| BUNGE LTD                       | 1,838  | 39.390  | 72,398.820     |  |
| TE CONNECTIVITY LTD             | 4,876  | 78.590  | 383,204.840    |  |
| APPLE INC                       | 57,864 | 338.800 | 19,604,323.200 |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES     | 3,359  | 52.990  | 177,993.410    |  |
| BOEING CO/THE                   | 7,142  | 189.510 | 1,353,480.420  |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP       | 2,063  | 61.030  | 125,904.890    |  |
| BECTON DICKINSON AND CO         | 3,629  | 230.880 | 837,863.520    |  |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR      | 2,000  | 17.800  | 35,600.000     |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC             | 1,400  | 98.910  | 138,474.000    |  |
| CDK GLOBAL INC                  | 1,100  | 41.470  | 45,617.000     |  |
| NISOURCE INC                    | 4,026  | 23.260  | 93,644.760     |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC     | 1,708  | 77.730  | 132,762.840    |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>CORP | 11,544 | 38.440  | 443,751.360    |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC      | 54,342 | 56.530  | 3,071,953.260  |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B     | 18,048 | 181.210 | 3,270,478.080  |  |
| ANSYS INC                       | 989    | 270.270 | 267,297.030    |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP           | 18,611 | 39.470  | 734,576.170    |  |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A      | 9,437  | 55.730  | 525,924.010    |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO         | 29,706 | 56.170  | 1,668,586.020  |  |
| JPMORGAN CHASE & CO             | 40,457 | 99.870  | 4,040,440.590  |  |
| T ROWE PRICE GROUP INC          | 3,432  | 120.930 | 415,031.760    |  |
| LKQ CORP                        | 3,300  | 25.885  | 85,420.500     |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD      | 547    | 183.460 | 100,352.620    |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B       | 3,665  | 65.250  | 239,141.250    |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC          | 3,614  | 89.460  | 323,308.440    |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC        | 1,611  | 146.640 | 236,237.040    |  |
| DOLLAR GENERAL CORP             | 3,372  | 184.000 | 620,448.000    |  |
| SERVICENOW INC                  | 2,383  | 385.130 | 917,764.790    |  |
| CATERPILLAR INC                 | 7,336  | 123.150 | 903,428.400    |  |
| BROWN & BROWN INC               | 4,320  | 40.670  | 175,694.400    |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC         | 2,201  | 43.970  | 96,777.970     |  |
| CMS ENERGY CORP                 | 3,384  | 58.300  | 197,287.200    |  |
| MOSAIC CO/THE                   | 5,209  | 13.280  | 69,175.520     |  |
| DELTA AIR LINES INC             | 1,650  | 30.430  | 50,209.500     |  |
| CORNING INC                     | 11,757 | 26.930  | 316,616.010    |  |
| CISCO SYSTEMS INC               | 55,739 | 45.070  | 2,512,156.730  |  |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC       | 2,529  | 58.370  | 147,617.730    |  |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| MORGAN STANLEY                  | 16,103 | 46.280    | 745,246.840   |  |
| MSCI INC                        | 1,195  | 320.950   | 383,535.250   |  |
| FAIR ISAAC CORP                 | 398    | 413.520   | 164,580.960   |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC        | 450    | 218.990   | 98,545.500    |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS      | 3,845  | 56.650    | 217,819.250   |  |
| BROADCOM INC                    | 5,262  | 300.250   | 1,579,915.500 |  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC     | 1,416  | 125.390   | 177,552.240   |  |
| ARAMARK                         | 3,173  | 25.300    | 80,276.900    |  |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD      | 1,612  | 22.190    | 35,770.280    |  |
| DTE ENERGY COMPANY              | 2,739  | 105.070   | 287,786.730   |  |
| CENTENE CORP                    | 7,779  | 61.940    | 481,831.260   |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC         | 1,358  | 99.900    | 135,664.200   |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP        | 5,532  | 25.820    | 142,836.240   |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO         | 2,232  | 95.320    | 212,754.240   |  |
| GARTNER INC                     | 1,174  | 118.730   | 139,389.020   |  |
| SPLUNK INC                      | 2,029  | 178.880   | 362,947.520   |  |
| DOMINION ENERGY INC             | 10,995 | 83.150    | 914,234.250   |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP           | 5,555  | 68.300    | 379,406.500   |  |
| SMITH (A.O.) CORP               | 1,400  | 46.950    | 65,730.000    |  |
| DEERE & CO                      | 3,920  | 154.970   | 607,482.400   |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC             | 3,866  | 178.580   | 690,390.280   |  |
| VMWARE INC-CLASS A              | 1,343  | 135.850   | 182,446.550   |  |
| CABLE ONE INC                   | 60     | 1,725.680 | 103,540.800   |  |
| BURLINGTON STORES INC           | 1,081  | 203.530   | 220,015.930   |  |
| NASDAQ INC                      | 1,427  | 115.150   | 164,319.050   |  |
| VAIL RESORTS INC                | 818    | 184.200   | 150,675.600   |  |
| EAST WEST BANCORP INC           | 1,461  | 36.520    | 53,355.720    |  |
| REINSURANCE GROUP OF<br>AMERICA | 894    | 87.980    | 78,654.120    |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP<br>INC | 874    | 62.330    | 54,476.420    |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC         | 4,602  | 75.380    | 346,898.760   |  |
| COGNEX CORP                     | 2,439  | 55.160    | 134,535.240   |  |
| TELEFLEX INC                    | 785    | 352.250   | 276,516.250   |  |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC     | 1,453  | 114.100   | 165,787.300   |  |
| WEST PHARMACEUTICAL<br>SERVICES | 852    | 200.730   | 171,021.960   |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A          | 300    | 448.850   | 134,655.000   |  |
| CATALENT INC                    | 2,000  | 69.570    | 139,140.000   |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A       | 1,955  | 216.680 | 423,609.400   |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC           | 800    | 169.890 | 135,912.000   |  |
| IDEX CORP                       | 1,156  | 152.590 | 176,394.040   |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO            | 10,183 | 72.790  | 741,220.570   |  |
| ROLLINS INC                     | 2,836  | 41.410  | 117,438.760   |  |
| AMETEK INC                      | 2,597  | 87.660  | 227,653.020   |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC          | 2,883  | 73.080  | 210,689.640   |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION     | 2,902  | 38.970  | 113,090.940   |  |
| HEICO CORP                      | 535    | 109.490 | 58,577.150    |  |
| XPO LOGISTICS INC               | 1,060  | 74.840  | 79,330.400    |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS<br>INC | 646    | 286.980 | 185,389.080   |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A        | 3,422  | 66.610  | 227,939.420   |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC          | 509    | 342.710 | 174,439.390   |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP           | 5,863  | 298.700 | 1,751,278.100 |  |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC          | 1,128  | 103.650 | 116,917.200   |  |
| EPAM SYSTEMS INC                | 749    | 235.000 | 176,015.000   |  |
| RPM INTERNATIONAL INC           | 1,750  | 73.390  | 128,432.500   |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC      | 395    | 991.830 | 391,772.850   |  |
| UGI CORP                        | 2,085  | 31.030  | 64,697.550    |  |
| CUMMINS INC                     | 2,071  | 167.080 | 346,022.680   |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC         | 9,982  | 71.680  | 715,509.760   |  |
| CDW CORP/DE                     | 1,792  | 114.100 | 204,467.200   |  |
| SIGNATURE BANK                  | 769    | 107.880 | 82,959.720    |  |
| COSTAR GROUP INC                | 492    | 668.090 | 328,700.280   |  |
| SVB FINANCIAL GROUP             | 690    | 208.530 | 143,885.700   |  |
| AMERCO                          | 70     | 314.890 | 22,042.300    |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE       | 1,239  | 157.880 | 195,613.320   |  |
| MERCADOLIBRE INC                | 603    | 896.430 | 540,547.290   |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC     | 837    | 172.250 | 144,173.250   |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS<br>IN | 3,801  | 77.450  | 294,387.450   |  |
| IPG PHOTONICS CORP              | 250    | 156.140 | 39,035.000    |  |
| DEXCOM INC                      | 1,188  | 370.230 | 439,833.240   |  |
| NORDSON CORP                    | 750    | 185.680 | 139,260.000   |  |
| COPART INC                      | 2,495  | 85.040  | 212,174.800   |  |
| DIAMONDBACK ENERGY INC          | 1,591  | 46.960  | 74,713.360    |  |
| SEATTLE GENETICS INC            | 1,545  | 151.160 | 233,542.200   |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC            | 963    | 251.400 | 242,098.200   |  |

|                                 |        |           |                |  |
|---------------------------------|--------|-----------|----------------|--|
| TRANSDIGM GROUP INC             | 698    | 447.390   | 312,278.220    |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC      | 1,203  | 114.820   | 138,128.460    |  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC            | 4,347  | 15.120    | 65,726.640     |  |
| KINDER MORGAN INC               | 27,851 | 15.500    | 431,690.500    |  |
| HCA HEALTHCARE INC              | 3,740  | 100.550   | 376,057.000    |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC        | 544    | 492.790   | 268,077.760    |  |
| CABOT OIL & GAS CORP            | 4,608  | 20.070    | 92,482.560     |  |
| T-MOBILE US INC                 | 5,379  | 102.310   | 550,325.490    |  |
| ZILLOW GROUP INC - C            | 1,786  | 56.790    | 101,426.940    |  |
| COCA-COLA CO/THE                | 53,906 | 45.600    | 2,458,113.600  |  |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS     | 2,575  | 38.150    | 98,236.250     |  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC        | 1,946  | 73.570    | 143,167.220    |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC          | 3,851  | 21.790    | 83,913.290     |  |
| CSX CORP                        | 9,451  | 69.570    | 657,506.070    |  |
| LABORATORY CRP OF AMER<br>HLDGS | 1,519  | 167.730   | 254,781.870    |  |
| EXPEDIA GROUP INC               | 1,563  | 82.520    | 128,978.760    |  |
| AUTOLIV INC                     | 800    | 63.140    | 50,512.000     |  |
| AMAZON.COM INC                  | 5,594  | 2,545.020 | 14,236,841.880 |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP       | 8,109  | 67.980    | 551,249.820    |  |
| EXXON MOBIL CORP                | 56,834 | 47.170    | 2,680,859.780  |  |
| FLIR SYSTEMS INC                | 1,613  | 41.260    | 66,552.380     |  |
| AES CORP                        | 8,341  | 12.670    | 105,680.470    |  |
| EVEREST RE GROUP LTD            | 571    | 214.950   | 122,736.450    |  |
| EOG RESOURCES INC               | 7,655  | 52.570    | 402,423.350    |  |
| AKAMA I TECHNOLOGIES INC        | 1,914  | 100.340   | 192,050.760    |  |
| ABIOMED INC                     | 555    | 241.680   | 134,132.400    |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP          | 1,989  | 94.870    | 188,696.430    |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC        | 4,333  | 86.110    | 373,114.630    |  |
| FORD MOTOR CO                   | 56,740 | 6.460     | 366,540.400    |  |
| DISCOVERY INC - A               | 4,242  | 22.070    | 93,620.940     |  |
| EXACT SCIENCES CORP             | 1,721  | 85.370    | 146,921.770    |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A            | 2,416  | 22.335    | 53,961.360     |  |
| DISCOVERY INC-C                 | 4,554  | 19.700    | 89,713.800     |  |
| AERCAP HOLDINGS NV              | 1,824  | 34.250    | 62,472.000     |  |
| FORTINET INC                    | 1,595  | 130.340   | 207,892.300    |  |
| MARKEL CORP                     | 177    | 949.950   | 168,141.150    |  |
| NEXTERA ENERGY INC              | 6,448  | 246.910   | 1,592,075.680  |  |
| MASIMO CORP                     | 254    | 217.390   | 55,217.060     |  |

|                                  |         |           |               |  |
|----------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| FREEMPORT-MCMORAN INC            | 23,366  | 10.490    | 245,109.340   |  |
| INSULET CORP                     | 769     | 180.560   | 138,850.640   |  |
| US BANCORP                       | 18,005  | 37.510    | 675,367.550   |  |
| UNITED RENTALS INC               | 1,055   | 143.490   | 151,381.950   |  |
| F5 NETWORKS INC                  | 1,111   | 140.320   | 155,895.520   |  |
| FASTENAL CO                      | 7,924   | 40.060    | 317,435.440   |  |
| FISERV INC                       | 7,925   | 100.340   | 795,194.500   |  |
| GENERAL ELECTRIC CO              | 116,958 | 7.250     | 847,945.500   |  |
| GENERAL MOTORS CO                | 16,543  | 27.960    | 462,542.280   |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP            | 3,211   | 149.200   | 479,081.200   |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC          | 4,060   | 201.780   | 819,226.800   |  |
| ALPHABET INC-CL A                | 3,989   | 1,412.920 | 5,636,137.880 |  |
| ALPHABET INC-CL C                | 4,037   | 1,413.180 | 5,705,007.660 |  |
| OWENS CORNING                    | 1,763   | 52.720    | 92,945.360    |  |
| GENERAL MILLS INC                | 7,849   | 60.150    | 472,117.350   |  |
| FIRSTENERGY CORP                 | 7,612   | 40.430    | 307,753.160   |  |
| GENUINE PARTS CO                 | 1,770   | 85.590    | 151,494.300   |  |
| IHS MARKIT LTD                   | 5,247   | 69.810    | 366,293.070   |  |
| FIFTH THIRD BANCORP              | 8,100   | 20.805    | 168,520.500   |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC        | 2,779   | 193.150   | 536,763.850   |  |
| HALLIBURTON CO                   | 10,230  | 12.780    | 130,739.400   |  |
| HOME DEPOT INC                   | 14,403  | 242.450   | 3,492,007.350 |  |
| ASSURANT INC                     | 840     | 107.030   | 89,905.200    |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC        | 16,684  | 9.885     | 164,921.340   |  |
| HUNTINGTON INGALLS<br>INDUSTRIE  | 500     | 182.290   | 91,145.000    |  |
| HERSHEY CO/THE                   | 1,725   | 129.110   | 222,714.750   |  |
| HUMANA INC                       | 1,733   | 378.720   | 656,321.760   |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV            | 4,126   | 106.170   | 438,057.420   |  |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A          | 917     | 261.880   | 240,143.960   |  |
| HENRY SCHEIN INC                 | 1,870   | 56.630    | 105,898.100   |  |
| HP INC                           | 20,761  | 16.280    | 337,989.080   |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE       | 20,050  | 10.150    | 203,507.500   |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM<br>C  | 1,395   | 35.360    | 49,327.200    |  |
| HOLLYFRONTIER CORP               | 1,783   | 31.380    | 55,950.540    |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-<br>C | 2,762   | 36.290    | 100,232.980   |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM<br>A | 2,028  | 35.790  | 72,582.120    |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD          | 5,011  | 30.610  | 153,386.710   |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE              | 10,097 | 31.800  | 321,084.600   |  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP     | 11,610 | 121.910 | 1,415,375.100 |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO          | 4,047  | 34.920  | 141,321.240   |  |
| FORTUNE BRANDS HOME &<br>SECURI | 1,500  | 58.400  | 87,600.000    |  |
| ZOETIS INC                      | 6,478  | 134.070 | 868,505.460   |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC          | 3,274  | 90.390  | 295,936.860   |  |
| CHENIERE ENERGY INC             | 2,484  | 46.100  | 114,512.400   |  |
| ALLEGION PLC                    | 1,110  | 102.410 | 113,675.100   |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C           | 5,108  | 21.770  | 111,201.160   |  |
| WASTE CONNECTIONS INC           | 3,431  | 90.210  | 309,510.510   |  |
| JUNIPER NETWORKS INC            | 4,912  | 23.890  | 117,347.680   |  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC        | 864    | 158.850 | 137,246.400   |  |
| JM SMUCKER CO/THE               | 1,393  | 104.700 | 145,847.100   |  |
| JOHNSON & JOHNSON               | 34,816 | 142.150 | 4,949,094.400 |  |
| ABBVIE INC                      | 23,272 | 92.460  | 2,151,729.120 |  |
| HOLOGIC INC                     | 3,042  | 50.150  | 152,556.300   |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP             | 4,429  | 135.940 | 602,078.260   |  |
| KROGER CO                       | 11,659 | 32.260  | 376,119.340   |  |
| KLA CORP                        | 1,919  | 184.690 | 354,420.110   |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP            | 3,357  | 381.870 | 1,281,937.590 |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC       | 1,254  | 258.990 | 324,773.460   |  |
| LOWE'S COS INC                  | 10,213 | 126.050 | 1,287,348.650 |  |
| ELI LILLY & CO                  | 11,355 | 143.540 | 1,629,896.700 |  |
| LAM RESEARCH CORP               | 1,974  | 284.520 | 561,642.480   |  |
| JONES LANG LASALLE INC          | 587    | 109.170 | 64,082.790    |  |
| LOEWS CORP                      | 3,591  | 33.020  | 118,574.820   |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP           | 2,643  | 40.680  | 107,517.240   |  |
| MCDONALD'S CORP                 | 9,987  | 189.170 | 1,889,240.790 |  |
| 3M CO                           | 7,602  | 154.870 | 1,177,321.740 |  |
| FACEBOOK INC-CLASS A            | 31,769 | 228.580 | 7,261,758.020 |  |
| S&P GLOBAL INC                  | 3,265  | 316.910 | 1,034,711.150 |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS       | 767    | 197.050 | 151,137.350   |  |
| CONCHO RESOURCES INC            | 2,552  | 58.000  | 148,016.000   |  |
| PHILLIPS 66                     | 6,229  | 77.260  | 481,252.540   |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL       | 5,659  | 19.170  | 108,483.030   |  |

|                              |        |         |               |
|------------------------------|--------|---------|---------------|
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 1,819  | 166.540 | 302,936.260   |
| MYLAN NV                     | 9,206  | 15.940  | 146,743.640   |
| METLIFE INC                  | 10,740 | 37.450  | 402,213.000   |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 8,617  | 33.730  | 290,651.410   |
| ARISTA NETWORKS INC          | 593    | 222.780 | 132,108.540   |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 2,419  | 31.000  | 74,989.000    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 2,232  | 140.600 | 313,819.200   |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 284    | 764.420 | 217,095.280   |
| BAKER HUGHES CO              | 8,446  | 15.940  | 134,629.240   |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 1,460  | 208.190 | 303,957.400   |
| MERCK & CO. INC.             | 33,538 | 76.300  | 2,558,949.400 |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 10,274 | 51.010  | 524,076.740   |
| MASCO CORP                   | 3,543  | 45.790  | 162,233.970   |
| M & T BANK CORP              | 1,984  | 108.960 | 216,176.640   |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 6,347  | 104.340 | 662,245.980   |
| BLACK KNIGHT INC             | 1,644  | 72.100  | 118,532.400   |
| HEICO CORP-CLASS A           | 1,656  | 91.320  | 151,225.920   |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 4,006  | 92.260  | 369,593.560   |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 2,435  | 173.550 | 422,594.250   |
| WAYFAIR INC- CLASS A         | 600    | 184.760 | 110,856.000   |
| SQUARE INC - A               | 4,926  | 86.720  | 427,182.720   |
| TRANSUNION                   | 3,046  | 87.910  | 267,773.860   |
| VISTRA ENERGY CORP           | 4,285  | 20.200  | 86,557.000    |
| BEIGENE LTD-ADR              | 350    | 163.920 | 57,372.000    |
| NETAPP INC                   | 3,951  | 42.460  | 167,759.460   |
| NIKE INC -CL B               | 16,461 | 96.430  | 1,587,334.230 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 3,343  | 178.180 | 595,655.740   |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC     | 3,492  | 99.630  | 347,907.960   |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 1,749  | 71.600  | 125,228.400   |
| ALLY FINANCIAL INC           | 5,094  | 20.440  | 104,121.360   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 2,196  | 317.680 | 697,625.280   |
| APTIV PLC                    | 3,989  | 75.660  | 301,807.740   |
| NEWMONT CORP                 | 10,413 | 55.450  | 577,400.850   |
| MCKESSON CORP                | 2,161  | 148.250 | 320,368.250   |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 3,257  | 57.150  | 186,137.550   |
| XYLEM INC                    | 1,972  | 64.160  | 126,523.520   |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL     | 20,516 | 70.420  | 1,444,736.720 |  |
| NUCOR CORP                      | 3,692  | 41.200  | 152,110.400   |  |
| WESTERN UNION CO                | 6,811  | 22.520  | 153,383.720   |  |
| GODADDY INC - CLASS A           | 1,930  | 76.260  | 147,181.800   |  |
| NEWELL BRANDS INC               | 4,058  | 15.300  | 62,087.400    |  |
| EVERGY INC                      | 3,243  | 60.080  | 194,839.440   |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP       | 10,238 | 18.500  | 189,403.000   |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A     | 269    | 177.740 | 47,812.060    |  |
| OKTA INC                        | 1,707  | 179.240 | 305,962.680   |  |
| COUPA SOFTWARE INC              | 500    | 224.010 | 112,005.000   |  |
| LIBERTY BROADBAND-C             | 1,350  | 128.480 | 173,448.000   |  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC        | 4,877  | 22.070  | 107,635.390   |  |
| LINDE PLC                       | 6,558  | 201.940 | 1,324,322.520 |  |
| WIX.COM LTD                     | 785    | 216.060 | 169,607.100   |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC          | 6,184  | 20.600  | 127,390.400   |  |
| KKR & CO INC                    | 8,096  | 29.150  | 235,998.400   |  |
| PAYCHEX INC                     | 4,600  | 73.760  | 339,296.000   |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC         | 1,051  | 410.350 | 431,277.850   |  |
| ALTRIA GROUP INC                | 24,749 | 39.130  | 968,428.370   |  |
| PFIZER INC                      | 73,126 | 33.750  | 2,468,002.500 |  |
| CIGNA CORP                      | 5,009  | 190.020 | 951,810.180   |  |
| DELL TECHNOLOGIES -C            | 1,917  | 46.900  | 89,907.300    |  |
| ALTICE USA INC- A               | 1,038  | 24.060  | 24,974.280    |  |
| XCEL ENERGY INC                 | 6,528  | 63.650  | 415,507.200   |  |
| STERIS PLC                      | 897    | 151.820 | 136,182.540   |  |
| FOX CORP - CLASS B              | 1,530  | 27.950  | 42,763.500    |  |
| FOX CORP - CLASS A              | 5,267  | 28.290  | 149,003.430   |  |
| STRYKER CORP                    | 4,482  | 187.790 | 841,674.780   |  |
| DOW INC                         | 10,897 | 41.230  | 449,283.310   |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A     | 1,443  | 219.520 | 316,767.360   |  |
| PARKER HANNIFIN CORP            | 1,839  | 180.160 | 331,314.240   |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC           | 10,109 | 32.240  | 325,914.160   |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES<br>CO | 2,203  | 98.230  | 216,400.690   |  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE         | 33,011 | 115.620 | 3,816,731.820 |  |
| EXELON CORP                     | 13,669 | 37.910  | 518,191.790   |  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC     | 2,652  | 109.300 | 289,863.600   |  |
| TELADOC HEALTH INC              | 776    | 172.270 | 133,681.520   |  |
| INGERSOLL-RAND INC              | 5,397  | 31.220  | 168,494.340   |  |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| NVR INC                         | 45     | 3,175.370 | 142,891.650   |  |
| CONOCOPHILLIPS                  | 14,185 | 43.730    | 620,310.050   |  |
| TWILIO INC - A                  | 1,526  | 191.890   | 292,824.140   |  |
| DOCUSIGN INC                    | 1,721  | 150.600   | 259,182.600   |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC             | 791    | 302.800   | 239,514.800   |  |
| MATCH GROUP INC                 | 928    | 87.250    | 80,968.000    |  |
| PEPSICO INC                     | 18,309 | 129.000   | 2,361,861.000 |  |
| CYBERARK SOFTWARE<br>LTD/ISRAEL | 409    | 98.120    | 40,131.080    |  |
| DROPBOX INC-CLASS A             | 2,392  | 21.030    | 50,303.760    |  |
| MONGODB INC                     | 842    | 193.670   | 163,070.140   |  |
| SNAP INC - A                    | 14,276 | 20.180    | 288,089.680   |  |
| CORTEVA INC                     | 10,736 | 27.540    | 295,669.440   |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC        | 5,388  | 63.160    | 340,306.080   |  |
| AMCOR PLC                       | 17,457 | 9.810     | 171,253.170   |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC -<br>A | 1,160  | 93.120    | 108,019.200   |  |
| ROKU INC                        | 1,488  | 108.070   | 160,808.160   |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC     | 2,092  | 127.290   | 266,290.680   |  |
| ACCENTURE PLC-CL A              | 8,303  | 201.590   | 1,673,801.770 |  |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL<br>A | 2,992  | 30.860    | 92,333.120    |  |
| PENTAIR PLC                     | 1,575  | 37.500    | 59,062.500    |  |
| QUALCOMM INC                    | 14,603 | 85.240    | 1,244,759.720 |  |
| INVESCO LTD                     | 3,700  | 10.340    | 38,258.000    |  |
| ADVANCE AUTO PARTS INC          | 819    | 135.730   | 111,162.870   |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP       | 3,193  | 41.880    | 133,722.840   |  |
| DATADOG INC - CLASS A           | 841    | 78.050    | 65,640.050    |  |
| PINTEREST INC- CLASS A          | 4,300  | 20.890    | 89,827.000    |  |
| AVALARA INC                     | 586    | 105.950   | 62,086.700    |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS       | 1,327  | 588.390   | 780,793.530   |  |
| REPUBLIC SERVICES INC           | 2,667  | 81.730    | 217,973.910   |  |
| BOOKING HOLDINGS INC            | 538    | 1,623.920 | 873,668.960   |  |
| ROSS STORES INC                 | 4,888  | 92.480    | 452,042.240   |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA       | 1,610  | 98.920    | 159,261.200   |  |
| RESMED INC                      | 1,983  | 160.690   | 318,648.270   |  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC           | 1,812  | 110.600   | 200,407.200   |  |
| ROBERT HALF INTL INC            | 1,499  | 51.290    | 76,883.710    |  |
| MODERNA INC                     | 3,038  | 62.000    | 188,356.000   |  |

|                                  |        |         |               |  |
|----------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| RALPH LAUREN CORP                | 400    | 74.770  | 29,908.000    |  |
| PERKINELMER INC                  | 1,163  | 97.140  | 112,973.820   |  |
| CARRIER GLOBAL CORP              | 9,733  | 21.540  | 209,648.820   |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP              | 4,866  | 56.040  | 272,690.640   |  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT<br>INC  | 2,300  | 49.220  | 113,206.000   |  |
| AVANTOR INC                      | 5,600  | 16.980  | 95,088.000    |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A      | 300    | 354.510 | 106,353.000   |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP           | 15,350 | 11.900  | 182,665.000   |  |
| CHEVRON CORP                     | 25,216 | 92.390  | 2,329,706.240 |  |
| EDISON INTERNATIONAL             | 4,985  | 57.570  | 286,986.450   |  |
| TESLA INC                        | 1,915  | 935.280 | 1,791,061.200 |  |
| NORTONLIFELOCK INC               | 7,944  | 19.850  | 157,688.400   |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC       | 2,200  | 131.090 | 288,398.000   |  |
| SYNOPSYS INC                     | 2,031  | 179.600 | 364,767.600   |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-<br>A | 1,974  | 522.570 | 1,031,553.180 |  |
| CBRE GROUP INC - A               | 3,849  | 47.570  | 183,096.930   |  |
| TWITTER INC                      | 8,484  | 33.400  | 283,365.600   |  |
| SOUTHERN CO/THE                  | 13,916 | 56.170  | 781,661.720   |  |
| SYSCO CORP                       | 6,160  | 54.260  | 334,241.600   |  |
| TRAVELERS COS INC/THE            | 3,523  | 113.330 | 399,261.590   |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY          | 1,925  | 56.290  | 108,358.250   |  |
| STEEL DYNAMICS INC               | 2,300  | 26.420  | 60,766.000    |  |
| SCHLUMBERGER LTD                 | 17,899 | 19.000  | 340,081.000   |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES<br>HOLDING  | 2,026  | 37.060  | 75,083.560    |  |
| AT&T INC                         | 94,268 | 30.500  | 2,875,174.000 |  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO            | 1,758  | 35.870  | 63,059.460    |  |
| ON SEMICONDUCTOR CORP            | 8,527  | 18.990  | 161,927.730   |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE          | 1,110  | 547.620 | 607,858.200   |  |
| SEMPRA ENERGY                    | 3,915  | 124.050 | 485,655.750   |  |
| TIFFANY & CO                     | 1,086  | 119.120 | 129,364.320   |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY               | 3,982  | 50.610  | 201,529.020   |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC            | 12,316 | 123.970 | 1,526,814.520 |  |
| SALESFORCE.COM INC               | 10,944 | 175.110 | 1,916,403.840 |  |
| WESTROCK CO                      | 4,588  | 28.210  | 129,427.480   |  |
| JOHNSON CONTROLS<br>INTERNATION  | 9,906  | 34.450  | 341,261.700   |  |

|                                 |        |         |               |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|
| TERADYNE INC                    | 2,096  | 71.750  | 150,388.000   |
| UNION PACIFIC CORP              | 9,128  | 166.180 | 1,516,891.040 |
| MARATHON PETROLEUM CORP         | 9,795  | 36.620  | 358,692.900   |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP      | 20,142 | 65.370  | 1,316,682.540 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B      | 9,534  | 101.480 | 967,510.320   |
| IQVIA HOLDINGS INC              | 2,435  | 138.820 | 338,026.700   |
| VOYA FINANCIAL INC              | 1,800  | 47.860  | 86,148.000    |
| AMEREN CORPORATION              | 2,861  | 71.750  | 205,276.750   |
| UNITEDHEALTH GROUP INC          | 12,499 | 285.150 | 3,564,089.850 |
| VERISIGN INC                    | 1,365  | 204.170 | 278,692.050   |
| VALERO ENERGY CORP              | 5,884  | 63.790  | 375,340.360   |
| ULTA BEAUTY INC                 | 635    | 226.630 | 143,910.050   |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL     | 3,008  | 31.870  | 95,864.960    |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B     | 992    | 95.580  | 94,815.360    |
| ANTHEM INC                      | 3,467  | 265.740 | 921,320.580   |
| WALT DISNEY CO/THE              | 23,998 | 115.490 | 2,771,529.020 |
| WELLS FARGO & CO                | 51,022 | 27.970  | 1,427,085.340 |
| WASTE MANAGEMENT INC            | 6,020  | 103.890 | 625,417.800   |
| WILLIAMS COS INC                | 17,123 | 18.230  | 312,152.290   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY          | 1,591  | 118.450 | 188,453.950   |
| WHIRLPOOL CORP                  | 870    | 122.100 | 106,227.000   |
| WALMART INC                     | 18,895 | 117.740 | 2,224,697.300 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC      | 2,952  | 125.190 | 369,560.880   |
| WYNN RESORTS LTD                | 1,145  | 92.305  | 105,689.220   |
| WABTEC CORP                     | 1,898  | 60.890  | 115,569.220   |
| TJX COMPANIES INC               | 16,180 | 52.460  | 848,802.800   |
| WATERS CORP                     | 1,035  | 185.560 | 192,054.600   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL<br>A | 555    | 258.330 | 143,373.150   |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE<br>INC | 10,540 | 41.400  | 436,356.000   |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC        | 1,868  | 186.770 | 348,886.360   |
| WESTERN DIGITAL CORP            | 3,531  | 42.950  | 151,656.450   |
| WEC ENERGY GROUP INC            | 4,189  | 90.310  | 378,308.590   |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE<br>GP | 6,877  | 49.710  | 341,855.670   |
| VISA INC-CLASS A SHARES         | 22,553 | 192.260 | 4,336,039.780 |
| PPL CORP                        | 10,194 | 26.550  | 270,650.700   |
| PULTEGROUP INC                  | 3,556  | 33.890  | 120,512.840   |

|                                  |         |         |               |  |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| PPG INDUSTRIES INC               | 3,234   | 101.630 | 328,671.420   |  |
| NORTHERN TRUST CORP              | 3,062   | 83.610  | 256,013.820   |  |
| NVIDIA CORP                      | 8,107   | 357.300 | 2,896,631.100 |  |
| IAC/INTERACTIVECORP              | 1,021   | 274.300 | 280,060.300   |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES<br>GROUP  | 5,738   | 110.760 | 635,540.880   |  |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC           | 2,482   | 34.290  | 85,107.780    |  |
| TYSON FOODS INC-CL A             | 4,327   | 62.200  | 269,139.400   |  |
| NETFLIX INC                      | 5,814   | 418.070 | 2,430,658.980 |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC<br>INC  | 5,287   | 339.760 | 1,796,311.120 |  |
| NRG ENERGY INC                   | 3,000   | 33.680  | 101,040.000   |  |
| GLOBE LIFE INC                   | 1,215   | 75.900  | 92,218.500    |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA           | 2,552   | 106.700 | 272,298.400   |  |
| TEXTRON INC                      | 4,310   | 34.150  | 147,186.500   |  |
| NEWS CORP - CLASS A              | 7,999   | 11.720  | 93,748.280    |  |
| OGE ENERGY CORP                  | 2,452   | 30.860  | 75,668.720    |  |
| OMNICOM GROUP                    | 2,546   | 55.030  | 140,106.380   |  |
| ORACLE CORP                      | 30,297  | 51.860  | 1,571,202.420 |  |
| MASTERCARD INC - A               | 11,821  | 297.790 | 3,520,175.590 |  |
| ONEOK INC                        | 4,566   | 34.090  | 155,654.940   |  |
| CENTURYLINK INC                  | 16,534  | 10.080  | 166,662.720   |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC           | 1,269   | 389.810 | 494,668.890   |  |
| YUM! BRANDS INC                  | 4,158   | 91.280  | 379,542.240   |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE<br>SOFTWARE | 1,751   | 134.000 | 234,634.000   |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO -<br>B  | 3,374   | 38.050  | 128,380.700   |  |
| BANK OF AMERICA CORP             | 103,493 | 24.780  | 2,564,556.540 |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC        | 418     | 333.540 | 139,419.720   |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC      | 2,908   | 105.720 | 307,433.760   |  |
| AMERICAN EXPRESS CO              | 9,404   | 101.680 | 956,198.720   |  |
| ANALOG DEVICES INC               | 4,830   | 118.410 | 571,920.300   |  |
| ADVANCED MICRO DEVICES           | 14,308  | 53.500  | 765,478.000   |  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP       | 3,480   | 39.280  | 136,694.400   |  |
| AMERICAN INTERNATIONAL<br>GROUP  | 12,338  | 33.040  | 407,647.520   |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC           | 2,283   | 126.910 | 289,735.530   |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD      | 1,784   | 61.180  | 109,145.120   |  |

|                                 |        |         |               |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|
| AVERY DENNISON CORP             | 1,131  | 113.500 | 128,368.500   |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A      | 7,500  | 54.800  | 411,000.000   |
| EMERSON ELECTRIC CO             | 7,846  | 61.350  | 481,352.100   |
| AON PLC-CLASS A                 | 3,057  | 181.950 | 556,221.150   |
| AMGEN INC                       | 7,871  | 217.900 | 1,715,090.900 |
| EATON CORP PLC                  | 5,681  | 86.010  | 488,622.810   |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A      | 2,181  | 170.280 | 371,380.680   |
| APPLIED MATERIALS INC           | 11,964 | 56.550  | 676,564.200   |
| CME GROUP INC                   | 4,588  | 174.720 | 801,615.360   |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC      | 3,389  | 12.770  | 43,277.530    |
| ECOLAB INC                      | 3,315  | 204.060 | 676,458.900   |
| EQUIFAX INC                     | 1,775  | 167.980 | 298,164.500   |
| GILEAD SCIENCES INC             | 16,808 | 73.200  | 1,230,345.600 |
| KEURIG DR PEPPER INC            | 4,594  | 28.120  | 129,183.280   |
| HORMEL FOODS CORP               | 3,315  | 46.670  | 154,711.050   |
| STATE STREET CORP               | 5,138  | 63.120  | 324,310.560   |
| SCHWAB (CHARLES) CORP           | 15,007 | 36.560  | 548,655.920   |
| BAXTER INTERNATIONAL INC        | 6,275  | 83.970  | 526,911.750   |
| CAMPBELL SOUP CO                | 3,300  | 47.070  | 155,331.000   |
| CROWN HOLDINGS INC              | 2,445  | 65.230  | 159,487.350   |
| CARDINAL HEALTH INC             | 3,319  | 52.890  | 175,541.910   |
| FEDEX CORP                      | 3,451  | 132.720 | 458,016.720   |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP      | 6,388  | 70.630  | 451,184.440   |
| FMC CORP                        | 1,950  | 97.340  | 189,813.000   |
| CERNER CORP                     | 4,133  | 66.960  | 276,745.680   |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES       | 1,163  | 126.850 | 147,526.550   |
| CITRIX SYSTEMS INC              | 1,813  | 140.740 | 255,161.620   |
| INTEL CORP                      | 56,300 | 59.330  | 3,340,279.000 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS<br>INC | 5,231  | 17.280  | 90,391.680    |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP     | 4,866  | 40.030  | 194,785.980   |
| ILLINOIS TOOL WORKS             | 4,040  | 164.940 | 666,357.600   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC          | 15,300 | 5.935   | 90,805.500    |
| ILLUMINA INC                    | 1,971  | 341.610 | 673,313.310   |
| SEALED AIR CORP                 | 1,450  | 30.580  | 44,341.000    |
| INTUITIVE SURGICAL INC          | 1,522  | 558.410 | 849,900.020   |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH       | 1,790  | 106.080 | 189,883.200   |
| SNAP-ON INC                     | 500    | 135.010 | 67,505.000    |
| CARMAX INC                      | 1,990  | 89.980  | 179,060.200   |

|                                  |        |         |                |
|----------------------------------|--------|---------|----------------|
| COMERICA INC                     | 2,887  | 39.140  | 112,997.180    |
| INGREDION INC                    | 530    | 82.190  | 43,560.700     |
| DUKE ENERGY CORP                 | 9,758  | 86.740  | 846,408.920    |
| TARGET CORP                      | 6,474  | 116.900 | 756,810.600    |
| DOVER CORP                       | 1,713  | 96.610  | 165,492.930    |
| VWV GRAINGER INC                 | 588    | 303.750 | 178,605.000    |
| JACOBS ENGINEERING GROUP<br>INC  | 1,750  | 80.490  | 140,857.500    |
| CINTAS CORP                      | 1,336  | 266.200 | 355,643.200    |
| CONAGRA BRANDS INC               | 5,567  | 32.410  | 180,426.470    |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC         | 1,500  | 64.970  | 97,455.000     |
| CLOROX COMPANY                   | 1,628  | 205.120 | 333,935.360    |
| ENTERGY CORP                     | 2,914  | 96.420  | 280,967.880    |
| MICROSOFT CORP                   | 95,607 | 187.740 | 17,949,258.180 |
| INCYTE CORP                      | 2,689  | 92.070  | 247,576.230    |
| CVS HEALTH CORP                  | 17,133 | 64.150  | 1,099,081.950  |
| MEDTRONIC PLC                    | 17,604 | 93.210  | 1,640,868.840  |
| MICRON TECHNOLOGY INC            | 14,666 | 48.690  | 714,087.540    |
| BLACKROCK INC                    | 1,917  | 527.040 | 1,010,335.680  |
| CENTERPOINT ENERGY INC           | 5,636  | 18.000  | 101,448.000    |
| HASBRO INC                       | 1,449  | 74.300  | 107,660.700    |
| KELLOGG CO                       | 3,690  | 63.590  | 234,647.100    |
| KEYCORP                          | 11,782 | 13.220  | 155,758.040    |
| KANSAS CITY SOUTHERN             | 1,176  | 147.270 | 173,189.520    |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-<br>A | 19,360 | 50.730  | 982,132.800    |
| COOPER COS INC/THE               | 572    | 288.400 | 164,964.800    |
| CHUBB LTD                        | 6,298  | 125.690 | 791,595.620    |
| ARROW ELECTRONICS INC            | 1,000  | 66.200  | 66,200.000     |
| ALLSTATE CORP                    | 3,999  | 95.700  | 382,704.300    |
| EBAY INC                         | 10,911 | 47.660  | 520,018.260    |
| PAYPAL HOLDINGS INC              | 14,645 | 155.260 | 2,273,782.700  |
| EASTMAN CHEMICAL CO              | 2,683  | 69.630  | 186,817.290    |
| XILINX INC                       | 3,541  | 90.700  | 321,168.700    |
| DISH NETWORK CORP-A              | 2,984  | 32.700  | 97,576.800     |
| ZIONS BANCORP NA                 | 1,900  | 34.880  | 66,272.000     |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A      | 2,745  | 191.380 | 525,338.100    |
| TRIMBLE INC                      | 4,600  | 41.130  | 189,198.000    |
| LENNAR CORP-A                    | 3,394  | 59.250  | 201,094.500    |

|          |                             |         |          |  |  |
|----------|-----------------------------|---------|----------|--|--|
|          | LEAR CORP                   | 600     | 110.290  | 66,174.000                                     |  |
|          | E*TRADE FINANCIAL CORP      | 3,917   | 47.680   | 186,762.560                                    |  |
|          | PROGRESSIVE CORP            | 7,391   | 76.600   | 566,150.600                                    |  |
|          | PACCAR INC                  | 4,825   | 73.170   | 353,045.250                                    |  |
|          | BIOGEN INC                  | 2,400   | 279.270  | 670,248.000                                    |  |
|          | IDEXX LABORATORIES INC      | 1,200   | 302.830  | 363,396.000                                    |  |
|          | STARBUCKS CORP              | 15,655  | 76.380   | 1,195,728.900                                  |  |
|          | PTC INC                     | 1,200   | 75.160   | 90,192.000                                     |  |
|          | PERRIGO CO PLC              | 1,929   | 51.490   | 99,324.210                                     |  |
|          | EVERSOURCE ENERGY           | 4,290   | 84.310   | 361,689.900                                    |  |
|          | INTUIT INC                  | 3,401   | 280.680  | 954,592.680                                    |  |
|          | BORGWARNER INC              | 3,081   | 33.550   | 103,367.550                                    |  |
|          | BEST BUY CO INC             | 3,500   | 77.760   | 272,160.000                                    |  |
|          | BALL CORP                   | 3,580   | 68.330   | 244,621.400                                    |  |
|          | BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 18,424  | 35.350   | 651,288.400                                    |  |
|          | ELECTRONIC ARTS INC         | 3,677   | 121.970  | 448,483.690                                    |  |
|          | VULCAN MATERIALS CO         | 1,606   | 112.090  | 180,016.540                                    |  |
|          | VERTEX PHARMACEUTICALS INC  | 3,456   | 268.560  | 928,143.360                                    |  |
|          | VF CORP                     | 5,092   | 61.250   | 311,885.000                                    |  |
|          | VIACOMCBS INC - CLASS B     | 7,202   | 22.900   | 164,925.800                                    |  |
|          | MOHAWK INDUSTRIES INC       | 942     | 97.740   | 92,071.080                                     |  |
|          | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC  | 1,003   | 115.290  | 115,635.870                                    |  |
|          | CARNIVAL CORP               | 4,992   | 19.980   | 99,740.160                                     |  |
|          | COMCAST CORP-CLASS A        | 60,131  | 39.460   | 2,372,769.260                                  |  |
|          | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD | 2,100   | 22.210   | 46,641.000                                     |  |
|          | JARDINE MATHESON HLDGS LTD  | 3,600   | 43.960   | 158,256.000                                    |  |
|          | DAIRY FARM INTL HLDGS LTD   | 5,600   | 4.840    | 27,104.000                                     |  |
|          | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD  | 23,100  | 4.030    | 93,093.000                                     |  |
|          | アメリカ・ドル 小計                  |         |          | アメリカ・ドル<br>344,239,043.110<br>(36,916,194,983) |  |
| イギリス・ポンド |                             | 株       | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド                                       |  |
|          | BP PLC                      | 270,183 | 3.230    | 872,826.180                                    |  |
|          | UNILEVER PLC                | 15,143  | 43.040   | 651,754.720                                    |  |
|          | BARCLAYS PLC                | 241,360 | 1.170    | 282,536.010                                    |  |
|          | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC    | 17,745  | 3.275    | 58,114.870                                     |  |
|          | PRUDENTIAL PLC              | 35,676  | 11.420   | 407,419.920                                    |  |

|                              |         |         |               |  |
|------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 50,836  | 1.187   | 60,342.330    |  |
| EVRAZ PLC                    | 7,441   | 2.878   | 21,415.190    |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 1,758   | 20.900  | 36,742.200    |  |
| BAE SYSTEMS PLC              | 37,796  | 5.048   | 190,794.200   |  |
| AVIVA PLC                    | 66,800  | 2.765   | 184,702.000   |  |
| AVEVA GROUP PLC              | 1,140   | 38.720  | 44,140.800    |  |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 66,190  | 15.992  | 1,058,510.480 |  |
| INFORMA PLC                  | 16,200  | 4.606   | 74,617.200    |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | 64,335  | 1.185   | 76,269.140    |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 14,499  | 5.300   | 76,844.700    |  |
| DCC PLC                      | 938     | 67.020  | 62,864.760    |  |
| OCADO GROUP PLC              | 7,963   | 19.580  | 155,915.540   |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC    | 788     | 107.500 | 84,710.000    |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 740     | 95.700  | 70,818.000    |  |
| HALMA PLC                    | 3,978   | 21.850  | 86,919.300    |  |
| GVC HOLDINGS PLC             | 8,805   | 7.456   | 65,650.080    |  |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 6,411   | 6.282   | 40,273.900    |  |
| M&G PLC                      | 25,964  | 1.515   | 39,335.460    |  |
| RELX PLC                     | 26,986  | 18.340  | 494,923.240   |  |
| DIAGEO PLC                   | 31,254  | 27.800  | 868,861.200   |  |
| RIO TINTO PLC                | 15,523  | 45.960  | 713,437.080   |  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 43,431  | 4.269   | 185,406.930   |  |
| TESCO PLC                    | 134,491 | 2.262   | 304,218.640   |  |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 11,297  | 16.015  | 180,921.450   |  |
| GLENORE PLC                  | 129,226 | 1.723   | 222,708.080   |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 3,200   | 16.150  | 51,680.000    |  |
| SMITHS GROUP PLC             | 4,080   | 12.580  | 51,326.400    |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | 31,675  | 2.739   | 86,757.820    |  |
| PEARSON PLC                  | 8,271   | 5.730   | 47,392.830    |  |
| SAINSBURY (J) PLC            | 17,631  | 1.950   | 34,380.450    |  |
| NEXT PLC                     | 2,414   | 50.280  | 121,375.920   |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 32,236  | 1.515   | 48,837.540    |  |
| WHITBREAD PLC                | 1,785   | 23.640  | 42,197.400    |  |
| BUNZL PLC                    | 3,159   | 18.840  | 59,515.560    |  |
| VODAFONE GROUP PLC           | 359,129 | 1.261   | 452,861.660   |  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 1,749   | 50.080  | 87,589.920    |  |
| KINGFISHER PLC               | 17,229  | 1.969   | 33,923.900    |  |

|                                 |         |        |               |
|---------------------------------|---------|--------|---------------|
| WPP PLC                         | 13,021  | 6.186  | 80,547.900    |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 8,244   | 9.020  | 74,360.880    |
| SEVERN TRENT PLC                | 4,300   | 24.060 | 103,458.000   |
| RENTOKIL INITIAL PLC            | 31,432  | 4.804  | 150,999.320   |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 9,111   | 69.080 | 629,387.880   |
| ST JAMES'S PLACE PLC            | 4,883   | 9.266  | 45,245.870    |
| SCHRODERS PLC                   | 1,227   | 29.150 | 35,767.050    |
| SSE PLC                         | 12,460  | 12.385 | 154,317.100   |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC        | 12,368  | 5.258  | 65,030.940    |
| ASTRAZENECA PLC                 | 17,408  | 82.010 | 1,427,630.080 |
| FERGUSON PLC                    | 2,724   | 60.680 | 165,292.320   |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC       | 68,232  | 2.256  | 153,931.390   |
| 3I GROUP PLC                    | 13,293  | 8.130  | 108,072.090   |
| ASHTED GROUP PLC                | 5,921   | 23.610 | 139,794.810   |
| SAGE GROUP PLC/THE              | 18,531  | 6.502  | 120,488.560   |
| NATIONAL GRID PLC               | 43,113  | 9.162  | 395,001.300   |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 865,213 | 0.319  | 276,262.510   |
| RSA INSURANCE GROUP PLC         | 12,586  | 4.056  | 51,048.810    |
| IMPERIAL BRANDS PLC             | 13,785  | 14.855 | 204,776.170   |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE     | 1,963   | 41.810 | 82,073.030    |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO<br>PLC | 30,587  | 30.000 | 917,610.000   |
| BHP GROUP PLC                   | 26,142  | 16.674 | 435,891.700   |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS<br>PLC | 4,964   | 19.280 | 95,705.920    |
| HSBC HOLDINGS PLC               | 271,511 | 3.803  | 1,032,692.080 |
| ANGLO AMERICAN PLC              | 14,645  | 18.252 | 267,300.540   |
| MONDI PLC                       | 5,921   | 14.335 | 84,877.530    |
| WM MORRISON SUPERMARKETS        | 39,167  | 1.839  | 72,028.110    |
| COMPASS GROUP PLC               | 20,481  | 11.500 | 235,531.500   |
| PERSIMMON PLC                   | 4,969   | 23.240 | 115,479.560   |
| BT GROUP PLC                    | 131,754 | 1.153  | 151,912.360   |
| COCA-COLA HBC AG-DI             | 2,574   | 20.560 | 52,921.440    |
| BURBERRY GROUP PLC              | 5,136   | 15.940 | 81,867.840    |
| INTERCONTINENTAL HOTELS<br>GROU | 2,182   | 38.520 | 84,050.640    |
| INTERTEK GROUP PLC              | 2,714   | 52.780 | 143,244.920   |
| ITV PLC                         | 27,587  | 0.787  | 21,710.960    |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP     | 4,305   | 79.620 | 342,764.100   |

|                |                                 |        |            |   |  |
|----------------|---------------------------------|--------|------------|---|--|
|                | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 54,324 | 13.504     | 733,591.290                                   |  |
|                | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 46,667 | 13.058     | 609,377.680                                   |  |
|                | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC       | 2,039  | 23.050     | 46,998.950                                    |  |
|                | ADMIRAL GROUP PLC               | 1,570  | 22.630     | 35,529.100                                    |  |
|                | ANTOFAGASTA PLC                 | 3,460  | 8.680      | 30,032.800                                    |  |
|                | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 33,046 | 2.511      | 82,978.500                                    |  |
|                | EXPERIAN PLC                    | 12,119 | 27.240     | 330,121.560                                   |  |
| イギリス・ポンド 小計    |                                 |        |            | イギリス・ポンド<br>19,259,538.090<br>(2,583,474,439) |  |
| イスラエル・<br>シュケル |                                 | 株      | イスラエル・シュケル | イスラエル・シュケル                                    |  |
|                | ISRAEL DISCOUNT BANK-A          | 12,000 | 11.700     | 140,400.000                                   |  |
|                | AZRIELI GROUP LTD               | 530    | 176.100    | 93,333.000                                    |  |
|                | ICL GROUP LTD                   | 11,096 | 12.250     | 135,926.000                                   |  |
|                | ELBIT SYSTEMS LTD               | 300    | 499.500    | 149,850.000                                   |  |
|                | BANK HAPOALIM BM                | 15,160 | 21.800     | 330,488.000                                   |  |
|                | BANK LEUMI LE-ISRAEL            | 19,043 | 19.480     | 370,957.640                                   |  |
|                | NICE LTD                        | 800    | 643.700    | 514,960.000                                   |  |
|                | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD        | 3,883  | 76.590     | 297,398.970                                   |  |
| イスラエル・シュケル 小計  |                                 |        |            | イスラエル・シュケル<br>2,033,313.610<br>(62,727,725)   |  |
| オーストラリ<br>ア・ドル |                                 | 株      | オーストラリア・ドル | オーストラリア・ドル                                    |  |
|                | MEDIBANK PRIVATE LTD            | 22,824 | 2.930      | 66,874.320                                    |  |
|                | BHP GROUP LTD                   | 39,936 | 35.990     | 1,437,296.640                                 |  |
|                | SOUTH32 LTD                     | 56,387 | 2.100      | 118,412.700                                   |  |
|                | WOODSIDE PETROLEUM LTD          | 15,653 | 21.370     | 334,504.610                                   |  |
|                | FORTESCUE METALS GROUP LTD      | 20,554 | 14.810     | 304,404.740                                   |  |
|                | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD     | 42,103 | 18.590     | 782,694.770                                   |  |
|                | WESTPAC BANKING CORP            | 49,502 | 17.890     | 885,590.780                                   |  |
|                | SANTOS LTD                      | 18,270 | 5.400      | 98,658.000                                    |  |
|                | AUSNET SERVICES                 | 28,500 | 1.745      | 49,732.500                                    |  |
|                | AUST AND NZ BANKING GROUP       | 35,190 | 18.920     | 665,794.800                                   |  |
|                | RIO TINTO LTD                   | 4,169  | 97.810     | 407,769.890                                   |  |
|                | ORIGIN ENERGY LTD               | 20,968 | 5.740      | 120,356.320                                   |  |
|                | AURIZON HOLDINGS LTD            | 29,047 | 4.640      | 134,778.080                                   |  |
|                | WASHINGTON H. SOUL<br>PATTINSON | 953    | 19.410     | 18,497.730                                    |  |

|                              |        |         |               |
|------------------------------|--------|---------|---------------|
| COLES GROUP LTD              | 16,696 | 15.910  | 265,633.360   |
| WISETECH GLOBAL LTD          | 6,132  | 21.220  | 130,121.040   |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 8,183  | 13.700  | 112,107.100   |
| EVOLUTION MINING LTD         | 17,017 | 5.500   | 93,593.500    |
| AFTERPAY LTD                 | 3,000  | 51.860  | 155,580.000   |
| OIL SEARCH LTD               | 17,345 | 3.290   | 57,065.050    |
| SEEK LTD                     | 2,600  | 19.490  | 50,674.000    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD    | 10,173 | 10.860  | 110,478.780   |
| NEWCREST MINING LTD          | 8,420  | 30.090  | 253,357.800   |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 24,163 | 67.320  | 1,626,653.160 |
| AMPOL LTD                    | 2,000  | 27.830  | 55,660.000    |
| ORICA LTD                    | 5,845  | 16.950  | 99,072.750    |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 15,348 | 8.300   | 127,388.400   |
| CIMIC GROUP LTD              | 1,000  | 24.980  | 24,980.000    |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         | 16,980 | 36.670  | 622,656.600   |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 2,600  | 9.140   | 23,764.000    |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 17,352 | 3.350   | 58,129.200    |
| CROWN RESORTS LTD            | 3,000  | 9.950   | 29,850.000    |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 29,395 | 4.490   | 131,983.550   |
| TELSTRA CORP LTD             | 35,114 | 3.160   | 110,960.240   |
| AMP LTD                      | 24,935 | 1.715   | 42,763.520    |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI  | 6,733  | 25.890  | 174,317.370   |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 5,031  | 115.600 | 581,583.600   |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 6,163  | 25.790  | 158,943.770   |
| CSL LTD                      | 5,861  | 284.320 | 1,666,399.520 |
| WESFARMERS LTD               | 15,753 | 42.470  | 669,029.910   |
| COCHLEAR LTD                 | 805    | 191.470 | 154,133.350   |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 7,092  | 11.900  | 84,394.800    |
| SUNCORP GROUP LTD            | 14,504 | 9.300   | 134,887.200   |
| ASX LTD                      | 2,260  | 85.130  | 192,393.800   |
| COMPUTERSHARE LTD            | 6,054  | 12.700  | 76,885.800    |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 27,097 | 5.640   | 152,827.080   |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 5,223  | 28.070  | 146,609.610   |
| AGL ENERGY LTD               | 8,466  | 17.460  | 147,816.360   |
| BRAMBLES LTD                 | 18,337 | 10.950  | 200,790.150   |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 2,064  | 65.580  | 135,357.120   |
| TPG TELECOM LTD              | 5,000  | 8.200   | 41,000.000    |
| REA GROUP LTD                | 608    | 102.620 | 62,392.960    |

|               |                              |        |           |   |  |
|---------------|------------------------------|--------|-----------|---|--|
|               | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 1,551  | 55.720    | 86,421.720                                      |  |
| オーストラリア・ドル 小計 |                              |        |           | オーストラリア・ドル<br>14,474,022.050<br>(1,057,472,050) |  |
| カナダ・ドル        |                              | 株      | カナダ・ドル    | カナダ・ドル  |  |
|               | IMPERIAL OIL LTD             | 2,300  | 23.140    | 53,222.000                                      |  |
|               | CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 250    | 1,471.030 | 367,757.500                                     |  |
|               | RESTAURANT BRANDS INTERN     | 3,721  | 75.740    | 281,828.540                                     |  |
|               | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 6,300  | 51.860    | 326,718.000                                     |  |
|               | INTACT FINANCIAL CORP        | 1,700  | 131.040   | 222,768.000                                     |  |
|               | BCE INC                      | 900    | 57.290    | 51,561.000                                      |  |
|               | FRANCO-NEVADA CORP           | 2,200  | 175.680   | 386,496.000                                     |  |
|               | SUNCOR ENERGY INC            | 21,812 | 24.870    | 542,464.440                                     |  |
|               | METRO INC/CN                 | 3,000  | 57.410    | 172,230.000                                     |  |
|               | NATIONAL BANK OF CANADA      | 5,100  | 60.990    | 311,049.000                                     |  |
|               | BANK OF NOVA SCOTIA          | 16,600 | 58.510    | 971,266.000                                     |  |
|               | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 5,700  | 94.020    | 535,914.000                                     |  |
|               | TORONTO-DOMINION BANK        | 24,200 | 62.410    | 1,510,322.000                                   |  |
|               | GREAT-WEST LIFECO INC        | 3,900  | 23.800    | 92,820.000                                      |  |
|               | ROYAL BANK OF CANADA         | 19,000 | 91.350    | 1,735,650.000                                   |  |
|               | TC ENERGY CORP               | 12,700 | 58.880    | 747,776.000                                     |  |
|               | PEMBINA PIPELINE CORP        | 9,071  | 33.460    | 303,515.660                                     |  |
|               | BARRICK GOLD CORP            | 24,000 | 32.740    | 785,760.000                                     |  |
|               | CAE INC                      | 2,300  | 24.250    | 55,775.000                                      |  |
|               | THOMSON REUTERS CORP         | 3,033  | 91.650    | 277,974.450                                     |  |
|               | EMPIRE CO LTD 'A'            | 1,800  | 31.070    | 55,926.000                                      |  |
|               | CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 3,300  | 45.070    | 148,731.000                                     |  |
|               | HYDRO ONE LTD                | 4,800  | 25.210    | 121,008.000                                     |  |
|               | LOBLAW COMPANIES LTD         | 2,489  | 66.440    | 165,369.160                                     |  |
|               | WSP GLOBAL INC               | 1,200  | 84.740    | 101,688.000                                     |  |
|               | PARKLAND CORP                | 2,800  | 34.570    | 96,796.000                                      |  |
|               | QUEBECOR INC -CL B           | 2,300  | 29.500    | 67,850.000                                      |  |
|               | EMERA INC                    | 4,300  | 53.320    | 229,276.000                                     |  |
|               | CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 1,000  | 31.020    | 31,020.000                                      |  |
|               | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 5,600  | 59.580    | 333,648.000                                     |  |
|               | AGNICO EAGLE MINES LTD       | 2,900  | 80.560    | 233,624.000                                     |  |
|               | ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 7,000  | 18.760    | 131,320.000                                     |  |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| B2GOLD CORP                     | 16,400 | 6.970     | 114,308.000   |  |
| AIR CANADA                      | 1,700  | 19.400    | 32,980.000    |  |
| KINROSS GOLD CORP               | 22,034 | 8.430     | 185,746.620   |  |
| BANK OF MONTREAL                | 8,200  | 74.450    | 610,490.000   |  |
| POWER CORP OF CANADA            | 6,300  | 23.860    | 150,318.000   |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A           | 1,400  | 1,009.230 | 1,412,922.000 |  |
| NUTRIEN LTD                     | 8,027  | 49.270    | 395,490.290   |  |
| CANOPY GROWTH CORP              | 2,000  | 22.440    | 44,880.000    |  |
| CRONOS GROUP INC                | 3,400  | 8.770     | 29,818.000    |  |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD          | 4,300  | 49.840    | 214,312.000   |  |
| CAMECO CORP                     | 2,800  | 13.820    | 38,696.000    |  |
| TELUS CORP                      | 600    | 23.300    | 13,980.000    |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B        | 4,400  | 14.110    | 62,084.000    |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A      | 1,300  | 120.380   | 156,494.000   |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES      | 15,200 | 24.340    | 369,968.000   |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD     | 300    | 421.320   | 126,396.000   |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC         | 3,100  | 60.030    | 186,093.000   |  |
| WESTON (GEORGE) LTD             | 901    | 97.910    | 88,216.910    |  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP        | 2,400  | 35.540    | 85,296.000    |  |
| BLACKBERRY LTD                  | 6,400  | 7.140     | 45,696.000    |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC          | 8,800  | 50.150    | 441,320.000   |  |
| ENBRIDGE INC                    | 26,700 | 42.130    | 1,124,871.000 |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL<br>A | 18,000 | 46.440    | 835,920.000   |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP         | 26,600 | 18.780    | 499,548.000   |  |
| BAUSCH HEALTH COS INC           | 4,300  | 23.220    | 99,846.000    |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY<br>LTD | 1,800  | 342.390   | 616,302.000   |  |
| IA FINANCIAL CORP INC           | 1,100  | 45.590    | 50,149.000    |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC           | 2,800  | 21.870    | 61,236.000    |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO        | 9,400  | 119.520   | 1,123,488.000 |  |
| CGI INC - CLASS A               | 2,800  | 89.490    | 250,572.000   |  |
| ONEX CORPORATION                | 1,600  | 59.990    | 95,984.000    |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B       | 6,800  | 23.050    | 156,740.000   |  |
| IGM FINANCIAL INC               | 300    | 33.120    | 9,936.000     |  |
| OPEN TEXT CORP                  | 4,500  | 56.920    | 256,140.000   |  |
| CI FINANCIAL CORP               | 2,000  | 16.810    | 33,620.000    |  |
| SAPUTO INC                      | 2,900  | 32.410    | 93,989.000    |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD      | 6,300  | 8.790     | 55,377.000    |  |

|              |                              |         |           |   |  |
|--------------|------------------------------|---------|-----------|---|--|
|              | ALIMENTATION COUCHE-TARD -B  | 11,900  | 41.770    | 497,063.000                                 |  |
|              | YAMANA GOLD INC              | 11,900  | 6.640     | 79,016.000                                  |  |
|              | FORTIS INC                   | 6,200   | 51.390    | 318,618.000                                 |  |
|              | LUNDIN MINING CORP           | 6,600   | 6.560     | 43,296.000                                  |  |
|              | CENOVUS ENERGY INC           | 14,100  | 6.210     | 87,561.000                                  |  |
|              | DOLLARAMA INC                | 5,000   | 47.900    | 239,500.000                                 |  |
|              | ATCO LTD -CLASS I            | 800     | 36.380    | 29,104.000                                  |  |
|              | ALTAGAS LTD                  | 4,700   | 15.080    | 70,876.000                                  |  |
|              | KEYERA CORP                  | 2,200   | 20.710    | 45,562.000                                  |  |
|              | INTER PIPELINE LTD           | 4,800   | 12.150    | 58,320.000                                  |  |
| カナダ・ドル 小計    |                              |         |           | カナダ・ドル<br>23,087,262.570<br>(1,816,044,074) |  |
| シンガポール・ドル    |                              | 株       | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル                                   |  |
|              | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 17,900  | 22.280    | 398,812.000                                 |  |
|              | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 27,100  | 21.930    | 594,303.000                                 |  |
|              | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 17,750  | 4.160     | 73,840.000                                  |  |
|              | KEPPEL CORP LTD              | 17,300  | 6.040     | 104,492.000                                 |  |
|              | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 5,200   | 8.530     | 44,356.000                                  |  |
|              | CAPITALAND LTD               | 33,400  | 3.000     | 100,200.000                                 |  |
|              | YANGZIJIANG SHIPBUILDING     | 27,000  | 0.980     | 26,460.000                                  |  |
|              | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 900     | 21.850    | 19,665.000                                  |  |
|              | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 44,700  | 9.240     | 413,028.000                                 |  |
|              | GENTING SINGAPORE LTD        | 45,000  | 0.770     | 34,650.000                                  |  |
|              | VENTURE CORP LTD             | 3,200   | 15.250    | 48,800.000                                  |  |
|              | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 128,400 | 2.550     | 327,420.000                                 |  |
|              | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 14,100  | 3.450     | 48,645.000                                  |  |
|              | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 16,800  | 8.250     | 138,600.000                                 |  |
|              | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 15,800  | 3.960     | 62,568.000                                  |  |
| シンガポール・ドル 小計 |                              |         |           | シンガポール・ドル<br>2,435,839.000<br>(187,218,586) |  |
| スイス・フラン      |                              | 株       | スイス・フラン   | スイス・フラン                                     |  |
|              | UBS GROUP AG-REG             | 51,259  | 10.255    | 525,661.040                                 |  |
|              | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 130     | 694.500   | 90,285.000                                  |  |
|              | ADECCO GROUP AG-REG          | 1,754   | 44.560    | 78,158.240                                  |  |

|                                  |        |            |               |  |
|----------------------------------|--------|------------|---------------|--|
| ROCHE HOLDING AG-<br>GENUSSCHEIN | 9,391  | 325.650    | 3,058,179.150 |  |
| PARGESA HOLDING SA-BR            | 389    | 72.000     | 28,008.000    |  |
| SIKA AG-REG                      | 1,690  | 168.900    | 285,441.000   |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG      | 2      | 81,300.000 | 162,600.000   |  |
| ABB LTD-REG                      | 24,581 | 19.755     | 485,597.650   |  |
| SWISS RE AG                      | 3,666  | 73.200     | 268,351.200   |  |
| NESTLE SA-REG                    | 39,217 | 102.800    | 4,031,507.600 |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG        | 234    | 805.200    | 188,416.800   |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT      | 531    | 215.800    | 114,589.800   |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG       | 30,122 | 9.452      | 284,713.140   |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD            | 4,113  | 41.250     | 169,661.250   |  |
| SGS SA-REG                       | 65     | 2,215.000  | 143,975.000   |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG         | 467    | 214.200    | 100,031.400   |  |
| VIFOR PHARMA AG                  | 665    | 138.450    | 92,069.250    |  |
| TEMENOS AG - REG                 | 793    | 136.950    | 108,601.350   |  |
| ALCON INC                        | 5,588  | 54.880     | 306,669.440   |  |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR           | 500    | 189.700    | 94,850.000    |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG        | 1,792  | 327.000    | 585,984.000   |  |
| BALOISE HOLDING AG - REG         | 611    | 141.400    | 86,395.400    |  |
| CLARIANT AG-REG                  | 1,568  | 17.790     | 27,894.720    |  |
| NOVARTIS AG-REG                  | 28,050 | 80.260     | 2,251,293.000 |  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG           | 56     | 1,808.000  | 101,248.000   |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-<br>REG | 6,710  | 60.800     | 407,968.000   |  |
| SWISSCOM AG-REG                  | 276    | 487.200    | 134,467.200   |  |
| GEBERIT AG-REG                   | 456    | 452.700    | 206,431.200   |  |
| GIVAUDAN-REG                     | 113    | 3,394.000  | 383,522.000   |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG         | 111    | 740.800    | 82,228.800    |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG            | 934    | 198.350    | 185,258.900   |  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG       | 1,043  | 55.160     | 57,531.880    |  |
| LONZA GROUP AG-REG               | 1,020  | 465.500    | 474,810.000   |  |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG          | 450    | 37.020     | 16,659.000    |  |
| LAFARGEHOLCIM LTD-REG            | 6,587  | 40.250     | 265,126.750   |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG        | 381    | 352.500    | 134,302.500   |  |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG       | 974    | 140.850    | 137,187.900   |  |
| SWISS PRIME SITE-REG             | 946    | 89.650     | 84,808.900    |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC       | 17     | 7,710.000  | 131,070.000   |  |
| スイス・フラン 小計                       |        |            | スイス・フラン       |  |

|                 |                                  |        |                 | 16,371,554.460  |  |
|-----------------|----------------------------------|--------|-----------------|-----------------|--|
|                 |                                  |        |                 | (1,845,237,904) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ |                                  | 株      | スウェーデン・クロー<br>ナ | スウェーデン・クロー<br>ナ |  |
|                 | ICA GRUPPEN AB                   | 700    | 426.800         | 298,760.000     |  |
|                 | ERICSSON LM-B SHS                | 41,443 | 83.600          | 3,464,634.800   |  |
|                 | VOLVO AB-B SHS                   | 18,873 | 136.800         | 2,581,826.400   |  |
|                 | SKF AB-B SHARES                  | 4,000  | 169.350         | 677,400.000     |  |
|                 | ELECTROLUX AB-SER B              | 2,600  | 153.150         | 398,190.000     |  |
|                 | SWEDISH MATCH AB                 | 2,188  | 626.200         | 1,370,125.600   |  |
|                 | TELE2 AB-B SHS                   | 7,026  | 121.650         | 854,712.900     |  |
|                 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-<br>A | 21,779 | 78.280          | 1,704,860.120   |  |
|                 | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS      | 24,145 | 89.120          | 2,151,802.400   |  |
|                 | SWEDBANK AB - A SHARES           | 14,593 | 123.220         | 1,798,149.460   |  |
|                 | HENNES & MAURITZ AB-B SHS        | 10,352 | 143.850         | 1,489,135.200   |  |
|                 | SKANSKA AB-B SHS                 | 3,709  | 183.000         | 678,747.000     |  |
|                 | SANDVIK AB                       | 19,087 | 155.700         | 2,971,845.900   |  |
|                 | INVESTOR AB-B SHS                | 6,290  | 483.000         | 3,038,070.000   |  |
|                 | ATLAS COPCO AB-A SHS             | 9,836  | 371.600         | 3,655,057.600   |  |
|                 | SECURITAS AB-B SHS               | 2,500  | 119.400         | 298,500.000     |  |
|                 | TELIA CO AB                      | 36,421 | 31.660          | 1,153,088.860   |  |
|                 | ALFA LAVAL AB                    | 4,840  | 189.950         | 919,358.000     |  |
|                 | ATLAS COPCO AB-B SHS             | 6,370  | 323.700         | 2,061,969.000   |  |
|                 | ASSA ABLOY AB-B                  | 14,449 | 187.500         | 2,709,187.500   |  |
|                 | LUNDBERGS AB-B SHS               | 948    | 411.600         | 390,196.800     |  |
|                 | LUNDIN ENERGY AB                 | 1,900  | 221.800         | 421,420.000     |  |
|                 | ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 9,787  | 285.500         | 2,794,188.500   |  |
|                 | BOLIDEN AB                       | 3,171  | 209.400         | 664,007.400     |  |
|                 | EPIROC AB-A                      | 6,982  | 110.650         | 772,558.300     |  |
|                 | EPIROC AB-B                      | 10,064 | 109.250         | 1,099,492.000   |  |
|                 | HUSQVARNA AB-B SHS               | 2,400  | 72.760          | 174,624.000     |  |
|                 | NORDEA BANK ABP                  | 43,548 | 67.670          | 2,946,893.160   |  |
|                 | EQT AB                           | 3,845  | 151.300         | 581,748.500     |  |
|                 | EVOLUTION GAMING GROUP           | 2,064  | 541.600         | 1,117,862.400   |  |
|                 | KINNEVIK AB - B                  | 3,641  | 226.100         | 823,230.100     |  |
|                 | HEXAGON AB-B SHS                 | 3,868  | 510.800         | 1,975,774.400   |  |
|                 | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 1,300  | 204.400         | 265,720.000     |  |
| スウェーデン・クローナ 小計  |                                  |        |                 | スウェーデン・クロー<br>ナ |  |

|                |                              |        |             |   |  |
|----------------|------------------------------|--------|-------------|---|--|
|                |                              |        |             | 48,303,136.300                                |  |
|                |                              |        |             | (554,520,005)                                 |  |
| デンマーク・クローネ     |                              | 株      | デンマーク・クローネ  | デンマーク・クローネ                                    |  |
|                | NOVO NORDISK A/S-B           | 24,058 | 432.100     | 10,395,461.800                                |  |
|                | DANSKE BANK A/S              | 7,236  | 87.860      | 635,754.960                                   |  |
|                | AP MOELLER-MAERSK A/S-A      | 111    | 7,010.000   | 778,110.000                                   |  |
|                | H LUNDBECK A/S               | 500    | 249.700     | 124,850.000                                   |  |
|                | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 2,557  | 662.600     | 1,694,268.200                                 |  |
|                | GN STORE NORD A/S            | 1,159  | 351.800     | 407,736.200                                   |  |
|                | CARLSBERG AS-B               | 1,232  | 867.000     | 1,068,144.000                                 |  |
|                | NOVOZYMES A/S-B SHARES       | 2,981  | 373.900     | 1,114,595.900                                 |  |
|                | COLOPLAST-B                  | 1,519  | 1,044.500   | 1,586,595.500                                 |  |
|                | DSV PANALPINA A/S            | 2,798  | 768.800     | 2,151,102.400                                 |  |
|                | DEMANT A/S                   | 1,314  | 183.000     | 240,462.000                                   |  |
|                | AP MOLLER-MAERSK A/S-B       | 66     | 7,540.000   | 497,640.000                                   |  |
|                | TRYG A/S                     | 1,700  | 193.500     | 328,950.000                                   |  |
|                | PANDORA A/S                  | 2,452  | 339.400     | 832,208.800                                   |  |
|                | CHR HANSEN HOLDING A/S       | 1,262  | 662.800     | 836,453.600                                   |  |
|                | GENMAB A/S                   | 1,073  | 1,979.000   | 2,123,467.000                                 |  |
|                | ORSTED A/S                   | 3,117  | 749.200     | 2,335,256.400                                 |  |
|                | AMBU A/S-B                   | 2,091  | 215.100     | 449,774.100                                   |  |
| デンマーク・クローネ 小計  |                              |        |             | デンマーク・クローネ<br>27,600,830.860<br>(446,857,451) |  |
| ニュージーランド・ドル    |                              | 株      | ニュージーランド・ドル | ニュージーランド・ドル                                   |  |
|                | MERIDIAN ENERGY LTD          | 15,000 | 4.760       | 71,400.000                                    |  |
|                | MERCURY NZ LTD               | 21,705 | 4.650       | 100,928.250                                   |  |
|                | A2 MILK CO LTD               | 7,000  | 18.800      | 131,600.000                                   |  |
|                | SPARK NEW ZEALAND LTD        | 16,860 | 4.330       | 73,003.800                                    |  |
|                | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 26,972 | 6.480       | 174,778.560                                   |  |
|                | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 9,200  | 28.400      | 261,280.000                                   |  |
|                | RYMAN HEALTHCARE LTD         | 4,419  | 12.850      | 56,784.150                                    |  |
| ニュージーランド・ドル 小計 |                              |        |             | ニュージーランド・ドル<br>869,774.760<br>(59,788,316)    |  |

|                                 |                                 |         |             |  |  |
|---------------------------------|---------------------------------|---------|-------------|--|--|
| ノルウェー・クローネ                      |                                 | 株       | ノルウェー・クローネ  | ノルウェー・クローネ                                   |  |
|                                 | NORSK HYDRO ASA                 | 13,050  | 26.920      | 351,306.000                                  |  |
|                                 | DNB ASA                         | 12,838  | 134.700     | 1,729,278.600                                |  |
|                                 | ORKLA ASA                       | 13,784  | 85.780      | 1,182,391.520                                |  |
|                                 | TELENOR ASA                     | 8,746   | 150.000     | 1,311,900.000                                |  |
|                                 | EQUINOR ASA                     | 17,854  | 144.050     | 2,571,868.700                                |  |
|                                 | YARA INTERNATIONAL ASA          | 2,756   | 349.300     | 962,670.800                                  |  |
|                                 | MOWI ASA                        | 4,677   | 187.550     | 877,171.350                                  |  |
|                                 | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA       | 2,000   | 182.600     | 365,200.000                                  |  |
| SCHIBSTED ASA-B SHS             | 1,700                           | 235.800 | 400,860.000 |  |  |
| ノルウェー・クローネ 小計                   |                                 |         |             | ノルウェー・クローネ<br>9,752,646.970<br>(107,961,803) |  |
| ユーロ                             |                                 | 株       | ユーロ         | ユーロ  |  |
|                                 | BAYER AG-REG                    | 12,553  | 65.230      | 818,832.190                                  |  |
|                                 | EVONIK INDUSTRIES AG            | 1,800   | 22.730      | 40,914.000                                   |  |
|                                 | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED     | 33,667  | 8.278       | 278,695.420                                  |  |
|                                 | COMMERZBANK AG                  | 9,689   | 4.160       | 40,306.240                                   |  |
|                                 | VOLKSWAGEN AG                   | 420     | 146.400     | 61,488.000                                   |  |
|                                 | VOLKSWAGEN AG-PREF              | 2,634   | 133.960     | 352,850.640                                  |  |
|                                 | SIEMENS AG-REG                  | 9,927   | 98.560      | 978,405.120                                  |  |
|                                 | E.ON SE                         | 34,932  | 9.738       | 340,167.810                                  |  |
|                                 | UNIPER SE                       | 4,112   | 27.460      | 112,915.520                                  |  |
|                                 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG     | 4,571   | 56.150      | 256,661.650                                  |  |
|                                 | GEA GROUP AG                    | 1,300   | 26.910      | 34,983.000                                   |  |
|                                 | CONTINENTAL AG                  | 2,054   | 86.300      | 177,260.200                                  |  |
|                                 | BASF SE                         | 11,283  | 51.120      | 576,786.960                                  |  |
|                                 | ALLIANZ SE-REG                  | 5,392   | 178.080     | 960,207.360                                  |  |
|                                 | THYSSENKRUPP AG                 | 4,030   | 6.948       | 28,000.440                                   |  |
|                                 | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG      | 2,683   | 81.800      | 219,469.400                                  |  |
|                                 | RWE AG                          | 7,526   | 29.700      | 223,522.200                                  |  |
|                                 | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG          | 1,700   | 10.470      | 17,799.000                                   |  |
|                                 | FRAPORT AG FRANKFURT<br>AIRPORT | 560     | 43.000      | 24,080.000                                   |  |
| BRENNTAG AG                     | 3,109                           | 44.960  | 139,780.640 |  |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA          | 4,835                           | 42.220  | 204,133.700 |  |  |
| UNITED INTERNET AG-REG<br>SHARE | 959                             | 35.120  | 33,680.080  |  |  |
| HOCHTIEF AG                     | 166                             | 76.050  | 12,624.300  |  |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| SAP SE                          | 13,263 | 115.300 | 1,529,223.900 |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG      | 1,704  | 224.700 | 382,888.800   |  |
| ZALANDO SE                      | 2,025  | 61.800  | 125,145.000   |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG             | 2,128  | 45.600  | 97,036.800    |  |
| KION GROUP AG                   | 600    | 51.840  | 31,104.000    |  |
| WIRECARD AG                     | 1,899  | 92.130  | 174,954.870   |  |
| COVESTRO AG                     | 1,945  | 32.720  | 63,640.400    |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG             | 650    | 288.000 | 187,200.000   |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF      | 2,102  | 50.120  | 105,352.240   |  |
| DELIVERY HERO SE                | 1,979  | 84.300  | 166,829.700   |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR      | 560    | 86.400  | 48,384.000    |  |
| METRO AG                        | 1,500  | 8.488   | 12,732.000    |  |
| NEMETSCHEK SE                   | 1,139  | 59.950  | 68,283.050    |  |
| AROUNDTOWN SA                   | 16,064 | 5.496   | 88,287.740    |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG         | 1,500  | 42.625  | 63,937.500    |  |
| KNORR-BREMSE AG                 | 549    | 94.000  | 51,606.000    |  |
| TEAMVIEWER AG                   | 2,542  | 42.530  | 108,111.260   |  |
| BEIERSDORF AG                   | 1,275  | 98.240  | 125,256.000   |  |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF          | 700    | 35.740  | 25,018.000    |  |
| MERCK KGAA                      | 1,692  | 101.300 | 171,399.600   |  |
| ADIDAS AG                       | 2,324  | 230.100 | 534,752.400   |  |
| PUMA SE                         | 1,295  | 65.600  | 84,952.000    |  |
| HENKEL AG & CO KGAA             | 1,311  | 73.950  | 96,948.450    |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG         | 41,860 | 14.590  | 610,737.400   |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &     | 3,310  | 74.240  | 245,734.400   |  |
| DAIMLER AG-REGISTERED<br>SHARES | 12,190 | 36.020  | 439,083.800   |  |
| QIAGEN N.V.                     | 2,521  | 38.150  | 96,176.150    |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG        | 16,497 | 19.530  | 322,186.410   |  |
| HANNOVER RUECK SE               | 644    | 154.700 | 99,626.800    |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG            | 13,116 | 30.210  | 396,234.360   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG              | 2,404  | 149.450 | 359,277.800   |  |
| LANXESS AG                      | 1,529  | 45.400  | 69,416.600    |  |
| MTU AERO ENGINES AG             | 666    | 155.900 | 103,829.400   |  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE              | 4,796  | 39.650  | 190,161.400   |  |
| SYMRISE AG                      | 2,120  | 95.820  | 203,138.400   |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND<br>HOLDI | 6,240  | 2.596   | 16,199.040    |  |

|                              |        |           |               |  |
|------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 900    | 44.080    | 39,672.000    |  |
| VONOVIA SE                   | 7,186  | 53.140    | 381,864.040   |  |
| LEG IMMOBILIEN AG            | 506    | 117.000   | 59,202.000    |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 11,193 | 40.200    | 449,958.600   |  |
| NN GROUP NV                  | 3,100  | 30.120    | 93,372.000    |  |
| ARCELORMITTAL                | 8,031  | 9.527     | 76,511.330    |  |
| HEINEKEN NV                  | 3,711  | 81.460    | 302,298.060   |  |
| AEGON NV                     | 38,061 | 2.573     | 97,930.950    |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN  | 15,971 | 23.420    | 374,040.820   |  |
| AKZO NOBEL N.V.              | 2,504  | 74.240    | 185,896.960   |  |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 2,625  | 118.900   | 312,112.500   |  |
| WOLTERS KLUWER               | 4,053  | 66.600    | 269,929.800   |  |
| ING GROEP NV                 | 43,286 | 6.372     | 275,818.390   |  |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 62,375 | 2.249     | 140,281.370   |  |
| ASML HOLDING NV              | 5,376  | 306.000   | 1,645,056.000 |  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 9,053  | 7.644     | 69,201.130    |  |
| GALAPAGOS NV                 | 557    | 172.200   | 95,915.400    |  |
| ADYEN NV                     | 199    | 1,170.500 | 232,929.500   |  |
| UNILEVER NV                  | 18,650 | 47.330    | 882,704.500   |  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 1,400  | 82.200    | 115,080.000   |  |
| PROSUS NV                    | 6,672  | 77.000    | 513,744.000   |  |
| VOPAK                        | 630    | 47.830    | 30,132.900    |  |
| RANDSTAD NV                  | 2,020  | 38.520    | 77,810.400    |  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 1,285  | 73.150    | 93,997.750    |  |
| ALTICE EUROPE NV             | 11,295 | 3.600     | 40,662.000    |  |
| JCDECAUX SA                  | 845    | 18.460    | 15,598.700    |  |
| TOTAL SA                     | 30,873 | 35.095    | 1,083,487.930 |  |
| MICHELIN (CGDE)              | 2,708  | 89.940    | 243,557.520   |  |
| AIR LIQUIDE SA               | 6,119  | 123.050   | 752,942.950   |  |
| KERING                       | 977    | 487.350   | 476,140.950   |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 6,745  | 91.120    | 614,604.400   |  |
| BOUYGUES SA                  | 4,392  | 27.540    | 120,955.680   |  |
| BNP PARIBAS                  | 14,899 | 34.970    | 521,018.030   |  |
| PEUGEOT SA                   | 6,497  | 13.465    | 87,482.100    |  |
| NATIXIS                      | 7,674  | 2.272     | 17,435.320    |  |
| THALES SA                    | 1,404  | 70.580    | 99,094.320    |  |
| DANONE                       | 7,551  | 61.240    | 462,423.240   |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| CARREFOUR SA                    | 8,022  | 14.040  | 112,628.880   |  |
| SUEZ                            | 2,950  | 10.370  | 30,591.500    |  |
| VIVENDI                         | 10,430 | 22.120  | 230,711.600   |  |
| L'OREAL                         | 3,205  | 263.400 | 844,197.000   |  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN       | 8,424  | 29.910  | 251,961.840   |  |
| LEGRAND SA                      | 4,119  | 62.500  | 257,437.500   |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON       | 200    | 34.720  | 6,944.000     |  |
| PERNOD RICARD SA                | 3,125  | 143.650 | 448,906.250   |  |
| EURAZEO SE                      | 560    | 46.080  | 25,804.800    |  |
| SOCIETE GENERALE SA             | 11,065 | 14.766  | 163,385.790   |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS<br>VUI | 3,573  | 379.150 | 1,354,702.950 |  |
| ACCOR SA                        | 1,850  | 25.780  | 47,693.000    |  |
| CAPGEMINI SE                    | 2,445  | 96.160  | 235,111.200   |  |
| VALEO SA                        | 3,703  | 22.000  | 81,466.000    |  |
| PUBLICIS GROUPE                 | 2,918  | 29.600  | 86,372.800    |  |
| BUREAU VERITAS SA               | 3,227  | 18.840  | 60,796.680    |  |
| EIFFAGE                         | 1,650  | 80.860  | 133,419.000   |  |
| SODEXO SA                       | 1,248  | 64.000  | 79,872.000    |  |
| IPSEN                           | 276    | 70.750  | 19,527.000    |  |
| INGENICO GROUP                  | 1,185  | 127.750 | 151,383.750   |  |
| ORPEA                           | 524    | 99.280  | 52,022.720    |  |
| AMUNDI SA                       | 437    | 66.000  | 28,842.000    |  |
| TELEPERFORMANCE                 | 870    | 208.400 | 181,308.000   |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT           | 977    | 66.940  | 65,400.380    |  |
| FAURECIA                        | 560    | 32.870  | 18,407.200    |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC             | 131    | 570.600 | 74,748.600    |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH        | 399    | 209.400 | 83,550.600    |  |
| SEB SA                          | 197    | 134.200 | 26,437.400    |  |
| ESSILORLUXOTTICA                | 3,809  | 113.900 | 433,845.100   |  |
| DASSAULT AVIATION SA            | 22     | 848.000 | 18,656.000    |  |
| WORLDLINE SA                    | 2,389  | 67.800  | 161,974.200   |  |
| AXA SA                          | 27,453 | 18.286  | 502,005.550   |  |
| EDENRED                         | 3,007  | 39.220  | 117,934.540   |  |
| RENAULT SA                      | 2,554  | 22.000  | 56,188.000    |  |
| HERMES INTERNATIONAL            | 451    | 738.400 | 333,018.400   |  |
| STMICROELECTRONICS NV           | 10,488 | 22.900  | 240,175.200   |  |
| REMY COINTREAU                  | 253    | 115.200 | 29,145.600    |  |
| ATOS SE                         | 946    | 69.520  | 65,765.920    |  |

|                             |         |         |               |
|-----------------------------|---------|---------|---------------|
| DASSAULT SYSTEMES SA        | 1,980   | 147.150 | 291,357.000   |
| WENDEL                      | 201     | 82.400  | 16,562.400    |
| ORANGE                      | 25,792  | 10.410  | 268,494.720   |
| ALSTOM                      | 2,961   | 41.250  | 122,141.250   |
| CNP ASSURANCES              | 1,349   | 10.980  | 14,812.020    |
| SANOFI                      | 14,291  | 89.020  | 1,272,184.820 |
| VINCI SA                    | 6,925   | 82.980  | 574,636.500   |
| AIRBUS SE                   | 7,216   | 66.950  | 483,111.200   |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT        | 7,351   | 20.450  | 150,327.950   |
| CREDIT AGRICOLE SA          | 14,609  | 8.126   | 118,712.730   |
| BIOMERIEUX                  | 457     | 113.400 | 51,823.800    |
| ENGIE                       | 21,099  | 10.955  | 231,139.540   |
| EDF                         | 6,760   | 8.164   | 55,188.640    |
| SES                         | 4,402   | 6.798   | 29,924.790    |
| SAFRAN SA                   | 4,381   | 89.840  | 393,589.040   |
| ILIAD SA                    | 219     | 160.700 | 35,193.300    |
| ARKEMA                      | 838     | 80.080  | 67,107.040    |
| ADP                         | 350     | 98.950  | 34,632.500    |
| SCOR SE                     | 3,289   | 24.380  | 80,185.820    |
| GETLINK SE                  | 4,973   | 12.960  | 64,450.080    |
| BOLLORE                     | 7,300   | 2.784   | 20,323.200    |
| UCB SA                      | 1,921   | 87.720  | 168,510.120   |
| KBC GROUP NV                | 3,011   | 49.070  | 147,749.770   |
| COLRUYT SA                  | 350     | 53.620  | 18,767.000    |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 1,139   | 73.180  | 83,352.020    |
| SOLVAY SA                   | 873     | 70.420  | 61,476.660    |
| UMICORE                     | 3,619   | 41.730  | 151,020.870   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  | 9,876   | 45.200  | 446,395.200   |
| AGEAS                       | 1,654   | 32.790  | 54,234.660    |
| PROXIMUS                    | 2,269   | 19.420  | 44,063.980    |
| TELENET GROUP HOLDING NV    | 462     | 37.420  | 17,288.040    |
| SOFINA                      | 239     | 228.500 | 54,611.500    |
| PRYSMIAN SPA                | 4,145   | 19.205  | 79,604.720    |
| ASSICURAZIONI GENERALI      | 15,985  | 13.425  | 214,598.620   |
| MEDIOBANCA SPA              | 9,971   | 6.808   | 67,882.560    |
| TENARIS SA                  | 4,700   | 6.254   | 29,393.800    |
| UNICREDIT SPA               | 29,471  | 7.942   | 234,058.680   |
| TELECOM ITALIA SPA          | 108,503 | 0.353   | 38,344.960    |
| TELECOM ITALIA-RSP          | 48,381  | 0.372   | 18,007.400    |

|                                 |         |         |             |
|---------------------------------|---------|---------|-------------|
| INTESA SANPAOLO                 | 175,533 | 1.622   | 284,714.520 |
| ATLANTIA SPA                    | 6,027   | 14.375  | 86,638.120  |
| POSTE ITALIANE SPA              | 7,727   | 8.248   | 63,732.290  |
| MONCLER SPA                     | 3,935   | 34.020  | 133,868.700 |
| RECORDATI SPA                   | 2,359   | 40.560  | 95,681.040  |
| ENI SPA                         | 36,061  | 8.587   | 309,655.800 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA       | 4,483   | 7.460   | 33,443.180  |
| PIRELLI & C SPA                 | 5,651   | 3.900   | 22,038.900  |
| DIASORIN SPA                    | 277     | 167.000 | 46,259.000  |
| NEXI SPA                        | 3,553   | 14.160  | 50,310.480  |
| LEONARDO SPA                    | 6,676   | 6.196   | 41,364.490  |
| ENEL SPA                        | 99,910  | 7.345   | 733,838.950 |
| SNAM SPA                        | 24,300  | 4.325   | 105,097.500 |
| TERNA SPA                       | 19,900  | 6.042   | 120,235.800 |
| EXOR NV                         | 1,088   | 48.570  | 52,844.160  |
| CNH INDUSTRIAL NV               | 11,691  | 6.078   | 71,057.890  |
| FINECOBANK SPA                  | 5,972   | 11.580  | 69,155.760  |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES<br>NV | 16,937  | 8.193   | 138,764.840 |
| FERRARI NV                      | 2,083   | 148.650 | 309,637.950 |
| TELEFONICA SA                   | 53,820  | 4.542   | 244,450.440 |
| ENDESA SA                       | 5,850   | 21.430  | 125,365.500 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA<br>ARGENTA | 95,166  | 3.129   | 297,774.410 |
| IBERDROLA SA                    | 77,143  | 9.750   | 752,144.250 |
| BANKINTER SA                    | 6,700   | 4.237   | 28,387.900  |
| REPSOL SA                       | 17,685  | 8.688   | 153,647.280 |
| GRIFOLS SA                      | 5,114   | 27.920  | 142,782.880 |
| BANCO SANTANDER SA              | 207,370 | 2.213   | 458,909.810 |
| AMADEUS IT GROUP SA             | 5,048   | 48.400  | 244,323.200 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA         | 3,978   | 16.505  | 65,656.890  |
| MAPFRE SA                       | 8,005   | 1.712   | 13,704.560  |
| CAIXABANK SA                    | 46,859  | 1.858   | 87,087.450  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV     | 3,583   | 22.630  | 81,083.290  |
| AENA SME SA                     | 866     | 124.000 | 107,384.000 |
| CELLNEX TELECOM SA              | 3,601   | 48.750  | 175,548.750 |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL      | 14,255  | 24.410  | 347,964.550 |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE<br>ENE | 1,793   | 14.840  | 26,608.120  |

|       |                                 |        |         |  |  |
|-------|---------------------------------|--------|---------|--|--|
|       | ENAGAS SA                       | 3,675  | 20.720  | 76,146.000                               |  |
|       | RED ELECTRICA CORPORACION<br>SA | 8,190  | 16.270  | 133,251.300                              |  |
|       | FERROVIAL SA                    | 6,055  | 24.600  | 148,953.000                              |  |
|       | UPM-KYMMENE OYJ                 | 6,525  | 25.730  | 167,888.250                              |  |
|       | NOKIA OYJ                       | 65,261 | 3.727   | 243,227.740                              |  |
|       | WARTSILA OYJ ABP                | 4,116  | 7.218   | 29,709.280                               |  |
|       | STORA ENSO OYJ-R SHS            | 8,853  | 10.600  | 93,841.800                               |  |
|       | METSO OYJ                       | 1,108  | 29.790  | 33,007.320                               |  |
|       | ELISA OYJ                       | 2,818  | 53.020  | 149,410.360                              |  |
|       | SAMPO OYJ-A SHS                 | 6,809  | 30.570  | 208,151.130                              |  |
|       | FORTUM OYJ                      | 4,400  | 16.700  | 73,480.000                               |  |
|       | KONE OYJ-B                      | 5,216  | 59.480  | 310,247.680                              |  |
|       | NESTE OYJ                       | 5,778  | 34.910  | 201,709.980                              |  |
|       | ORION OYJ-CLASS B               | 1,763  | 43.210  | 76,179.230                               |  |
|       | VERBUND AG                      | 1,216  | 39.000  | 47,424.000                               |  |
|       | OMV AG                          | 1,209  | 31.400  | 37,962.600                               |  |
|       | ERSTE GROUP BANK AG             | 5,879  | 22.500  | 132,277.500                              |  |
|       | VOESTALPINE AG                  | 1,800  | 19.260  | 34,668.000                               |  |
|       | RAIFFEISEN BANK<br>INTERNATIONA | 1,100  | 17.260  | 18,986.000                               |  |
|       | ANDRITZ AG                      | 550    | 32.720  | 17,996.000                               |  |
|       | SMURFIT KAPPA GROUP PLC         | 4,675  | 27.240  | 127,347.000                              |  |
|       | KINGSPAN GROUP PLC              | 1,600  | 52.300  | 83,680.000                               |  |
|       | JERONIMO MARTINS                | 2,900  | 15.090  | 43,761.000                               |  |
|       | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA     | 27,576 | 4.107   | 113,254.630                              |  |
|       | GALP ENERGIA SGPS SA            | 7,183  | 10.800  | 77,576.400                               |  |
|       | KERRY GROUP PLC-A               | 2,295  | 109.200 | 250,614.000                              |  |
|       | CRH PLC                         | 10,517 | 29.600  | 311,303.200                              |  |
|       | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC       | 903    | 120.700 | 108,992.100                              |  |
|       | ユーロ 小計                          |        |         | ユーロ<br>47,669,079.080<br>(5,752,704,464) |  |
| 香港・ドル | 株                               |        | 香港・ドル   | 香港・ドル                                    |  |
|       | POWER ASSETS HOLDINGS LTD       | 23,500 | 44.300  | 1,041,050.000                            |  |
|       | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP<br>L | 34,000 | 54.450  | 1,851,300.000                            |  |
|       | MTR CORP                        | 16,500 | 40.850  | 674,025.000                              |  |
|       | SUN HUNG KAI PROPERTIES         | 19,000 | 100.300 | 1,905,700.000                            |  |
|       | SINO LAND CO                    | 34,000 | 9.670   | 328,780.000                              |  |

|                                 |         |         |  |  |
|---------------------------------|---------|---------|--|--|
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD       | 37,552  | 52.050  | 1,954,581.600                            |  |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A        | 8,000   | 44.600  | 356,800.000                              |  |
| CLP HOLDINGS LTD                | 26,000  | 78.050  | 2,029,300.000                            |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT      | 20,565  | 29.550  | 607,695.750                              |  |
| HONG KONG & CHINA GAS           | 163,836 | 12.540  | 2,054,503.440                            |  |
| HANG SENG BANK LTD              | 8,000   | 129.500 | 1,036,000.000                            |  |
| WHEELOCK & CO LTD               | 5,000   | 60.250  | 301,250.000                              |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT           | 58,000  | 9.240   | 535,920.000                              |  |
| WH GROUP LTD                    | 169,500 | 6.740   | 1,142,430.000                            |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR     | 16,900  | 296.200 | 5,005,780.000                            |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD        | 37,000  | 17.420  | 644,540.000                              |  |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY          | 3,000   | 75.600  | 226,800.000                              |  |
| NWS HOLDINGS LTD                | 15,000  | 7.140   | 107,100.000                              |  |
| KERRY PROPERTIES LTD            | 7,500   | 20.550  | 154,125.000                              |  |
| BANK OF EAST ASIA LTD           | 8,600   | 18.440  | 158,584.000                              |  |
| SJM HOLDINGS LTD                | 10,000  | 9.250   | 92,500.000                               |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD            | 8,000   | 19.480  | 155,840.000                              |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD           | 28,552  | 47.000  | 1,341,944.000                            |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS<br>L | 5,500   | 41.150  | 226,325.000                              |  |
| PCCW LTD                        | 60,000  | 4.470   | 268,200.000                              |  |
| AIA GROUP LTD                   | 167,800 | 71.400  | 11,980,920.000                           |  |
| WHARF REAL ESTATE<br>INVESTMENT | 14,000  | 34.450  | 482,300.000                              |  |
| BUDWEISER BREWING CO APAC<br>LT | 19,200  | 23.550  | 452,160.000                              |  |
| SANDS CHINA LTD                 | 29,000  | 32.550  | 943,950.000                              |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO<br>LTD | 19,000  | 73.950  | 1,405,050.000                            |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD      | 39,000  | 24.100  | 939,900.000                              |  |
| WYNN MACAU LTD                  | 16,800  | 14.640  | 245,952.000                              |  |
| 香港・ドル 小計                        |         |         | 香港・ドル<br>40,651,305.790<br>(562,614,071) |  |
| 合計                              |         |         | 51,952,815,871<br>[51,952,815,871]       |  |

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類   | 通貨      | 銘柄 | 券面総額 | 評価額     | 備考 |
|------|---------|----|------|---------|----|
| 投資証券 | アメリカ・ドル |    |      | アメリカ・ドル |    |

|                              |        |               |  |
|------------------------------|--------|---------------|--|
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 1,679  | 274,936.250   |  |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 4,233  | 321,623.340   |  |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 2,356  | 227,448.240   |  |
| VORNADO REALTY TRUST         | 2,128  | 85,481.760    |  |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 1,501  | 446,352.370   |  |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 5,245  | 333,424.650   |  |
| EQUINIX INC                  | 1,168  | 790,315.520   |  |
| AMERICAN TOWER CORP          | 5,827  | 1,503,832.160 |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 12,228 | 154,561.920   |  |
| INVITATION HOMES INC         | 9,002  | 249,085.340   |  |
| VICI PROPERTIES INC          | 5,464  | 121,792.560   |  |
| VENTAS INC                   | 6,514  | 256,716.740   |  |
| WEYERHAEUSER CO              | 10,935 | 237,945.600   |  |
| AGNC INVESTMENT CORP         | 7,559  | 102,877.990   |  |
| CROWN CASTLE INTL CORP       | 5,507  | 905,185.590   |  |
| IRON MOUNTAIN INC            | 3,474  | 96,646.680    |  |
| VEREIT INC                   | 13,632 | 88,744.320    |  |
| SUN COMMUNITIES INC          | 1,214  | 168,054.020   |  |
| PROLOGIS INC                 | 9,436  | 891,324.560   |  |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 1,648  | 262,476.960   |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 1,177  | 112,179.870   |  |
| DUKE REALTY CORP             | 4,971  | 175,724.850   |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 771    | 192,503.280   |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 974    | 88,117.780    |  |
| WELLTOWER INC                | 5,989  | 330,832.360   |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 6,434  | 176,806.320   |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 1,714  | 204,103.120   |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 1,950  | 123,805.500   |  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 15,632 | 108,955.040   |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 1,552  | 55,313.280    |  |
| REALTY INCOME CORP           | 4,587  | 277,192.410   |  |
| PUBLIC STORAGE               | 2,105  | 413,569.350   |  |
| REGENCY CENTERS CORP         | 1,939  | 92,858.710    |  |
| UDR INC                      | 4,752  | 185,755.680   |  |
| WP CAREY INC                 | 2,702  | 186,735.220   |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 2,164  | 65,547.560    |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 3,262  | 443,632.000   |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 1,797  | 173,787.870   |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 8,597  | 166,609.860   |  |

|               |                              |        |  |
|---------------|------------------------------|--------|--|
| アメリカ・ドル 小計    |                              |        | アメリカ・ドル<br>11,092,856.630<br>(1,189,597,945) |
| イギリス・ポンド      | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 10,295 | イギリス・ポンド<br>63,787.820                       |
|               | SEGRO PLC                    | 13,286 | 115,800.770                                  |
|               | BRITISH LAND CO PLC          | 14,580 | 60,200.820                                   |
| イギリス・ポンド 小計   |                              |        | イギリス・ポンド<br>239,789.410<br>(32,165,351)      |
| オーストラリア・ドル    | LENDLEASE GROUP              | 4,303  | オーストラリア・ドル<br>52,797.810                     |
|               | TRANSURBAN GROUP             | 39,765 | 564,265.350                                  |
|               | SYDNEY AIRPORT               | 9,129  | 58,973.340                                   |
|               | APA GROUP                    | 14,243 | 159,806.460                                  |
|               | SCENTRE GROUP                | 64,017 | 146,598.930                                  |
|               | DEXUS                        | 13,949 | 134,468.360                                  |
|               | GPT GROUP                    | 30,647 | 130,862.690                                  |
|               | MIRVAC GROUP                 | 61,117 | 144,236.120                                  |
|               | STOCKLAND                    | 18,729 | 67,611.690                                   |
|               | GOODMAN GROUP                | 20,198 | 298,122.480                                  |
|               | VICINITY CENTRES             | 50,371 | 79,586.180                                   |
| オーストラリア・ドル 小計 |                              |        | オーストラリア・ドル<br>1,837,329.410<br>(134,235,287) |
| カナダ・ドル        | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 2,000  | カナダ・ドル<br>29,380.000                         |
|               | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 4,200  | 91,014.000                                   |
|               | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 1,600  | 78,544.000                                   |
|               | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 1,400  | 23,324.000                                   |
| カナダ・ドル 小計     |                              |        | カナダ・ドル<br>222,262.000<br>(17,483,129)        |
| シンガポール・ドル     | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 28,000 | シンガポール・ドル<br>49,280.000                      |
|               | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 30,500 | 94,550.000                                   |
|               | CAPITALAND MALL TRUST        | 31,500 | 64,575.000                                   |

|              |                             |        |  |       |
|--------------|-----------------------------|--------|--|-------|
|              | SUNTEC REIT                 | 26,000 | 38,220.000                               |       |
|              | MAPLETREE LOGISTICS TRUST   | 46,000 | 86,940.000                               |       |
|              | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST  | 37,600 | 76,704.000                               |       |
| シンガポール・ドル 小計 |                             |        | シンガポール・ドル<br>410,269.000<br>(31,533,275) |       |
| ユーロ          | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD   | 1,751  | 100,402.340                              | ユーロ   |
|              | ICADE                       | 406    | 26,593.000                               |       |
|              | GECINA SA                   | 578    | 67,394.800                               |       |
|              | KLEPIERRE                   | 2,394  | 44,061.570                               |       |
|              | COVIVIO                     | 353    | 23,086.200                               |       |
| ユーロ 小計       |                             |        | ユーロ<br>261,537.910<br>(31,562,395)       |       |
| 香港・ドル        | LINK REIT                   | 32,000 | 2,147,200.000                            | 香港・ドル |
|              | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 52,000 | 403,520.000                              |       |
|              | HKT TRUST AND HKT LTD-SS    | 34,000 | 390,320.000                              |       |
| 香港・ドル 小計     |                             |        | 香港・ドル<br>2,941,040.000<br>(40,703,994)   |       |
| 投資証券 合計      |                             |        | 1,477,281,376<br>[1,477,281,376]         |       |
| 合計           |                             |        | 1,477,281,376<br>[1,477,281,376]         |       |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

| 通貨       | 銘柄数       | 組入株式<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|----------|-----------|--------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル  | 株式 585銘柄  | 96.9%        | 3.1%               | 71.5%          |
|          | 投資証券 39銘柄 |              |                    |                |
| イギリス・ポンド | 株式 85銘柄   | 98.8%        | 1.2%               | 4.9%           |
|          | 投資証券 3銘柄  |              |                    |                |

|             |      |       |       |       |       |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|
| イスラエル・シケル   | 株式   | 8銘柄   | 100%  | -%    | 0.1%  |
| オーストラリア・ドル  | 株式   | 53銘柄  | 88.7% | 11.3% | 2.2%  |
|             | 投資証券 | 11銘柄  |       |       |       |
| カナダ・ドル      | 株式   | 79銘柄  | 99.0% | 1.0%  | 3.4%  |
|             | 投資証券 | 4銘柄   |       |       |       |
| シンガポール・ドル   | 株式   | 15銘柄  | 85.6% | 14.4% | 0.4%  |
|             | 投資証券 | 6銘柄   |       |       |       |
| スイス・フラン     | 株式   | 39銘柄  | 100%  | -%    | 3.5%  |
| スウェーデン・クローナ | 株式   | 33銘柄  | 100%  | -%    | 1.0%  |
| デンマーク・クローネ  | 株式   | 18銘柄  | 100%  | -%    | 0.8%  |
| ニュージーランド・ドル | 株式   | 7銘柄   | 100%  | -%    | 0.1%  |
| ノルウェー・クローネ  | 株式   | 9銘柄   | 100%  | -%    | 0.2%  |
| ユーロ         | 株式   | 237銘柄 | 99.5% | 0.5%  | 10.8% |
|             | 投資証券 | 5銘柄   |       |       |       |
| 香港・ドル       | 株式   | 32銘柄  | 93.3% | 6.7%  | 1.1%  |
|             | 投資証券 | 3銘柄   |       |       |       |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 12,043,433          | 13,351,854          |
| 親投資信託受益証券       | 4,523,081,433       | 5,717,491,134       |
| 未収入金            | 1,310,000           | 16,167,000          |
| 流動資産合計          | 4,536,434,866       | 5,747,009,988       |
| 資産合計            | 4,536,434,866       | 5,747,009,988       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 4,273,865           | 17,130,907          |
| 未払受託者報酬         | 427,926             | 585,202             |
| 未払委託者報酬         | 8,238,530           | 11,265,728          |
| その他未払費用         | 107,967             | 146,268             |
| 流動負債合計          | 13,048,288          | 29,128,105          |
| 負債合計            | 13,048,288          | 29,128,105          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 3,228,404,217     | 1 4,017,999,045     |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,294,982,361       | 1,699,882,838       |
| （分配準備積立金）       | 299,344,530         | 213,764,073         |
| 元本等合計           | 4,523,386,578       | 5,717,881,883       |
| 純資産合計           | 4,523,386,578       | 5,717,881,883       |
| 負債純資産合計         | 4,536,434,866       | 5,747,009,988       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期                          |               | 第4期                          |               |
|-------------------------|------------------------------|---------------|------------------------------|---------------|
|                         | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |               | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |               |
| <b>営業収益</b>             |                              |               |                              |               |
| 受取利息                    |                              | 1             |                              | 32            |
| 有価証券売買等損益               |                              | 68,766,650    |                              | 64,584,501    |
| 営業収益合計                  |                              | 68,766,651    |                              | 64,584,533    |
| <b>営業費用</b>             |                              |               |                              |               |
| 支払利息                    |                              | 5,617         |                              | 4,322         |
| 受託者報酬                   |                              | 808,608       |                              | 1,102,043     |
| 委託者報酬                   |                              | 15,567,469    |                              | 21,215,911    |
| その他費用                   |                              | 202,482       |                              | 276,781       |
| 営業費用合計                  |                              | 16,584,176    |                              | 22,599,057    |
| <b>営業利益</b>             |                              | 52,182,475    |                              | 41,985,476    |
| 経常利益                    |                              | 52,182,475    |                              | 41,985,476    |
| <b>当期純利益</b>            |                              | 52,182,475    |                              | 41,985,476    |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |                              | 5,385,900     |                              | 41,781,722    |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         |                              | 933,266,596   |                              | 1,294,982,361 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |                              | 575,430,718   |                              | 881,028,566   |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | 575,430,718   |                              | 881,028,566   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |                              | 260,511,528   |                              | 476,331,843   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |                              | 260,511,528   |                              | 476,331,843   |
| 分配金                     |                              | 1 -           |                              | 1 -           |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )         |                              | 1,294,982,361 |                              | 1,699,882,838 |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 2,374,174,372円 | 3,228,404,217円 |
| 期中追加設定元本額           | 1,523,438,524円 | 1,946,108,703円 |
| 期中一部解約元本額           | 669,208,679円   | 1,156,513,875円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 3,228,404,217口 | 4,017,999,045口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |  |   |
|------------|--|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(46,799,914円)、投資信託約款に規定される収益調整金(995,642,847円)及び分配準備積立金(252,544,616円)より分配対象額は1,294,987,377円(1万口当たり4,011.23円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(203,984円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,486,122,571円)及び分配準備積立金(213,560,089円)より分配対象額は1,699,886,644円(1万口当たり4,230.68円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|--|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 64,783,772               | 44,494,607               |
| 合計        | 64,783,772               | 44,494,607               |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.4011円<br>(14,011円) | 1.4231円<br>(14,231円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄               | 券面総額          | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 外国株式インデックスマザーファンド | 2,237,678,030 | 5,717,491,134 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                   |               | 5,717,491,134 |    |
| 合計           |                   |               | 5,717,491,134 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金 額 (円)      | 金 額 (円)      |
| 資産の部 |              |              |
| 流動資産 |              |              |

|                 |   |                 |                 |
|-----------------|---|-----------------|-----------------|
| 預金              |   | 1,178,453,239   | 619,339,923     |
| コール・ローン         |   | 278,740,028     | 145,274,253     |
| 株式              |   | 107,829,712,844 | 125,564,531,893 |
| 投資証券            |   | 3,214,011,606   | 3,486,620,478   |
| 派生商品評価勘定        |   | 13,899,411      | 7,810,526       |
| 未収入金            |   | 3,677,222       | 13,724,812      |
| 未収配当金           |   | 193,387,984     | 164,924,746     |
| 差入委託証拠金         |   | 523,224,081     | 250,215,025     |
| 流動資産合計          |   | 113,235,106,415 | 130,252,441,656 |
| 資産合計            |   | 113,235,106,415 | 130,252,441,656 |
| 負債の部            |   |                 |                 |
| 流動負債            |   |                 |                 |
| 派生商品評価勘定        |   | -               | 16,391,754      |
| 未払金             |   | 676,538,686     | 437,400         |
| 未払解約金           |   | 9,373,300       | 190,283,100     |
| その他未払費用         |   | -               | 6,291           |
| 流動負債合計          |   | 685,911,986     | 207,118,545     |
| 負債合計            |   | 685,911,986     | 207,118,545     |
| 純資産の部           |   |                 |                 |
| 元本等             |   |                 |                 |
| 元本              | 1 | 44,938,531,796  | 50,896,184,101  |
| 剰余金             |   |                 |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) |   | 67,610,662,633  | 79,149,139,010  |
| 元本等合計           |   | 112,549,194,429 | 130,045,323,111 |
| 純資産合計           |   | 112,549,194,429 | 130,045,323,111 |
| 負債純資産合計         |   | 113,235,106,415 | 130,252,441,656 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式                        |

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                              | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                          | 2018年6月16日      | 2019年6月18日      |
| 期首元本額                            | 41,775,947,138円 | 44,938,531,796円 |
| 期中追加設定元本額                        | 6,764,304,685円  | 17,213,607,793円 |
| 期中一部解約元本額                        | 3,601,720,027円  | 11,255,955,488円 |
| 期末元本額の内訳                         |                 |                 |
| ファンド名                            |                 |                 |
| ダイワ外国株式インデックスVA                  | 464,023,812円    | 455,035,857円    |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)     | 12,197,180円     | 9,724,653円      |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)     | 165,854,025円    | 123,970,830円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)     | 19,605,630円     | 16,165,872円     |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)     | 536,545,354円    | 436,705,325円    |
| 外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) | 3,097,423円      | 16,848,205円     |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス エマー<br>ジ<br>ングプラス(為替ヘッジな<br>し) | 555,335,842円    | 554,243,792円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>株式インデックス(為替ヘッ<br>ジなし)                   | 1,805,981,806円  | 2,237,678,030円  |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国株式インデックス<br>エマージングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 537,785,213円    | 643,296,020円    |
| D - I ' s 外国株式インデッ<br>クス                                 | 6,557,900円      | 8,065,683円      |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                                  | 493,277円        | 5,547,826円      |
| i F r e e 外国株式イン<br>デックス(為替ヘッジなし)                        | 905,383,641円    | 1,611,943,894円  |
| i F r e e 8資産バランス  | 683,566,181円    | 977,106,331円    |
| i F r e e 年金バランス   | 18,023,500円     | 37,228,086円     |
| D Cダイワ外国株式インデッ<br>クス                                     | 28,406,470,539円 | 32,298,766,795円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                                       | 566,909,665円    | 567,653,416円    |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                                       | 846,970,888円    | 988,544,589円    |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                                       | 648,553,039円    | 744,909,989円    |
| 大和D C海外株式インデック<br>スファンド                                  | 1,486,105,064円  | 1,548,942,585円  |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020                                  | 3,399,663円      | 2,773,012円      |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030                                  | 13,174,854円     | 13,532,746円     |
| D Cダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                                  | 4,250,389円      | 7,121,165円      |
| ダイワつみたてインデックス<br>外国株式                                    | 64,183,977円     | 331,490,248円    |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス3 0                                 | 39,782円         | 2,497,968円      |
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス5 0                                 | 79,563円         | 1,899,391円      |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワつみたてインデックス<br>バランス70                  | 99,454円         | 2,287,321円      |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド15VA                  | 73,565円         | -円              |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド20VA                  | 151,649円        | -円              |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド25VA                  | 1,162,691円      | -円              |
| ダイワ世界分散バランスファ<br>ンド30VA                  | 1,725,194円      | -円              |
| ダイワ世界バランスファンド<br>40VA                    | 205,401,310円    | 186,973,164円    |
| ダイワ世界バランスファンド<br>60VA                    | 345,545,113円    | 315,943,780円    |
| ダイワ・バランスファンド3<br>5VA                     | 2,865,699,348円  | 2,678,662,952円  |
| ダイワ・バランスファンド2<br>5VA(適格機関投資家専<br>用)      | 147,509,273円    | 123,631,857円    |
| ダイワ・インデックスセレク<br>ト 外国株式                  | 663,098,757円    | 782,872,861円    |
| ダイワ・ノーロード 外国株<br>式ファンド                   | 108,076,802円    | 179,126,306円    |
| ダイワ外国株式インデックス<br>(為替ヘッジなし)(ダイワ<br>SMA専用) | 6,619,723円      | 87,456,566円     |
| ダイワ投信倶楽部外国株式イ<br>ンデックス                   | 2,695,843,941円  | 2,757,935,593円  |
| ダイワライフスタイル25                             | 19,225,455円     | 19,967,520円     |
| ダイワライフスタイル50                             | 67,902,980円     | 65,250,374円     |
| ダイワライフスタイル75                             | 55,808,334円     | 54,383,499円     |
| 計  | 44,938,531,796円 | 50,896,184,101円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                         | 44,938,531,796口 | 50,896,184,101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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15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<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--|--------------|--------------|

| 種 類  | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
|------|------------------------|------------------------|
| 株式   | 5,887,925,688          | 5,809,361,573          |
| 投資証券 | 336,561,445            | 436,536,397            |
| 合計   | 6,224,487,133          | 6,245,897,970          |

(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6月17日まで、及び2019年12月3日から2020年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

### 1. 株式関連

| 種 類          | 2019年6月17日 現在 |           |               |             | 2020年6月15日 現在 |           |             |             |
|--------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
|              | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|              |               |           |               |             |               |           |             |             |
| 市場取引         |               |           |               |             |               |           |             |             |
| 株値指数<br>先物取引 |               |           |               |             |               |           |             |             |
| 買 建          | 1,478,267,686 | -         | 1,491,888,217 | 13,620,531  | 789,370,269   | -         | 779,890,465 | 9,479,804   |
| 合計           | 1,478,267,686 | -         | 1,491,888,217 | 13,620,531  | 789,370,269   | -         | 779,890,465 | 9,479,804   |

(注) 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

### 2. 通貨関連

| 種 類 | 2019年6月17日 現在 |    |      | 2020年6月15日 現在 |    |      |
|-----|---------------|----|------|---------------|----|------|
|     | 契約額等          | 時価 | 評価損益 | 契約額等          | 時価 | 評価損益 |
|     |               |    |      |               |    |      |

|            | (円)         | うち<br>1年超 | (円)         | (円)     | (円)         | うち<br>1年超 | (円)         | (円)     |
|------------|-------------|-----------|-------------|---------|-------------|-----------|-------------|---------|
| 市場取引以外の取引  |             |           |             |         |             |           |             |         |
| 為替予約取引     |             |           |             |         |             |           |             |         |
| 売 建        | -           | -         | -           | -       | 414,623,346 | -         | 413,794,200 | 829,146 |
| アメリカ・ドル    | -           | -         | -           | -       | 299,613,720 | -         | 300,244,000 | 630,280 |
| イギリス・ポンド   | -           | -         | -           | -       | 36,810,126  | -         | 36,215,100  | 595,026 |
| オーストラリア・ドル | -           | -         | -           | -       | 10,453,128  | -         | 10,227,000  | 226,128 |
| カナダ・ドル     | -           | -         | -           | -       | 14,357,700  | -         | 14,157,000  | 200,700 |
| スイス・フラン    | -           | -         | -           | -       | 19,282,488  | -         | 19,160,700  | 121,788 |
| ユーロ        | -           | -         | -           | -       | 34,106,184  | -         | 33,790,400  | 315,784 |
| 買 建        | 260,121,120 | -         | 260,400,000 | 278,880 | 163,413,570 | -         | 163,483,000 | 69,430  |
| アメリカ・ドル    | 260,121,120 | -         | 260,400,000 | 278,880 | 139,049,950 | -         | 139,347,000 | 297,050 |
| ユーロ        | -           | -         | -           | -       | 24,363,620  | -         | 24,136,000  | 227,620 |
| 合計         | 260,121,120 | -         | 260,400,000 | 278,880 | 578,036,916 | -         | 577,277,200 | 898,576 |

## (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6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 2.5045円<br>(25,045円) | 2.5551円<br>(25,551円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

| 通貨                           | 銘柄                            | 株式数     | 評価額           |               | 備考 |
|------------------------------|-------------------------------|---------|---------------|---------------|----|
|                              |                               |         | 単価            | 金額            |    |
| アメリカ・ドル                      |                               | 株       | アメリカ・ドル       | アメリカ・ドル       |    |
|                              | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION | 3,550   | 121.630       | 431,786.500   |    |
|                              | PALO ALTO NETWORKS INC        | 3,230   | 221.850       | 716,575.500   |    |
|                              | KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN      | 6,100   | 95.670        | 583,587.000   |    |
|                              | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS  | 4,400   | 76.970        | 338,668.000   |    |
|                              | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      | 1,780   | 104.680       | 186,330.400   |    |
|                              | SYNCHRONY FINANCIAL           | 17,300  | 23.770        | 411,221.000   |    |
|                              | ABBOTT LABORATORIES           | 56,166  | 89.020        | 4,999,897.320 |    |
|                              | HOWMET AEROSPACE INC          | 13,233  | 14.000        | 185,262.000   |    |
|                              | VERISK ANALYTICS INC          | 4,950   | 162.670       | 805,216.500   |    |
|                              | LAS VEGAS SANDS CORP          | 11,100  | 49.870        | 553,557.000   |    |
|                              | AMPHENOL CORP-CL A            | 9,400   | 95.010        | 893,094.000   |    |
|                              | FIDELITY NATIONAL INFO SERV   | 19,662  | 137.080       | 2,695,266.960 |    |
|                              | QORVO INC                     | 3,650   | 108.900       | 397,485.000   |    |
|                              | AFLAC INC                     | 21,650  | 36.640        | 793,256.000   |    |
|                              | DARDEN RESTAURANTS INC        | 4,150   | 75.940        | 315,151.000   |    |
|                              | LIVE NATION ENTERTAINMENT IN  | 5,050   | 49.120        | 248,056.000   |    |
|                              | ADOBE INC                     | 15,350  | 406.540       | 6,240,389.000 |    |
|                              | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC    | 7,050   | 29.400        | 207,270.000   |    |
|                              | LULULEMON ATHLETICA INC       | 3,990   | 296.360       | 1,182,476.400 |    |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    | 14,400                        | 12.200  | 175,680.000   |               |    |
| GARMIN LTD                   | 4,650                         | 91.670  | 426,265.500   |               |    |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 7,110                         | 235.040 | 1,671,134.400 |               |    |

|                                 |         |           |                |  |
|---------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC     | 22,750  | 144.510   | 3,287,602.500  |  |
| WR BERKLEY CORP                 | 4,575   | 57.020    | 260,866.500    |  |
| AUTOZONE INC                    | 740     | 1,100.510 | 814,377.400    |  |
| DOLLAR TREE INC                 | 7,421   | 87.770    | 651,341.170    |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR      | 36,650  | 11.250    | 412,312.500    |  |
| PINNACLE WEST CAPITAL           | 3,500   | 75.600    | 264,600.000    |  |
| CELANESE CORP                   | 3,750   | 88.520    | 331,950.000    |  |
| DR HORTON INC                   | 10,816  | 54.000    | 584,064.000    |  |
| DENTSPLY SIRONA INC             | 7,000   | 43.380    | 303,660.000    |  |
| AUTODESK INC                    | 6,980   | 222.960   | 1,556,260.800  |  |
| MOODY'S CORP                    | 5,350   | 266.980   | 1,428,343.000  |  |
| ALBEMARLE CORP                  | 3,550   | 77.320    | 274,486.000    |  |
| ATMOS ENERGY CORP               | 4,000   | 100.430   | 401,720.000    |  |
| ALLIANT ENERGY CORP             | 7,550   | 48.550    | 366,552.500    |  |
| CITIGROUP INC                   | 66,973  | 52.250    | 3,499,339.250  |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING       | 13,870  | 147.010   | 2,039,028.700  |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER         | 15,600  | 81.800    | 1,276,080.000  |  |
| ALLEGHANY CORP                  | 480     | 504.280   | 242,054.400    |  |
| DOMINO'S PIZZA INC              | 1,200   | 378.150   | 453,780.000    |  |
| HESS CORP                       | 8,500   | 49.610    | 421,685.000    |  |
| DAVITA INC                      | 2,750   | 78.250    | 215,187.500    |  |
| DANAHER CORP                    | 19,950  | 168.380   | 3,359,181.000  |  |
| FORTIVE CORP                    | 9,850   | 63.650    | 626,952.500    |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE<br>IN | 17,550  | 93.260    | 1,636,713.000  |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO       | 17,800  | 39.430    | 701,854.000    |  |
| BUNGE LTD                       | 4,450   | 39.390    | 175,285.500    |  |
| TE CONNECTIVITY LTD             | 10,675  | 78.590    | 838,948.250    |  |
| APPLE INC                       | 139,200 | 338.800   | 47,160,960.000 |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES     | 9,700   | 52.990    | 514,003.000    |  |
| BOEING CO/THE                   | 17,060  | 189.510   | 3,233,040.600  |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP       | 4,765   | 61.030    | 290,807.950    |  |
| BECTON DICKINSON AND CO         | 8,719   | 230.880   | 2,013,042.720  |  |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR      | 6,700   | 17.800    | 119,260.000    |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC             | 4,350   | 98.910    | 430,258.500    |  |
| CDK GLOBAL INC                  | 4,000   | 41.470    | 165,880.000    |  |
| NISOURCE INC                    | 11,800  | 23.260    | 274,468.000    |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC     | 4,200   | 77.730    | 326,466.000    |  |

|                                 |         |         |               |  |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| BANK OF NEW YORK MELLON<br>CORP | 25,221  | 38.440  | 969,495.240   |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC      | 131,704 | 56.530  | 7,445,227.120 |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B     | 44,150  | 181.210 | 8,000,421.500 |  |
| ANSYS INC                       | 2,780   | 270.270 | 751,350.600   |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP           | 43,117  | 39.470  | 1,701,827.990 |  |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A      | 21,700  | 55.730  | 1,209,341.000 |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO         | 71,850  | 56.170  | 4,035,814.500 |  |
| JPMORGAN CHASE & CO             | 98,070  | 99.870  | 9,794,250.900 |  |
| T ROWE PRICE GROUP INC          | 7,350   | 120.930 | 888,835.500   |  |
| LKQ CORP                        | 9,150   | 25.885  | 236,847.750   |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD      | 1,480   | 183.460 | 271,520.800   |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B       | 10,062  | 65.250  | 656,545.500   |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC          | 9,050   | 89.460  | 809,613.000   |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC        | 3,860   | 146.640 | 566,030.400   |  |
| DOLLAR GENERAL CORP             | 8,100   | 184.000 | 1,490,400.000 |  |
| SERVICENOW INC                  | 6,080   | 385.130 | 2,341,590.400 |  |
| CATERPILLAR INC                 | 17,650  | 123.150 | 2,173,597.500 |  |
| BROWN & BROWN INC               | 7,450   | 40.670  | 302,991.500   |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC         | 7,300   | 43.970  | 320,981.000   |  |
| CMS ENERGY CORP                 | 9,300   | 58.300  | 542,190.000   |  |
| MOSAIC CO/THE                   | 10,950  | 13.280  | 145,416.000   |  |
| DELTA AIR LINES INC             | 5,150   | 30.430  | 156,714.500   |  |
| CORNING INC                     | 24,600  | 26.930  | 662,478.000   |  |
| CISCO SYSTEMS INC               | 135,250 | 45.070  | 6,095,717.500 |  |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC       | 4,200   | 58.370  | 245,154.000   |  |
| MORGAN STANLEY                  | 38,100  | 46.280  | 1,763,268.000 |  |
| MSCI INC                        | 2,700   | 320.950 | 866,565.000   |  |
| FAIR ISAAC CORP                 | 950     | 413.520 | 392,844.000   |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC        | 1,100   | 218.990 | 240,889.000   |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS      | 7,100   | 56.650  | 402,215.000   |  |
| BROADCOM INC                    | 12,772  | 300.250 | 3,834,793.000 |  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC     | 3,580   | 125.390 | 448,896.200   |  |
| ARAMARK                         | 7,200   | 25.300  | 182,160.000   |  |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD      | 7,250   | 22.190  | 160,877.500   |  |
| DTE ENERGY COMPANY              | 6,250   | 105.070 | 656,687.500   |  |
| CENTENE CORP                    | 18,387  | 61.940  | 1,138,890.780 |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC         | 3,500   | 99.900  | 349,650.000   |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP        | 13,450  | 25.820  | 347,279.000   |  |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| ARTHUR J GALLAGHER & CO         | 6,150  | 95.320    | 586,218.000   |  |
| GARTNER INC                     | 2,920  | 118.730   | 346,691.600   |  |
| SPLUNK INC                      | 5,030  | 178.880   | 899,766.400   |  |
| DOMINION ENERGY INC             | 26,841 | 83.150    | 2,231,829.150 |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP           | 12,850 | 68.300    | 877,655.000   |  |
| SMITH (A.O.) CORP               | 4,250  | 46.950    | 199,537.500   |  |
| DEERE & CO                      | 9,450  | 154.970   | 1,464,466.500 |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC             | 9,634  | 178.580   | 1,720,439.720 |  |
| VMWARE INC-CLASS A              | 2,680  | 135.850   | 364,078.000   |  |
| CABLE ONE INC                   | 150    | 1,725.680 | 258,852.000   |  |
| BURLINGTON STORES INC           | 2,050  | 203.530   | 417,236.500   |  |
| NASDAQ INC                      | 3,700  | 115.150   | 426,055.000   |  |
| VAIL RESORTS INC                | 1,360  | 184.200   | 250,512.000   |  |
| EAST WEST BANCORP INC           | 4,600  | 36.520    | 167,992.000   |  |
| REINSURANCE GROUP OF<br>AMERICA | 1,950  | 87.980    | 171,561.000   |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP<br>INC | 2,430  | 62.330    | 151,461.900   |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC         | 10,550 | 75.380    | 795,259.000   |  |
| COGNEX CORP                     | 5,500  | 55.160    | 303,380.000   |  |
| TELEFLEX INC                    | 1,500  | 352.250   | 528,375.000   |  |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC     | 2,800  | 114.100   | 319,480.000   |  |
| WEST PHARMACEUTICAL<br>SERVICES | 2,400  | 200.730   | 481,752.000   |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A          | 710    | 448.850   | 318,683.500   |  |
| CATALENT INC                    | 4,850  | 69.570    | 337,414.500   |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A       | 4,280  | 216.680   | 927,390.400   |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC           | 2,000  | 169.890   | 339,780.000   |  |
| IDEX CORP                       | 2,400  | 152.590   | 366,216.000   |  |
| COLGATE-PALMOLIVE CO            | 26,100 | 72.790    | 1,899,819.000 |  |
| ROLLINS INC                     | 4,925  | 41.410    | 203,944.250   |  |
| AMETEK INC                      | 7,425  | 87.660    | 650,875.500   |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC          | 7,800  | 73.080    | 570,024.000   |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION     | 4,350  | 38.970    | 169,519.500   |  |
| HEICO CORP                      | 1,400  | 109.490   | 153,286.000   |  |
| XPO LOGISTICS INC               | 2,800  | 74.840    | 209,552.000   |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS<br>INC | 1,240  | 286.980   | 355,855.200   |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A        | 8,600  | 66.610    | 572,846.000   |  |

|                                 |         |         |               |  |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| TYLER TECHNOLOGIES INC          | 1,220   | 342.710 | 418,106.200   |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP           | 14,050  | 298.700 | 4,196,735.000 |  |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC          | 2,600   | 103.650 | 269,490.000   |  |
| EPAM SYSTEMS INC                | 1,800   | 235.000 | 423,000.000   |  |
| RPM INTERNATIONAL INC           | 4,100   | 73.390  | 300,899.000   |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC      | 850     | 991.830 | 843,055.500   |  |
| UGI CORP                        | 7,050   | 31.030  | 218,761.500   |  |
| CUMMINS INC                     | 4,850   | 167.080 | 810,338.000   |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC         | 24,700  | 71.680  | 1,770,496.000 |  |
| CDW CORP/DE                     | 4,650   | 114.100 | 530,565.000   |  |
| SIGNATURE BANK                  | 1,650   | 107.880 | 178,002.000   |  |
| COSTAR GROUP INC                | 1,170   | 668.090 | 781,665.300   |  |
| SVB FINANCIAL GROUP             | 1,610   | 208.530 | 335,733.300   |  |
| AMERCO                          | 290     | 314.890 | 91,318.100    |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE       | 3,000   | 157.880 | 473,640.000   |  |
| MERCADOLIBRE INC                | 1,440   | 896.430 | 1,290,859.200 |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC     | 2,500   | 172.250 | 430,625.000   |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS<br>IN | 9,016   | 77.450  | 698,289.200   |  |
| IPG PHOTONICS CORP              | 1,170   | 156.140 | 182,683.800   |  |
| DEXCOM INC                      | 2,900   | 370.230 | 1,073,667.000 |  |
| NORDSON CORP                    | 1,730   | 185.680 | 321,226.400   |  |
| COPART INC                      | 6,850   | 85.040  | 582,524.000   |  |
| DIAMONDBACK ENERGY INC          | 5,150   | 46.960  | 241,844.000   |  |
| SEATTLE GENETICS INC            | 3,750   | 151.160 | 566,850.000   |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC            | 2,420   | 251.400 | 608,388.000   |  |
| TRANSDIGM GROUP INC             | 1,650   | 447.390 | 738,193.500   |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC      | 2,800   | 114.820 | 321,496.000   |  |
| NIELSEN HOLDINGS PLC            | 11,100  | 15.120  | 167,832.000   |  |
| KINDER MORGAN INC               | 64,681  | 15.500  | 1,002,555.500 |  |
| HCA HEALTHCARE INC              | 8,600   | 100.550 | 864,730.000   |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC        | 1,220   | 492.790 | 601,203.800   |  |
| CABOT OIL & GAS CORP            | 12,400  | 20.070  | 248,868.000   |  |
| T-MOBILE US INC                 | 13,471  | 102.310 | 1,378,218.010 |  |
| ZILLOW GROUP INC - C            | 4,550   | 56.790  | 258,394.500   |  |
| COCA-COLA CO/THE                | 129,850 | 45.600  | 5,921,160.000 |  |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS     | 6,500   | 38.150  | 247,975.000   |  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC        | 5,250   | 73.570  | 386,242.500   |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC          | 9,500   | 21.790  | 207,005.000   |  |

|                                 |         |           |                |  |
|---------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| CSX CORP                        | 24,850  | 69.570    | 1,728,814.500  |  |
| LABORATORY CRP OF AMER<br>HLDGS | 3,130   | 167.730   | 524,994.900    |  |
| EXPEDIA GROUP INC               | 4,375   | 82.520    | 361,025.000    |  |
| AUTOLIV INC                     | 2,750   | 63.140    | 173,635.000    |  |
| AMAZON.COM INC                  | 13,460  | 2,545.020 | 34,255,969.200 |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP       | 19,740  | 67.980    | 1,341,925.200  |  |
| EXXON MOBIL CORP                | 135,005 | 47.170    | 6,368,185.850  |  |
| FLIR SYSTEMS INC                | 4,200   | 41.260    | 173,292.000    |  |
| AES CORP                        | 21,900  | 12.670    | 277,473.000    |  |
| EVEREST RE GROUP LTD            | 1,350   | 214.950   | 290,182.500    |  |
| EOG RESOURCES INC               | 18,550  | 52.570    | 975,173.500    |  |
| AKAMA I TECHNOLOGIES INC        | 5,200   | 100.340   | 521,768.000    |  |
| ABIOMED INC                     | 1,440   | 241.680   | 348,019.200    |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP          | 4,950   | 94.870    | 469,606.500    |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC        | 9,790   | 86.110    | 843,016.900    |  |
| FORD MOTOR CO                   | 123,123 | 6.460     | 795,374.580    |  |
| DISCOVERY INC - A               | 4,690   | 22.070    | 103,508.300    |  |
| EXACT SCIENCES CORP             | 4,600   | 85.370    | 392,702.000    |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A            | 4,887   | 22.335    | 109,151.140    |  |
| LIBERTY BROADBAND-A             | 850     | 127.330   | 108,230.500    |  |
| DISCOVERY INC-C                 | 10,389  | 19.700    | 204,663.300    |  |
| AERCAP HOLDINGS NV              | 4,000   | 34.250    | 137,000.000    |  |
| FORTINET INC                    | 4,600   | 130.340   | 599,564.000    |  |
| MARKEL CORP                     | 440     | 949.950   | 417,978.000    |  |
| NEXTERA ENERGY INC              | 15,600  | 246.910   | 3,851,796.000  |  |
| MASIMO CORP                     | 1,700   | 217.390   | 369,563.000    |  |
| FREEMPORT-MCMORAN INC           | 47,208  | 10.490    | 495,211.920    |  |
| INSULET CORP                    | 1,950   | 180.560   | 352,092.000    |  |
| US BANCORP                      | 43,500  | 37.510    | 1,631,685.000  |  |
| UNITED RENTALS INC              | 2,350   | 143.490   | 337,201.500    |  |
| F5 NETWORKS INC                 | 1,900   | 140.320   | 266,608.000    |  |
| FASTENAL CO                     | 18,600  | 40.060    | 745,116.000    |  |
| FISERV INC                      | 18,583  | 100.340   | 1,864,618.220  |  |
| GENERAL ELECTRIC CO             | 280,550 | 7.250     | 2,033,987.500  |  |
| GENERAL MOTORS CO               | 40,600  | 27.960    | 1,135,176.000  |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP           | 7,750   | 149.200   | 1,156,300.000  |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC         | 10,540  | 201.780   | 2,126,761.200  |  |
| ALPHABET INC-CL A               | 9,560   | 1,412.920 | 13,507,515.200 |  |

|                                  |        |           |                |  |
|----------------------------------|--------|-----------|----------------|--|
| ALPHABET INC-CL C                | 9,787  | 1,413.180 | 13,830,792.660 |  |
| OWENS CORNING                    | 3,350  | 52.720    | 176,612.000    |  |
| GENERAL MILLS INC                | 19,150 | 60.150    | 1,151,872.500  |  |
| FIRSTENERGY CORP                 | 17,168 | 40.430    | 694,102.240    |  |
| GENUINE PARTS CO                 | 4,550  | 85.590    | 389,434.500    |  |
| IHS MARKIT LTD                   | 12,134 | 69.810    | 847,074.540    |  |
| FIFTH THIRD BANCORP              | 23,000 | 20.805    | 478,515.000    |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC        | 6,960  | 193.150   | 1,344,324.000  |  |
| HALLIBURTON CO                   | 27,600 | 12.780    | 352,728.000    |  |
| HOME DEPOT INC                   | 34,800 | 242.450   | 8,437,260.000  |  |
| ASSURANT INC                     | 1,900  | 107.030   | 203,357.000    |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC        | 31,800 | 9.885     | 314,343.000    |  |
| HUNTINGTON INGALLS<br>INDUSTRIE  | 1,290  | 182.290   | 235,154.100    |  |
| HERSHEY CO/THE                   | 4,740  | 129.110   | 611,981.400    |  |
| HUMANA INC                       | 4,250  | 378.720   | 1,609,560.000  |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV            | 9,000  | 106.170   | 955,530.000    |  |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A          | 2,260  | 261.880   | 591,848.800    |  |
| HENRY SCHEIN INC                 | 4,500  | 56.630    | 254,835.000    |  |
| HP INC                           | 45,300 | 16.280    | 737,484.000    |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE       | 41,900 | 10.150    | 425,285.000    |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM<br>C  | 5,978  | 35.360    | 211,382.080    |  |
| HOLLYFRONTIER CORP               | 4,700  | 31.380    | 147,486.000    |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-<br>C | 6,500  | 36.290    | 235,885.000    |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM<br>A  | 2,950  | 35.790    | 105,580.500    |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD           | 13,200 | 30.610    | 404,052.000    |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE               | 21,753 | 31.800    | 691,745.400    |  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP      | 28,400 | 121.910   | 3,462,244.000  |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO           | 11,500 | 34.920    | 401,580.000    |  |
| FORTUNE BRANDS HOME &<br>SECURI  | 4,350  | 58.400    | 254,040.000    |  |
| ZOETIS INC                       | 15,250 | 134.070   | 2,044,567.500  |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC           | 7,579  | 90.390    | 685,065.810    |  |
| CHENIERE ENERGY INC              | 7,150  | 46.100    | 329,615.000    |  |
| ALLEGION PLC                     | 2,900  | 102.410   | 296,989.000    |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C            | 12,973 | 21.770    | 282,422.210    |  |

|                              |        |         |                |  |
|------------------------------|--------|---------|----------------|--|
| WASTE CONNECTIONS INC        | 8,507  | 90.210  | 767,416.470    |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 10,500 | 23.890  | 250,845.000    |  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC     | 2,400  | 158.850 | 381,240.000    |  |
| JM SMUCKER CO/THE            | 3,670  | 104.700 | 384,249.000    |  |
| JOHNSON & JOHNSON            | 84,000 | 142.150 | 11,940,600.000 |  |
| ABBVIE INC                   | 56,072 | 92.460  | 5,184,417.120  |  |
| HOLOGIC INC                  | 8,350  | 50.150  | 418,752.500    |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 11,000 | 135.940 | 1,495,340.000  |  |
| KROGER CO                    | 25,500 | 32.260  | 822,630.000    |  |
| KLA CORP                     | 5,030  | 184.690 | 928,990.700    |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 8,080  | 381.870 | 3,085,509.600  |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC    | 2,680  | 258.990 | 694,093.200    |  |
| LOWE'S COS INC               | 24,450 | 126.050 | 3,081,922.500  |  |
| ELI LILLY & CO               | 27,405 | 143.540 | 3,933,713.700  |  |
| LAM RESEARCH CORP            | 4,590  | 284.520 | 1,305,946.800  |  |
| JONES LANG LASALLE INC       | 1,650  | 109.170 | 180,130.500    |  |
| LOEWS CORP                   | 8,300  | 33.020  | 274,066.000    |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 6,249  | 40.680  | 254,209.320    |  |
| MCDONALD'S CORP              | 23,750 | 189.170 | 4,492,787.500  |  |
| 3M CO                        | 18,350 | 154.870 | 2,841,864.500  |  |
| FACEBOOK INC-CLASS A         | 76,600 | 228.580 | 17,509,228.000 |  |
| S&P GLOBAL INC               | 7,800  | 316.910 | 2,471,898.000  |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS    | 1,960  | 197.050 | 386,218.000    |  |
| CONCHO RESOURCES INC         | 6,200  | 58.000  | 359,600.000    |  |
| PHILLIPS 66                  | 14,150 | 77.260  | 1,093,229.000  |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 15,250 | 19.170  | 292,342.500    |  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 3,850  | 166.540 | 641,179.000    |  |
| MYLAN NV                     | 16,050 | 15.940  | 255,837.000    |  |
| METLIFE INC                  | 24,800 | 37.450  | 928,760.000    |  |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 21,700 | 33.730  | 731,941.000    |  |
| ARISTA NETWORKS INC          | 1,870  | 222.780 | 416,598.600    |  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 4,800  | 31.000  | 148,800.000    |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 5,458  | 140.600 | 767,394.800    |  |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 780    | 764.420 | 596,247.600    |  |
| BAKER HUGHES CO              | 21,373 | 15.940  | 340,685.620    |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 3,760  | 208.190 | 782,794.400    |  |
| MERCK & CO. INC.             | 80,821 | 76.300  | 6,166,642.300  |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| DUPONT DE NEMOURS INC           | 23,468 | 51.010  | 1,197,102.680 |  |
| MASCO CORP                      | 8,700  | 45.790  | 398,373.000   |  |
| M & T BANK CORP                 | 4,039  | 108.960 | 440,089.440   |  |
| MARSH & MCLENNAN COS            | 15,850 | 104.340 | 1,653,789.000 |  |
| BLACK KNIGHT INC                | 4,700  | 72.100  | 338,870.000   |  |
| HEICO CORP-CLASS A              | 2,200  | 91.320  | 200,904.000   |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL<br>A | 8,772  | 92.260  | 809,304.720   |  |
| WORKDAY INC-CLASS A             | 5,380  | 173.550 | 933,699.000   |  |
| WAYFAIR INC- CLASS A            | 2,100  | 184.760 | 387,996.000   |  |
| SQUARE INC - A                  | 11,100 | 86.720  | 962,592.000   |  |
| TRANSUNION                      | 6,150  | 87.910  | 540,646.500   |  |
| VISTRA ENERGY CORP              | 14,250 | 20.200  | 287,850.000   |  |
| BEIGENE LTD-ADR                 | 1,250  | 163.920 | 204,900.000   |  |
| NETAPP INC                      | 6,900  | 42.460  | 292,974.000   |  |
| NIKE INC -CL B                  | 39,650 | 96.430  | 3,823,449.500 |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP           | 8,200  | 178.180 | 1,461,076.000 |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC        | 7,750  | 99.630  | 772,132.500   |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC     | 4,150  | 71.600  | 297,140.000   |  |
| ALLY FINANCIAL INC              | 11,650 | 20.440  | 238,126.000   |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP           | 5,120  | 317.680 | 1,626,521.600 |  |
| APTIV PLC                       | 8,100  | 75.660  | 612,846.000   |  |
| NEWMONT CORP                    | 25,861 | 55.450  | 1,433,992.450 |  |
| MCKESSON CORP                   | 5,100  | 148.250 | 756,075.000   |  |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS       | 8,700  | 57.150  | 497,205.000   |  |
| XYLEM INC                       | 5,870  | 64.160  | 376,619.200   |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL     | 49,600 | 70.420  | 3,492,832.000 |  |
| NUCOR CORP                      | 9,400  | 41.200  | 387,280.000   |  |
| WESTERN UNION CO                | 12,946 | 22.520  | 291,543.920   |  |
| GODADDY INC - CLASS A           | 5,700  | 76.260  | 434,682.000   |  |
| NEWELL BRANDS INC               | 12,542 | 15.300  | 191,892.600   |  |
| EVERGY INC                      | 7,400  | 60.080  | 444,592.000   |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP       | 28,124 | 18.500  | 520,294.000   |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A     | 820    | 177.740 | 145,746.800   |  |
| OKTA INC                        | 3,660  | 179.240 | 656,018.400   |  |
| COUPA SOFTWARE INC              | 2,050  | 224.010 | 459,220.500   |  |
| LIBERTY BROADBAND-C             | 3,350  | 128.480 | 430,408.000   |  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC        | 12,405 | 22.070  | 273,778.350   |  |
| LINDE PLC                       | 16,996 | 201.940 | 3,432,172.240 |  |

|                                 |         |           |               |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|
| WIX.COM LTD                     | 1,700   | 216.060   | 367,302.000   |
| EQUITABLE HOLDINGS INC          | 13,300  | 20.600    | 273,980.000   |
| KKR & CO INC                    | 16,300  | 29.150    | 475,145.000   |
| PAYCHEX INC                     | 10,250  | 73.760    | 756,040.000   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC         | 2,410   | 410.350   | 988,943.500   |
| ALTRIA GROUP INC                | 59,600  | 39.130    | 2,332,148.000 |
| PFIZER INC                      | 176,513 | 33.750    | 5,957,313.750 |
| CIGNA CORP                      | 11,910  | 190.020   | 2,263,138.200 |
| DELL TECHNOLOGIES -C            | 7,851   | 46.900    | 368,211.900   |
| ALTICE USA INC- A               | 10,900  | 24.060    | 262,254.000   |
| XCEL ENERGY INC                 | 16,550  | 63.650    | 1,053,407.500 |
| STERIS PLC                      | 2,650   | 151.820   | 402,323.000   |
| FOX CORP - CLASS B              | 5,433   | 27.950    | 151,852.350   |
| FOX CORP - CLASS A              | 10,849  | 28.290    | 306,918.210   |
| STRYKER CORP                    | 10,820  | 187.790   | 2,031,887.800 |
| DOW INC                         | 23,468  | 41.230    | 967,585.640   |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS<br>A | 2,800   | 62.530    | 175,084.000   |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A     | 3,430   | 219.520   | 752,953.600   |
| PARKER HANNIFIN CORP            | 4,170   | 180.160   | 751,267.200   |
| UBER TECHNOLOGIES INC           | 30,700  | 32.240    | 989,768.000   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES<br>CO | 5,350   | 98.230    | 525,530.500   |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE         | 78,717  | 115.620   | 9,101,259.540 |
| EXELON CORP                     | 30,772  | 37.910    | 1,166,566.520 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC     | 7,050   | 109.300   | 770,565.000   |
| TELADOC HEALTH INC              | 2,300   | 172.270   | 396,221.000   |
| INGERSOLL-RAND INC              | 11,358  | 31.220    | 354,596.760   |
| NVR INC                         | 110     | 3,175.370 | 349,290.700   |
| CONOCOPHILLIPS                  | 34,700  | 43.730    | 1,517,431.000 |
| TWILIO INC - A                  | 3,850   | 191.890   | 738,776.500   |
| DOCUSIGN INC                    | 5,350   | 150.600   | 805,710.000   |
| PAYCOM SOFTWARE INC             | 1,610   | 302.800   | 487,508.000   |
| MATCH GROUP INC                 | 1,800   | 87.250    | 157,050.000   |
| PEPSICO INC                     | 44,300  | 129.000   | 5,714,700.000 |
| CYBERARK SOFTWARE<br>LTD/ISRAEL | 1,300   | 98.120    | 127,556.000   |
| DROPBOX INC-CLASS A             | 8,000   | 21.030    | 168,240.000   |
| MONGODB INC                     | 1,500   | 193.670   | 290,505.000   |

|                              |        |           |               |  |
|------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| SNAP INC - A                 | 28,300 | 20.180    | 571,094.000   |  |
| CORTEVA INC                  | 23,968 | 27.540    | 660,078.720   |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 12,800 | 63.160    | 808,448.000   |  |
| AMCOR PLC                    | 50,100 | 9.810     | 491,481.000   |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 3,250  | 93.120    | 302,640.000   |  |
| ROKU INC                     | 3,050  | 108.070   | 329,613.500   |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 5,750  | 127.290   | 731,917.500   |  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 20,230 | 201.590   | 4,078,165.700 |  |
| SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A | 10,200 | 30.860    | 314,772.000   |  |
| PENTAIR PLC                  | 5,505  | 37.500    | 206,437.500   |  |
| QUALCOMM INC                 | 36,450 | 85.240    | 3,106,998.000 |  |
| INVESCO LTD                  | 12,000 | 10.340    | 124,080.000   |  |
| ADVANCE AUTO PARTS INC       | 2,200  | 135.730   | 298,606.000   |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 8,650  | 41.880    | 362,262.000   |  |
| DATADOG INC - CLASS A        | 3,500  | 78.050    | 273,175.000   |  |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 11,900 | 20.890    | 248,591.000   |  |
| AVALARA INC                  | 2,500  | 105.950   | 264,875.000   |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 3,190  | 588.390   | 1,876,964.100 |  |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 7,100  | 81.730    | 580,283.000   |  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 1,310  | 1,623.920 | 2,127,335.200 |  |
| ROSS STORES INC              | 11,450 | 92.480    | 1,058,896.000 |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 3,100  | 98.920    | 306,652.000   |  |
| RESMED INC                   | 4,700  | 160.690   | 755,243.000   |  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 4,350  | 110.600   | 481,110.000   |  |
| ROBERT HALF INTL INC         | 3,600  | 51.290    | 184,644.000   |  |
| MODERNA INC                  | 7,000  | 62.000    | 434,000.000   |  |
| RALPH LAUREN CORP            | 1,450  | 74.770    | 108,416.500   |  |
| PERKINELMER INC              | 3,550  | 97.140    | 344,847.000   |  |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 26,637 | 21.540    | 573,760.980   |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 13,268 | 56.040    | 743,538.720   |  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 5,800  | 49.220    | 285,476.000   |  |
| AVANTOR INC                  | 13,500 | 16.980    | 229,230.000   |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 4,700  | 29.380    | 138,086.000   |  |
| DYNATRACE INC                | 4,300  | 35.890    | 154,327.000   |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 1,270  | 354.510   | 450,227.700   |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 30,235 | 11.900    | 359,796.500   |  |

|                                  |         |         |               |  |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| CHEVRON CORP                     | 59,818  | 92.390  | 5,526,585.020 |  |
| EDISON INTERNATIONAL             | 11,450  | 57.570  | 659,176.500   |  |
| TESLA INC                        | 4,700   | 935.280 | 4,395,816.000 |  |
| NORTONLIFELOCK INC               | 17,850  | 19.850  | 354,322.500   |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC       | 5,022   | 131.090 | 658,333.980   |  |
| SYNOPSYS INC                     | 4,700   | 179.600 | 844,120.000   |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-<br>A | 4,685   | 522.570 | 2,448,240.450 |  |
| CBRE GROUP INC - A               | 10,850  | 47.570  | 516,134.500   |  |
| TWITTER INC                      | 25,250  | 33.400  | 843,350.000   |  |
| SOUTHERN CO/THE                  | 33,850  | 56.170  | 1,901,354.500 |  |
| SYSCO CORP                       | 15,400  | 54.260  | 835,604.000   |  |
| TRAVELERS COS INC/THE            | 8,153   | 113.330 | 923,979.490   |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY          | 4,300   | 56.290  | 242,047.000   |  |
| STEEL DYNAMICS INC               | 6,600   | 26.420  | 174,372.000   |  |
| SCHLUMBERGER LTD                 | 44,302  | 19.000  | 841,738.000   |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES<br>HOLDING  | 5,050   | 37.060  | 187,153.000   |  |
| AT&T INC                         | 228,791 | 30.500  | 6,978,125.500 |  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO            | 4,700   | 35.870  | 168,589.000   |  |
| ON SEMICONDUCTOR CORP            | 12,900  | 18.990  | 244,971.000   |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE          | 2,630   | 547.620 | 1,440,240.600 |  |
| SEMPRA ENERGY                    | 9,420   | 124.050 | 1,168,551.000 |  |
| TIFFANY & CO                     | 3,470   | 119.120 | 413,346.400   |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY               | 7,650   | 50.610  | 387,166.500   |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC            | 29,750  | 123.970 | 3,688,107.500 |  |
| SALESFORCE.COM INC               | 26,821  | 175.110 | 4,696,625.310 |  |
| WESTROCK CO                      | 8,530   | 28.210  | 240,631.300   |  |
| JOHNSON CONTROLS<br>INTERNATION  | 24,484  | 34.450  | 843,473.800   |  |
| TERADYNE INC                     | 5,500   | 71.750  | 394,625.000   |  |
| UNION PACIFIC CORP               | 21,980  | 166.180 | 3,652,636.400 |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP          | 20,588  | 36.620  | 753,932.560   |  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP       | 48,329  | 65.370  | 3,159,266.730 |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B       | 22,550  | 101.480 | 2,288,374.000 |  |
| IQVIA HOLDINGS INC               | 6,244   | 138.820 | 866,792.080   |  |
| VOYA FINANCIAL INC               | 4,350   | 47.860  | 208,191.000   |  |
| AMEREN CORPORATION               | 8,050   | 71.750  | 577,587.500   |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC           | 30,226  | 285.150 | 8,618,943.900 |  |

|                                 |         |         |                |  |
|---------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| VERISIGN INC                    | 3,370   | 204.170 | 688,052.900    |  |
| VALERO ENERGY CORP              | 13,142  | 63.790  | 838,328.180    |  |
| ULTA BEAUTY INC                 | 1,760   | 226.630 | 398,868.800    |  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL     | 8,688   | 31.870  | 276,886.560    |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B     | 2,500   | 95.580  | 238,950.000    |  |
| ANTHEM INC                      | 8,100   | 265.740 | 2,152,494.000  |  |
| WALT DISNEY CO/THE              | 57,562  | 115.490 | 6,647,835.380  |  |
| WELLS FARGO & CO                | 123,822 | 27.970  | 3,463,301.340  |  |
| WASTE MANAGEMENT INC            | 13,400  | 103.890 | 1,392,126.000  |  |
| WILLIAMS COS INC                | 38,900  | 18.230  | 709,147.000    |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY          | 3,700   | 118.450 | 438,265.000    |  |
| WHIRLPOOL CORP                  | 1,950   | 122.100 | 238,095.000    |  |
| WALMART INC                     | 45,200  | 117.740 | 5,321,848.000  |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC      | 6,550   | 125.190 | 819,994.500    |  |
| WYNN RESORTS LTD                | 3,050   | 92.305  | 281,530.250    |  |
| WABTEC CORP                     | 5,861   | 60.890  | 356,876.290    |  |
| TJX COMPANIES INC               | 38,650  | 52.460  | 2,027,579.000  |  |
| WATERS CORP                     | 2,050   | 185.560 | 380,398.000    |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL<br>A | 1,760   | 258.330 | 454,660.800    |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE<br>INC | 23,900  | 41.400  | 989,460.000    |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC        | 4,173   | 186.770 | 779,391.210    |  |
| WESTERN DIGITAL CORP            | 9,750   | 42.950  | 418,762.500    |  |
| WEC ENERGY GROUP INC            | 9,980   | 90.310  | 901,293.800    |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE<br>GP | 16,100  | 49.710  | 800,331.000    |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES         | 54,400  | 192.260 | 10,458,944.000 |  |
| PPL CORP                        | 24,800  | 26.550  | 658,440.000    |  |
| PULTEGROUP INC                  | 8,900   | 33.890  | 301,621.000    |  |
| PPG INDUSTRIES INC              | 7,650   | 101.630 | 777,469.500    |  |
| NORTHERN TRUST CORP             | 6,400   | 83.610  | 535,104.000    |  |
| NVIDIA CORP                     | 19,500  | 357.300 | 6,967,350.000  |  |
| IAC/INTERACTIVECORP             | 2,530   | 274.300 | 693,979.000    |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES<br>GROUP | 13,843  | 110.760 | 1,533,250.680  |  |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC          | 5,300   | 34.290  | 181,737.000    |  |
| TYSON FOODS INC-CL A            | 9,400   | 62.200  | 584,680.000    |  |
| NETFLIX INC                     | 13,970  | 418.070 | 5,840,437.900  |  |

|                                  |         |         |               |  |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| THERMO FISHER SCIENTIFIC<br>INC  | 12,690  | 339.760 | 4,311,554.400 |  |
| NRG ENERGY INC                   | 7,950   | 33.680  | 267,756.000   |  |
| GLOBE LIFE INC                   | 3,225   | 75.900  | 244,777.500   |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA           | 5,400   | 106.700 | 576,180.000   |  |
| TEXTRON INC                      | 7,150   | 34.150  | 244,172.500   |  |
| NEWS CORP - CLASS A              | 11,737  | 11.720  | 137,557.640   |  |
| OGE ENERGY CORP                  | 6,750   | 30.860  | 208,305.000   |  |
| OMNICOM GROUP                    | 6,750   | 55.030  | 371,452.500   |  |
| ORACLE CORP                      | 71,283  | 51.860  | 3,696,736.380 |  |
| MASTERCARD INC - A               | 28,550  | 297.790 | 8,501,904.500 |  |
| ONEOK INC                        | 13,000  | 34.090  | 443,170.000   |  |
| CENTURYLINK INC                  | 28,852  | 10.080  | 290,828.160   |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC           | 3,420   | 389.810 | 1,333,150.200 |  |
| YUM! BRANDS INC                  | 9,550   | 91.280  | 871,724.000   |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE<br>SOFTWARE | 3,550   | 134.000 | 475,700.000   |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO -<br>B  | 6,050   | 38.050  | 230,202.500   |  |
| BANK OF AMERICA CORP             | 250,101 | 24.780  | 6,197,502.780 |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC        | 1,130   | 333.540 | 376,900.200   |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC      | 5,850   | 105.720 | 618,462.000   |  |
| AMERICAN EXPRESS CO              | 21,900  | 101.680 | 2,226,792.000 |  |
| ANALOG DEVICES INC               | 11,649  | 118.410 | 1,379,358.090 |  |
| ADVANCED MICRO DEVICES           | 37,600  | 53.500  | 2,011,600.000 |  |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP       | 8,850   | 39.280  | 347,628.000   |  |
| AMERICAN INTERNATIONAL<br>GROUP  | 27,572  | 33.040  | 910,978.880   |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC           | 5,500   | 126.910 | 698,005.000   |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD      | 5,500   | 61.180  | 336,490.000   |  |
| AVERY DENNISON CORP              | 2,750   | 113.500 | 312,125.000   |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A       | 17,400  | 54.800  | 953,520.000   |  |
| EMERSON ELECTRIC CO              | 19,700  | 61.350  | 1,208,595.000 |  |
| AON PLC-CLASS A                  | 7,370   | 181.950 | 1,340,971.500 |  |
| AMGEN INC                        | 18,800  | 217.900 | 4,096,520.000 |  |
| EATON CORP PLC                   | 13,086  | 86.010  | 1,125,526.860 |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A       | 5,330   | 170.280 | 907,592.400   |  |
| APPLIED MATERIALS INC            | 29,100  | 56.550  | 1,645,605.000 |  |
| CME GROUP INC                    | 11,500  | 174.720 | 2,009,280.000 |  |

|                                 |         |         |               |  |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| NATIONAL OILWELL VARCO INC      | 11,694  | 12.770  | 149,332.380   |  |
| ECOLAB INC                      | 8,100   | 204.060 | 1,652,886.000 |  |
| EQUIFAX INC                     | 3,900   | 167.980 | 655,122.000   |  |
| GILEAD SCIENCES INC             | 40,250  | 73.200  | 2,946,300.000 |  |
| KEURIG DR PEPPER INC            | 11,500  | 28.120  | 323,380.000   |  |
| HORMEL FOODS CORP               | 9,600   | 46.670  | 448,032.000   |  |
| STATE STREET CORP               | 11,193  | 63.120  | 706,502.160   |  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP           | 36,400  | 36.560  | 1,330,784.000 |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC        | 16,100  | 83.970  | 1,351,917.000 |  |
| CAMPBELL SOUP CO                | 6,000   | 47.070  | 282,420.000   |  |
| CROWN HOLDINGS INC              | 4,200   | 65.230  | 273,966.000   |  |
| CARDINAL HEALTH INC             | 9,450   | 52.890  | 499,810.500   |  |
| FEDEX CORP                      | 7,850   | 132.720 | 1,041,852.000 |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP      | 14,454  | 70.630  | 1,020,886.020 |  |
| FMC CORP                        | 4,200   | 97.340  | 408,828.000   |  |
| CERNER CORP                     | 10,050  | 66.960  | 672,948.000   |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES       | 2,674   | 126.850 | 339,196.900   |  |
| CITRIX SYSTEMS INC              | 3,600   | 140.740 | 506,664.000   |  |
| INTEL CORP                      | 136,400 | 59.330  | 8,092,612.000 |  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS<br>INC | 12,400  | 17.280  | 214,272.000   |  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP     | 11,650  | 40.030  | 466,349.500   |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS             | 10,100  | 164.940 | 1,665,894.000 |  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC          | 34,600  | 5.935   | 205,351.000   |  |
| ILLUMINA INC                    | 4,720   | 341.610 | 1,612,399.200 |  |
| SEALED AIR CORP                 | 5,000   | 30.580  | 152,900.000   |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC          | 3,730   | 558.410 | 2,082,869.300 |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH       | 3,850   | 106.080 | 408,408.000   |  |
| SNAP-ON INC                     | 1,630   | 135.010 | 220,066.300   |  |
| CARMAX INC                      | 5,100   | 89.980  | 458,898.000   |  |
| COMERICA INC                    | 4,500   | 39.140  | 176,130.000   |  |
| INGREDION INC                   | 2,150   | 82.190  | 176,708.500   |  |
| DUKE ENERGY CORP                | 23,528  | 86.740  | 2,040,818.720 |  |
| TARGET CORP                     | 16,280  | 116.900 | 1,903,132.000 |  |
| DOVER CORP                      | 4,550   | 96.610  | 439,575.500   |  |
| WW GRAINGER INC                 | 1,490   | 303.750 | 452,587.500   |  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP<br>INC | 4,250   | 80.490  | 342,082.500   |  |
| CINTAS CORP                     | 2,820   | 266.200 | 750,684.000   |  |

|                              |         |         |                |  |
|------------------------------|---------|---------|----------------|--|
| CONAGRA BRANDS INC           | 15,800  | 32.410  | 512,078.000    |  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 4,750   | 64.970  | 308,607.500    |  |
| CLOROX COMPANY               | 3,950   | 205.120 | 810,224.000    |  |
| ENTERGY CORP                 | 6,350   | 96.420  | 612,267.000    |  |
| MICROSOFT CORP               | 230,000 | 187.740 | 43,180,200.000 |  |
| INCYTE CORP                  | 5,750   | 92.070  | 529,402.500    |  |
| CVS HEALTH CORP              | 41,569  | 64.150  | 2,666,651.350  |  |
| MEDTRONIC PLC                | 42,688  | 93.210  | 3,978,948.480  |  |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 34,900  | 48.690  | 1,699,281.000  |  |
| BLACKROCK INC                | 4,900   | 527.040 | 2,582,496.000  |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 15,800  | 18.000  | 284,400.000    |  |
| HASBRO INC                   | 4,050   | 74.300  | 300,915.000    |  |
| KELLOGG CO                   | 8,400   | 63.590  | 534,156.000    |  |
| KEYCORP                      | 30,600  | 13.220  | 404,532.000    |  |
| KANSAS CITY SOUTHERN         | 3,000   | 147.270 | 441,810.000    |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 46,011  | 50.730  | 2,334,138.030  |  |
| COOPER COS INC/THE           | 1,530   | 288.400 | 441,252.000    |  |
| CHUBB LTD                    | 14,519  | 125.690 | 1,824,893.110  |  |
| ARROW ELECTRONICS INC        | 2,700   | 66.200  | 178,740.000    |  |
| ALLSTATE CORP                | 10,250  | 95.700  | 980,925.000    |  |
| EBAY INC                     | 25,650  | 47.660  | 1,222,479.000  |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 35,450  | 155.260 | 5,503,967.000  |  |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 4,250   | 69.630  | 295,927.500    |  |
| XILINX INC                   | 8,000   | 90.700  | 725,600.000    |  |
| DISH NETWORK CORP-A          | 7,500   | 32.700  | 245,250.000    |  |
| ZIONS BANCORP NA             | 5,200   | 34.880  | 181,376.000    |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 7,050   | 191.380 | 1,349,229.000  |  |
| TRIMBLE INC                  | 8,250   | 41.130  | 339,322.500    |  |
| LENNAR CORP-A                | 8,600   | 59.250  | 509,550.000    |  |
| LEAR CORP                    | 1,800   | 110.290 | 198,522.000    |  |
| E*TRADE FINANCIAL CORP       | 7,000   | 47.680  | 333,760.000    |  |
| PROGRESSIVE CORP             | 18,400  | 76.600  | 1,409,440.000  |  |
| PACCAR INC                   | 11,037  | 73.170  | 807,577.290    |  |
| BIOGEN INC                   | 5,500   | 279.270 | 1,535,985.000  |  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 2,670   | 302.830 | 808,556.100    |  |
| STARBUCKS CORP               | 37,450  | 76.380  | 2,860,431.000  |  |
| PTC INC                      | 3,400   | 75.160  | 255,544.000    |  |
| PERRIGO CO PLC               | 4,200   | 51.490  | 216,258.000    |  |

|          |                                 |         |          |  |  |
|----------|---------------------------------|---------|----------|--|--|
|          | EVERSOURCE ENERGY               | 10,630  | 84.310   | 896,215.300                                    |  |
|          | INTUIT INC                      | 8,310   | 280.680  | 2,332,450.800                                  |  |
|          | BORGWARNER INC                  | 6,500   | 33.550   | 218,075.000                                    |  |
|          | BEST BUY CO INC                 | 7,300   | 77.760   | 567,648.000                                    |  |
|          | BALL CORP                       | 10,584  | 68.330   | 723,204.720                                    |  |
|          | BOSTON SCIENTIFIC CORP          | 43,897  | 35.350   | 1,551,758.950                                  |  |
|          | ELECTRONIC ARTS INC             | 9,250   | 121.970  | 1,128,222.500                                  |  |
|          | VULCAN MATERIALS CO             | 4,150   | 112.090  | 465,173.500                                    |  |
|          | VERTEX PHARMACEUTICALS INC      | 8,300   | 268.560  | 2,229,048.000                                  |  |
|          | VF CORP                         | 10,900  | 61.250   | 667,625.000                                    |  |
|          | VIACOMCBS INC - CLASS B         | 17,375  | 22.900   | 397,887.500                                    |  |
|          | MOHAWK INDUSTRIES INC           | 1,900   | 97.740   | 185,706.000                                    |  |
|          | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC      | 2,850   | 115.290  | 328,576.500                                    |  |
|          | CARNIVAL CORP                   | 15,300  | 19.980   | 305,694.000                                    |  |
|          | COMCAST CORP-CLASS A            | 144,790 | 39.460   | 5,713,413.400                                  |  |
|          | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD     | 7,200   | 22.210   | 159,912.000                                    |  |
|          | JARDINE MATHESON HLDGS LTD      | 7,100   | 43.960   | 312,116.000                                    |  |
|          | DAIRY FARM INTL HLDGS LTD       | 9,000   | 4.840    | 43,560.000                                     |  |
|          | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD      | 35,300  | 4.030    | 142,259.000                                    |  |
| アメリカ・ドル  | 小計                              |         |          | アメリカ・ドル<br>830,441,849.710<br>(89,056,583,963) |  |
| イギリス・ポンド |                                 | 株       | イギリス・ポンド | イギリス・ポンド                                       |  |
|          | BP PLC                          | 647,000 | 3.230    | 2,090,133.500                                  |  |
|          | UNILEVER PLC                    | 37,310  | 43.040   | 1,605,822.400                                  |  |
|          | BARCLAYS PLC                    | 568,800 | 1.170    | 665,837.280                                    |  |
|          | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC        | 64,500  | 3.275    | 211,237.500                                    |  |
|          | PRUDENTIAL PLC                  | 84,900  | 11.420   | 969,558.000                                    |  |
|          | ROYAL BANK OF SCOTLAND<br>GROUP | 145,791 | 1.187    | 173,053.910                                    |  |
|          | EVRAZ PLC                       | 15,000  | 2.878    | 43,170.000                                     |  |
|          | JOHNSON MATTHEY PLC             | 6,064   | 20.900   | 126,737.600                                    |  |
|          | BAE SYSTEMS PLC                 | 102,300 | 5.048    | 516,410.400                                    |  |
|          | AVIVA PLC                       | 128,966 | 2.765    | 356,590.990                                    |  |
|          | AVEVA GROUP PLC                 | 2,000   | 38.720   | 77,440.000                                     |  |
|          | GLAXOSMITHKLINE PLC             | 160,400 | 15.992   | 2,565,116.800                                  |  |
|          | INFORMA PLC                     | 49,900  | 4.606    | 229,839.400                                    |  |
|          | MELROSE INDUSTRIES PLC          | 145,500 | 1.185    | 172,490.250                                    |  |

|                                 |         |         |               |  |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| AUTO TRADER GROUP PLC           | 31,900  | 5.300   | 169,070.000   |  |
| DCC PLC                         | 3,150   | 67.020  | 211,113.000   |  |
| OCADO GROUP PLC                 | 15,200  | 19.580  | 297,616.000   |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC       | 1,667   | 107.500 | 179,202.500   |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING<br>PLC | 2,300   | 95.700  | 220,110.000   |  |
| HALMA PLC                       | 12,250  | 21.850  | 267,662.500   |  |
| GVC HOLDINGS PLC                | 19,100  | 7.456   | 142,409.600   |  |
| JD SPORTS FASHION PLC           | 13,000  | 6.282   | 81,666.000    |  |
| M&G PLC                         | 75,700  | 1.515   | 114,685.500   |  |
| RELX PLC                        | 63,146  | 18.340  | 1,158,097.640 |  |
| DIAGEO PLC                      | 74,400  | 27.800  | 2,068,320.000 |  |
| RIO TINTO PLC                   | 35,750  | 45.960  | 1,643,070.000 |  |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 86,800  | 4.269   | 370,549.200   |  |
| TESCO PLC                       | 320,700 | 2.262   | 725,423.400   |  |
| SMITH & NEPHEW PLC              | 27,950  | 16.015  | 447,619.250   |  |
| GLENCORE PLC                    | 319,725 | 1.723   | 551,014.060   |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 10,250  | 16.150  | 165,537.500   |  |
| SMITHS GROUP PLC                | 12,383  | 12.580  | 155,778.140   |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP     | 41,983  | 2.739   | 114,991.430   |  |
| PEARSON PLC                     | 23,563  | 5.730   | 135,015.990   |  |
| SAINSBURY (J) PLC               | 54,225  | 1.950   | 105,738.750   |  |
| NEXT PLC                        | 4,200   | 50.280  | 211,176.000   |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC               | 100,700 | 1.515   | 152,560.500   |  |
| WHITBREAD PLC                   | 6,861   | 23.640  | 162,194.040   |  |
| BUNZL PLC                       | 10,405  | 18.840  | 196,030.200   |  |
| VODAFONE GROUP PLC              | 870,183 | 1.261   | 1,097,300.760 |  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC         | 4,011   | 50.080  | 200,870.880   |  |
| KINGFISHER PLC                  | 62,411  | 1.969   | 122,887.250   |  |
| WPP PLC                         | 38,400  | 6.186   | 237,542.400   |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 20,627  | 9.020   | 186,055.540   |  |
| SEVERN TRENT PLC                | 7,133   | 24.060  | 171,619.980   |  |
| RENTOKIL INITIAL PLC            | 61,200  | 4.804   | 294,004.800   |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 22,650  | 69.080  | 1,564,662.000 |  |
| ST JAMES'S PLACE PLC            | 16,550  | 9.266   | 153,352.300   |  |
| SCHRODERS PLC                   | 4,150   | 29.150  | 120,972.500   |  |
| SSE PLC                         | 33,900  | 12.385  | 419,851.500   |  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC        | 31,000  | 5.258   | 162,998.000   |  |
| ASTRAZENECA PLC                 | 42,000  | 82.010  | 3,444,420.000 |  |

|                                 |           |        |   |  |
|---------------------------------|-----------|--------|---|--|
| FERGUSON PLC                    | 7,487     | 60.680 | 454,311.160                                   |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC       | 195,500   | 2.256  | 441,048.000                                   |  |
| 3I GROUP PLC                    | 31,391    | 8.130  | 255,208.830                                   |  |
| ASHTED GROUP PLC                | 14,650    | 23.610 | 345,886.500                                   |  |
| SAGE GROUP PLC/THE              | 35,114    | 6.502  | 228,311.220                                   |  |
| NATIONAL GRID PLC               | 114,434   | 9.162  | 1,048,444.300                                 |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 2,296,465 | 0.319  | 733,261.270                                   |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC         | 31,760    | 4.056  | 128,818.560                                   |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC             | 30,400    | 14.855 | 451,592.000                                   |  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE     | 4,150     | 41.810 | 173,511.500                                   |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO<br>PLC | 74,310    | 30.000 | 2,229,300.000                                 |  |
| BHP GROUP PLC                   | 68,727    | 16.674 | 1,145,953.990                                 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS<br>PLC | 11,500    | 19.280 | 221,720.000                                   |  |
| HSBC HOLDINGS PLC               | 649,650   | 3.803  | 2,470,943.770                                 |  |
| ANGLO AMERICAN PLC              | 40,383    | 18.252 | 737,070.510                                   |  |
| MONDI PLC                       | 15,650    | 14.335 | 224,342.750                                   |  |
| WM MORRISON SUPERMARKETS        | 73,400    | 1.839  | 134,982.600                                   |  |
| COMPASS GROUP PLC               | 52,139    | 11.500 | 599,598.500                                   |  |
| PERSIMMON PLC                   | 9,900     | 23.240 | 230,076.000                                   |  |
| BT GROUP PLC                    | 290,100   | 1.153  | 334,485.300                                   |  |
| COCA-COLA HBC AG-DI             | 6,550     | 20.560 | 134,668.000                                   |  |
| BURBERRY GROUP PLC              | 12,189    | 15.940 | 194,292.660                                   |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS<br>GROU | 5,636     | 38.520 | 217,098.720                                   |  |
| INTERTEK GROUP PLC              | 5,200     | 52.780 | 274,456.000                                   |  |
| ITV PLC                         | 120,100   | 0.787  | 94,518.700                                    |  |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP     | 10,099    | 79.620 | 804,082.380                                   |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 132,500   | 13.504 | 1,789,280.000                                 |  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 118,818   | 13.058 | 1,551,525.440                                 |  |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC       | 5,000     | 23.050 | 115,250.000                                   |  |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 6,150     | 22.630 | 139,174.500                                   |  |
| ANTOFAGASTA PLC                 | 11,400    | 8.680  | 98,952.000                                    |  |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 70,862    | 2.511  | 177,934.480                                   |  |
| EXPERIAN PLC                    | 29,654    | 27.240 | 807,774.960                                   |  |
| イギリス・ポンド 小計                     |           |        | イギリス・ポンド<br>47,014,501.740<br>(6,306,525,263) |  |

|                           |                                 |         |             |  |  |
|---------------------------|---------------------------------|---------|-------------|--|--|
| イスラエル・<br>シュケル            |                                 | 株       | イスラエル・シュケル  | イスラエル・シュケル                                   |  |
|                           | ISRAEL DISCOUNT BANK-A          | 34,500  | 11.700      | 403,650.000                                  |  |
|                           | AZRIELI GROUP LTD               | 1,400   | 176.100     | 246,540.000                                  |  |
|                           | ICL GROUP LTD                   | 23,600  | 12.250      | 289,100.000                                  |  |
|                           | ELBIT SYSTEMS LTD               | 750     | 499.500     | 374,625.000                                  |  |
|                           | BANK HAPOALIM BM                | 35,700  | 21.800      | 778,260.000                                  |  |
|                           | BANK LEUMI LE-ISRAEL            | 51,200  | 19.480      | 997,376.000                                  |  |
|                           | NICE LTD                        | 2,050   | 643.700     | 1,319,585.000                                |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD  | 4,100                           | 76.590  | 314,019.000 |  |  |
| イスラエル・シュケル 小計             |                                 |         |             | イスラエル・シュケル<br>4,723,155.000<br>(145,709,332) |  |
| オーストラリ<br>ア・ドル            |                                 | 株       | オーストラリア・ドル  | オーストラリア・ドル                                   |  |
|                           | MEDIBANK PRIVATE LTD            | 88,800  | 2.930       | 260,184.000                                  |  |
|                           | BHP GROUP LTD                   | 93,750  | 35.990      | 3,374,062.500                                |  |
|                           | SOUTH32 LTD                     | 151,600 | 2.100       | 318,360.000                                  |  |
|                           | WOODSIDE PETROLEUM LTD          | 30,550  | 21.370      | 652,853.500                                  |  |
|                           | FORTESCUE METALS GROUP LTD      | 54,000  | 14.810      | 799,740.000                                  |  |
|                           | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD     | 102,450 | 18.590      | 1,904,545.500                                |  |
|                           | WESTPAC BANKING CORP            | 114,948 | 17.890      | 2,056,419.720                                |  |
|                           | SANTOS LTD                      | 53,100  | 5.400       | 286,740.000                                  |  |
|                           | AUSNET SERVICES                 | 50,000  | 1.745       | 87,250.000                                   |  |
|                           | AUST AND NZ BANKING GROUP       | 89,050  | 18.920      | 1,684,826.000                                |  |
|                           | RIO TINTO LTD                   | 11,750  | 97.810      | 1,149,267.500                                |  |
|                           | ORIGIN ENERGY LTD               | 53,500  | 5.740       | 307,090.000                                  |  |
|                           | AURIZON HOLDINGS LTD            | 60,000  | 4.640       | 278,400.000                                  |  |
|                           | WASHINGTON H. SOUL<br>PATTINSON | 3,400   | 19.410      | 65,994.000                                   |  |
|                           | COLES GROUP LTD                 | 43,045  | 15.910      | 684,845.950                                  |  |
|                           | WISETECH GLOBAL LTD             | 4,500   | 21.220      | 95,490.000                                   |  |
|                           | NORTHERN STAR RESOURCES LTD     | 25,000  | 13.700      | 342,500.000                                  |  |
|                           | EVOLUTION MINING LTD            | 53,000  | 5.500       | 291,500.000                                  |  |
|                           | AFTERPAY LTD                    | 7,000   | 51.860      | 363,020.000                                  |  |
| OIL SEARCH LTD            | 64,200                          | 3.290   | 211,218.000 |  |  |
| SEEK LTD                  | 9,600                           | 19.490  | 187,104.000 |  |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 23,500                          | 10.860  | 255,210.000 |  |  |
| NEWCREST MINING LTD       | 26,000                          | 30.090  | 782,340.000 |  |  |

|                              |         |           |   |  |
|------------------------------|---------|-----------|---|--|
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 55,450  | 67.320    | 3,732,894.000                                   |  |
| AMPOL LTD                    | 7,150   | 27.830    | 198,984.500                                     |  |
| ORICA LTD                    | 13,100  | 16.950    | 222,045.000                                     |  |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 46,450  | 8.300     | 385,535.000                                     |  |
| CIMIC GROUP LTD              | 2,800   | 24.980    | 69,944.000                                      |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD         | 39,700  | 36.670    | 1,455,799.000                                   |  |
| COCA-COLA AMATIL LTD         | 15,700  | 9.140     | 143,498.000                                     |  |
| TABCORP HOLDINGS LTD         | 66,700  | 3.350     | 223,445.000                                     |  |
| CROWN RESORTS LTD            | 11,600  | 9.950     | 115,420.000                                     |  |
| QANTAS AIRWAYS LTD           | 24,000  | 4.490     | 107,760.000                                     |  |
| TELSTRA CORP LTD             | 134,500 | 3.160     | 425,020.000                                     |  |
| AMP LTD                      | 102,000 | 1.715     | 174,930.000                                     |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CD1  | 13,350  | 25.890    | 345,631.500                                     |  |
| MACQUARIE GROUP LTD          | 10,684  | 115.600   | 1,235,070.400                                   |  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 18,450  | 25.790    | 475,825.500                                     |  |
| CSL LTD                      | 14,200  | 284.320   | 4,037,344.000                                   |  |
| WESFARMERS LTD               | 36,000  | 42.470    | 1,528,920.000                                   |  |
| COCHLEAR LTD                 | 2,050   | 191.470   | 392,513.500                                     |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 16,300  | 11.900    | 193,970.000                                     |  |
| SUNCORP GROUP LTD            | 38,257  | 9.300     | 355,790.100                                     |  |
| ASX LTD                      | 6,250   | 85.130    | 532,062.500                                     |  |
| COMPUTERSHARE LTD            | 15,900  | 12.700    | 201,930.000                                     |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP    | 70,936  | 5.640     | 400,079.040                                     |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 14,350  | 28.070    | 402,804.500                                     |  |
| AGL ENERGY LTD               | 19,000  | 17.460    | 331,740.000                                     |  |
| BRAMBLES LTD                 | 50,400  | 10.950    | 551,880.000                                     |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD       | 5,750   | 65.580    | 377,085.000                                     |  |
| TPG TELECOM LTD              | 12,000  | 8.200     | 98,400.000                                      |  |
| REA GROUP LTD                | 1,600   | 102.620   | 164,192.000                                     |  |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 3,800   | 55.720    | 211,736.000                                     |  |
| オーストラリア・ドル 小計                |         |           | オーストラリア・ドル<br>35,531,209.210<br>(2,595,910,145) |  |
| カナダ・ドル                       | 株       | カナダ・ドル    | カナダ・ドル  |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 8,300   | 23.140    | 192,062.000                                     |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 600     | 1,471.030 | 882,618.000                                     |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 9,287   | 75.740    | 703,397.380                                     |  |

|                                 |        |           |               |  |
|---------------------------------|--------|-----------|---------------|--|
| WHEATON PRECIOUS METALS<br>CORP | 14,400 | 51.860    | 746,784.000   |  |
| INTACT FINANCIAL CORP           | 4,650  | 131.040   | 609,336.000   |  |
| BCE INC                         | 4,530  | 57.290    | 259,523.700   |  |
| FRANCO-NEVADA CORP              | 6,000  | 175.680   | 1,054,080.000 |  |
| SUNCOR ENERGY INC               | 48,530 | 24.870    | 1,206,941.100 |  |
| METRO INC/CN                    | 8,200  | 57.410    | 470,762.000   |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA         | 11,000 | 60.990    | 670,890.000   |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA             | 39,300 | 58.510    | 2,299,443.000 |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE     | 14,150 | 94.020    | 1,330,383.000 |  |
| TORONTO-DOMINION BANK           | 58,400 | 62.410    | 3,644,744.000 |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC           | 8,300  | 23.800    | 197,540.000   |  |
| ROYAL BANK OF CANADA            | 45,850 | 91.350    | 4,188,397.500 |  |
| TC ENERGY CORP                  | 30,450 | 58.880    | 1,792,896.000 |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP           | 17,829 | 33.460    | 596,558.340   |  |
| BARRICK GOLD CORP               | 57,700 | 32.740    | 1,889,098.000 |  |
| CAE INC                         | 7,900  | 24.250    | 191,575.000   |  |
| THOMSON REUTERS CORP            | 5,512  | 91.650    | 505,174.800   |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'               | 5,300  | 31.070    | 164,671.000   |  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B       | 4,650  | 45.070    | 209,575.500   |  |
| HYDRO ONE LTD                   | 10,500 | 25.210    | 264,705.000   |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD            | 5,460  | 66.440    | 362,762.400   |  |
| WSP GLOBAL INC                  | 3,400  | 84.740    | 288,116.000   |  |
| PARKLAND CORP                   | 4,400  | 34.570    | 152,108.000   |  |
| QUEBECOR INC -CL B              | 5,300  | 29.500    | 156,350.000   |  |
| EMERA INC                       | 7,700  | 53.320    | 410,564.000   |  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A        | 4,000  | 31.020    | 124,080.000   |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B     | 11,200 | 59.580    | 667,296.000   |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD          | 7,800  | 80.560    | 628,368.000   |  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES     | 16,700 | 18.760    | 313,292.000   |  |
| B2GOLD CORP                     | 34,700 | 6.970     | 241,859.000   |  |
| AIR CANADA                      | 4,100  | 19.400    | 79,540.000    |  |
| KINROSS GOLD CORP               | 37,900 | 8.430     | 319,497.000   |  |
| BANK OF MONTREAL                | 20,700 | 74.450    | 1,541,115.000 |  |
| POWER CORP OF CANADA            | 18,100 | 23.860    | 431,866.000   |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A           | 3,300  | 1,009.230 | 3,330,459.000 |  |
| NUTRIEN LTD                     | 18,219 | 49.270    | 897,650.130   |  |
| CANOPY GROWTH CORP              | 7,400  | 22.440    | 166,056.000   |  |
| CRONOS GROUP INC                | 5,500  | 8.770     | 48,235.000    |  |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD          | 8,800  | 49.840  | 438,592.000   |  |
| CAMECO CORP                     | 12,800 | 13.820  | 176,896.000   |  |
| TELUS CORP                      | 10,800 | 23.300  | 251,640.000   |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B        | 15,100 | 14.110  | 213,061.000   |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A      | 1,800  | 120.380 | 216,684.000   |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES      | 37,600 | 24.340  | 915,184.000   |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD     | 900    | 421.320 | 379,188.000   |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC         | 9,200  | 60.030  | 552,276.000   |  |
| WESTON (GEORGE) LTD             | 2,537  | 97.910  | 248,397.670   |  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP        | 7,000  | 35.540  | 248,780.000   |  |
| BLACKBERRY LTD                  | 16,000 | 7.140   | 114,240.000   |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC          | 18,650 | 50.150  | 935,297.500   |  |
| ENBRIDGE INC                    | 65,400 | 42.130  | 2,755,302.000 |  |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL<br>A | 43,425 | 46.440  | 2,016,657.000 |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP         | 61,500 | 18.780  | 1,154,970.000 |  |
| BAUSCH HEALTH COS INC           | 9,500  | 23.220  | 220,590.000   |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY<br>LTD | 4,300  | 342.390 | 1,472,277.000 |  |
| IA FINANCIAL CORP INC           | 3,300  | 45.590  | 150,447.000   |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC           | 6,300  | 21.870  | 137,781.000   |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO        | 23,050 | 119.520 | 2,754,936.000 |  |
| CGI INC - CLASS A               | 7,900  | 89.490  | 706,971.000   |  |
| ONEX CORPORATION                | 2,600  | 59.990  | 155,974.000   |  |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B       | 15,100 | 23.050  | 348,055.000   |  |
| IGM FINANCIAL INC               | 2,400  | 33.120  | 79,488.000    |  |
| TMX GROUP LTD                   | 1,900  | 128.930 | 244,967.000   |  |
| OPEN TEXT CORP                  | 8,700  | 56.920  | 495,204.000   |  |
| CI FINANCIAL CORP               | 7,000  | 16.810  | 117,670.000   |  |
| SAPUTO INC                      | 8,000  | 32.410  | 259,280.000   |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD      | 19,300 | 8.790   | 169,647.000   |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD -B     | 27,500 | 41.770  | 1,148,675.000 |  |
| YAMANA GOLD INC                 | 32,300 | 6.640   | 214,472.000   |  |
| FORTIS INC                      | 15,000 | 51.390  | 770,850.000   |  |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS        | 3,800  | 54.250  | 206,150.000   |  |
| LUNDIN MINING CORP              | 19,400 | 6.560   | 127,264.000   |  |
| CENOVUS ENERGY INC              | 31,400 | 6.210   | 194,994.000   |  |
| DOLLARAMA INC                   | 9,700  | 47.900  | 464,630.000   |  |
| ATCO LTD -CLASS I               | 2,200  | 36.380  | 80,036.000    |  |

|              |                              |         |            |   |  |
|--------------|------------------------------|---------|------------|---|--|
|              | ALTAGAS LTD                  | 7,900   | 15.080     | 119,132.000                                 |  |
|              | KEYERA CORP                  | 7,400   | 20.710     | 153,254.000                                 |  |
|              | INTER PIPELINE LTD           | 12,800  | 12.150     | 155,520.000                                 |  |
| カナダ・ドル 小計    |                              |         |            | カナダ・ドル<br>55,795,798.020<br>(4,388,897,472) |  |
| シンガポール・ドル    |                              | 株       | シンガポール・ドル  | シンガポール・ドル                                   |  |
|              | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 38,500  | 22.280     | 857,780.000                                 |  |
|              | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 57,500  | 21.930     | 1,260,975.000                               |  |
|              | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 43,675  | 4.160      | 181,688.000                                 |  |
|              | KEPPEL CORP LTD              | 51,300  | 6.040      | 309,852.000                                 |  |
|              | UOL GROUP LTD                | 14,000  | 7.160      | 100,240.000                                 |  |
|              | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 13,600  | 8.530      | 116,008.000                                 |  |
|              | CAPITALAND LTD               | 82,900  | 3.000      | 248,700.000                                 |  |
|              | YANGZIJIANG SHIPBUILDING     | 69,300  | 0.980      | 67,914.000                                  |  |
|              | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 2,700   | 21.850     | 58,995.000                                  |  |
|              | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 106,200 | 9.240      | 981,288.000                                 |  |
|              | GENTING SINGAPORE LTD        | 209,000 | 0.770      | 160,930.000                                 |  |
|              | VENTURE CORP LTD             | 8,600   | 15.250     | 131,150.000                                 |  |
|              | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 278,950 | 2.550      | 711,322.500                                 |  |
|              | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 50,000  | 3.450      | 172,500.000                                 |  |
|              | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 27,300  | 8.250      | 225,225.000                                 |  |
|              | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 58,900  | 3.960      | 233,244.000                                 |  |
| シンガポール・ドル 小計 |                              |         |            | シンガポール・ドル<br>5,817,811.500<br>(447,156,992) |  |
| スイス・フラン      |                              | 株       | スイス・フラン    | スイス・フラン                                     |  |
|              | UBS GROUP AG-REG             | 117,400 | 10.255     | 1,203,937.000                               |  |
|              | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 260     | 694.500    | 180,570.000                                 |  |
|              | ADECCO GROUP AG-REG          | 4,650   | 44.560     | 207,204.000                                 |  |
|              | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 22,630  | 325.650    | 7,369,459.500                               |  |
|              | PARGESA HOLDING SA-BR        | 1,100   | 72.000     | 79,200.000                                  |  |
|              | SIKA AG-REG                  | 4,160   | 168.900    | 702,624.000                                 |  |
|              | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 3       | 81,300.000 | 243,900.000                                 |  |
|              | ABB LTD-REG                  | 60,100  | 19.755     | 1,187,275.500                               |  |

|                 |                              |        |                 |  |  |
|-----------------|------------------------------|--------|-----------------|--|--|
|                 | SWISS RE AG                  | 9,400  | 73.200          | 688,080.000                                  |  |
|                 | NESTLE SA-REG                | 95,900 | 102.800         | 9,858,520.000                                |  |
|                 | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 590    | 805.200         | 475,068.000                                  |  |
|                 | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 1,260  | 215.800         | 271,908.000                                  |  |
|                 | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 77,570 | 9.452           | 733,191.640                                  |  |
|                 | JULIUS BAER GROUP LTD        | 7,400  | 41.250          | 305,250.000                                  |  |
|                 | SGS SA-REG                   | 190    | 2,215.000       | 420,850.000                                  |  |
|                 | SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 580    | 214.200         | 124,236.000                                  |  |
|                 | VIFOR PHARMA AG              | 1,450  | 138.450         | 200,752.500                                  |  |
|                 | TEMENOS AG - REG             | 2,120  | 136.950         | 290,334.000                                  |  |
|                 | ALCON INC                    | 16,130 | 54.880          | 885,214.400                                  |  |
|                 | SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 850    | 189.700         | 161,245.000                                  |  |
|                 | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 4,862  | 327.000         | 1,589,874.000                                |  |
|                 | BALOISE HOLDING AG - REG     | 1,570  | 141.400         | 221,998.000                                  |  |
|                 | CLARIANT AG-REG              | 5,700  | 17.790          | 101,403.000                                  |  |
|                 | NOVARTIS AG-REG              | 69,200 | 80.260          | 5,553,992.000                                |  |
|                 | BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 100    | 1,808.000       | 180,800.000                                  |  |
|                 | CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 16,660 | 60.800          | 1,012,928.000                                |  |
|                 | SWISSCOM AG-REG              | 830    | 487.200         | 404,376.000                                  |  |
|                 | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 110    | 88.100          | 9,691.000                                    |  |
|                 | GEBERIT AG-REG               | 1,190  | 452.700         | 538,713.000                                  |  |
|                 | GIVAUDAN-REG                 | 300    | 3,394.000       | 1,018,200.000                                |  |
|                 | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 340    | 740.800         | 251,872.000                                  |  |
|                 | SONOVA HOLDING AG-REG        | 1,810  | 198.350         | 359,013.500                                  |  |
|                 | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 5,500  | 55.160          | 303,380.000                                  |  |
|                 | LONZA GROUP AG-REG           | 2,360  | 465.500         | 1,098,580.000                                |  |
|                 | SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 1,520  | 37.020          | 56,270.400                                   |  |
|                 | LAFARGEHOLCIM LTD-REG        | 17,290 | 40.250          | 695,922.500                                  |  |
|                 | SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 1,040  | 352.500         | 366,600.000                                  |  |
|                 | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 1,670  | 140.850         | 235,219.500                                  |  |
|                 | SWISS PRIME SITE-REG         | 2,330  | 89.650          | 208,884.500                                  |  |
|                 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 34     | 7,710.000       | 262,140.000                                  |  |
| スイス・フラン         | 小計                           |        |                 | スイス・フラン<br>40,058,676.940<br>(4,515,013,478) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ |                              | 株      | スウェーデン・クロー<br>ナ | スウェーデン・クロー<br>ナ                              |  |
|                 | ICA GRUPPEN AB               | 3,300  | 426.800         | 1,408,440.000                                |  |

|                                  |         |         |                                    |  |
|----------------------------------|---------|---------|------------------------------------|--|
| ERICSSON LM-B SHS                | 94,430  | 83.600  | 7,894,348.000                      |  |
| VOLVO AB-B SHS                   | 47,850  | 136.800 | 6,545,880.000                      |  |
| SKF AB-B SHARES                  | 12,200  | 169.350 | 2,066,070.000                      |  |
| ELECTROLUX AB-SER B              | 6,650   | 153.150 | 1,018,447.500                      |  |
| SWEDISH MATCH AB                 | 5,450   | 626.200 | 3,412,790.000                      |  |
| TELE2 AB-B SHS                   | 15,600  | 121.650 | 1,897,740.000                      |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-<br>A | 52,400  | 78.280  | 4,101,872.000                      |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS      | 50,150  | 89.120  | 4,469,368.000                      |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES           | 29,250  | 123.220 | 3,604,185.000                      |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS        | 25,900  | 143.850 | 3,725,715.000                      |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B       | 20,700  | 110.200 | 2,281,140.000                      |  |
| SKANSKA AB-B SHS                 | 11,550  | 183.000 | 2,113,650.000                      |  |
| SANDVIK AB                       | 36,450  | 155.700 | 5,675,265.000                      |  |
| INVESTOR AB-B SHS                | 14,700  | 483.000 | 7,100,100.000                      |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS             | 21,600  | 371.600 | 8,026,560.000                      |  |
| SECURITAS AB-B SHS               | 9,550   | 119.400 | 1,140,270.000                      |  |
| TELIA CO AB                      | 82,000  | 31.660  | 2,596,120.000                      |  |
| ALFA LAVAL AB                    | 10,050  | 189.950 | 1,908,997.500                      |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS             | 12,600  | 323.700 | 4,078,620.000                      |  |
| ASSA ABLOY AB-B                  | 32,450  | 187.500 | 6,084,375.000                      |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS               | 2,200   | 411.600 | 905,520.000                        |  |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS       | 5,200   | 168.700 | 877,240.000                        |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS         | 10,400  | 194.550 | 2,023,320.000                      |  |
| LUNDIN ENERGY AB                 | 6,350   | 221.800 | 1,408,430.000                      |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 19,600  | 285.500 | 5,595,800.000                      |  |
| BOLIDEN AB                       | 9,300   | 209.400 | 1,947,420.000                      |  |
| EPIROC AB-A                      | 20,650  | 110.650 | 2,284,922.500                      |  |
| EPIROC AB-B                      | 11,600  | 109.250 | 1,267,300.000                      |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS               | 11,450  | 72.760  | 833,102.000                        |  |
| NORDEA BANK ABP                  | 104,100 | 67.670  | 7,044,447.000                      |  |
| EQT AB                           | 8,100   | 151.300 | 1,225,530.000                      |  |
| EVOLUTION GAMING GROUP           | 4,400   | 541.600 | 2,383,040.000                      |  |
| KINNEVIK AB - B                  | 7,300   | 226.100 | 1,650,530.000                      |  |
| HEXAGON AB-B SHS                 | 9,300   | 510.800 | 4,750,440.000                      |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 5,700   | 204.400 | 1,165,080.000                      |  |
| スウェーデン・クローナ 小計                   |         |         | スウェーデン・クロー<br>ナ<br>116,512,074.500 |  |

|                      |                                 |         |   | (1,337,558,615) |  |
|----------------------|---------------------------------|---------|---|-----------------|--|
| デンマーク・ク<br>ローネ       |                                 | 株       | デンマーク・クローネ  | デンマーク・クローネ      |  |
|                      | NOVO NORDISK A/S-B              | 57,200  | 432.100   | 24,716,120.000  |  |
|                      | DANSKE BANK A/S                 | 22,700  | 87.860  | 1,994,422.000   |  |
|                      | AP MOELLER-MAERSK A/S-A         | 105     | 7,010.000   | 736,050.000     |  |
|                      | H LUNDBECK A/S                  | 2,300   | 249.700   | 574,310.000     |  |
|                      | VESTAS WIND SYSTEMS A/S         | 6,500   | 662.600   | 4,306,900.000   |  |
|                      | GN STORE NORD A/S               | 4,300   | 351.800   | 1,512,740.000   |  |
|                      | CARLSBERG AS-B                  | 3,450   | 867.000   | 2,991,150.000   |  |
|                      | NOVOZYMES A/S-B SHARES          | 7,250   | 373.900   | 2,710,775.000   |  |
|                      | COLOPLAST-B                     | 3,850   | 1,044.500   | 4,021,325.000   |  |
|                      | DSV PANALPINA A/S               | 6,810   | 768.800   | 5,235,528.000   |  |
|                      | DEMANT A/S                      | 3,425   | 183.000   | 626,775.000     |  |
|                      | AP MOLLER-MAERSK A/S-B          | 200     | 7,540.000   | 1,508,000.000   |  |
|                      | TRYG A/S                        | 4,000   | 193.500   | 774,000.000     |  |
|                      | PANDORA A/S                     | 3,150   | 339.400   | 1,069,110.000   |  |
|                      | CHR HANSEN HOLDING A/S          | 3,450   | 662.800   | 2,286,660.000   |  |
|                      | GENMAB A/S                      | 2,100   | 1,979.000   | 4,155,900.000   |  |
| ORSTED A/S           | 6,100                           | 749.200 | 4,570,120.000                                     |                 |  |
| AMBU A/S-B           | 5,600                           | 215.100 | 1,204,560.000                                     |                 |  |
| デンマーク・クローネ 小計        |                                 |         | デンマーク・クローネ<br>64,994,445.000<br>(1,052,260,064)   |                 |  |
| ニュージーラン<br>ド・ドル      |                                 | 株       | ニュージーランド・ド<br>ル                                   | ニュージーランド・ド<br>ル |  |
|                      | MERIDIAN ENERGY LTD             | 41,500  | 4.760   | 197,540.000     |  |
|                      | MERCURY NZ LTD                  | 23,000  | 4.650   | 106,950.000     |  |
|                      | A2 MILK CO LTD                  | 23,400  | 18.800  | 439,920.000     |  |
|                      | SPARK NEW ZEALAND LTD           | 62,089  | 4.330   | 268,845.370     |  |
|                      | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD       | 38,900  | 6.480   | 252,072.000     |  |
|                      | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE<br>C | 18,700  | 28.400  | 531,080.000     |  |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 14,000                          | 12.850  | 179,900.000                                       |                 |  |
| ニュージーランド・ドル 小計       |                                 |         | ニュージーランド・ド<br>ル<br>1,976,307.370<br>(135,851,368) |                 |  |
| ノルウェー・ク<br>ローネ       |                                 | 株       | ノルウェー・クローネ  | ノルウェー・クローネ      |  |

|     |                                 |        |         |   |  |
|-----|---------------------------------|--------|---------|---|--|
|     | NORSK HYDRO ASA                 | 41,700 | 26.920  | 1,122,564.000                                 |  |
|     | DNB ASA                         | 30,800 | 134.700 | 4,148,760.000                                 |  |
|     | ORKLA ASA                       | 24,450 | 85.780  | 2,097,321.000                                 |  |
|     | TELENOR ASA                     | 23,200 | 150.000 | 3,480,000.000                                 |  |
|     | EQUINOR ASA                     | 33,823 | 144.050 | 4,872,203.150                                 |  |
|     | YARA INTERNATIONAL ASA          | 5,710  | 349.300 | 1,994,503.000                                 |  |
|     | MOWI ASA                        | 14,100 | 187.550 | 2,644,455.000                                 |  |
|     | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA       | 7,350  | 182.600 | 1,342,110.000                                 |  |
|     | SCHIBSTED ASA-B SHS             | 3,100  | 235.800 | 730,980.000                                   |  |
|     | ノルウェー・クローネ 小計                   |        |         | ノルウェー・クローネ<br>22,432,896.150<br>(248,332,160) |  |
| ユーロ |                                 | 株      | ユーロ     | ユーロ   |  |
|     | BAYER AG-REG                    | 31,670 | 65.230  | 2,065,834.100                                 |  |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG            | 6,500  | 22.730  | 147,745.000                                   |  |
|     | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED     | 63,950 | 8.278   | 529,378.100                                   |  |
|     | COMMERZBANK AG                  | 32,935 | 4.160   | 137,009.600                                   |  |
|     | VOLKSWAGEN AG                   | 1,010  | 146.400 | 147,864.000                                   |  |
|     | VOLKSWAGEN AG-PREF              | 5,920  | 133.960 | 793,043.200                                   |  |
|     | SIEMENS AG-REG                  | 24,550 | 98.560  | 2,419,648.000                                 |  |
|     | E.ON SE                         | 71,600 | 9.738   | 697,240.800                                   |  |
|     | UNIPER SE                       | 6,650  | 27.460  | 182,609.000                                   |  |
|     | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG     | 10,600 | 56.150  | 595,190.000                                   |  |
|     | GEA GROUP AG                    | 4,500  | 26.910  | 121,095.000                                   |  |
|     | CONTINENTAL AG                  | 3,590  | 86.300  | 309,817.000                                   |  |
|     | BASF SE                         | 29,170 | 51.120  | 1,491,170.400                                 |  |
|     | ALLIANZ SE-REG                  | 13,240 | 178.080 | 2,357,779.200                                 |  |
|     | THYSSENKRUPP AG                 | 11,450 | 6.948   | 79,554.600                                    |  |
|     | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG      | 5,800  | 81.800  | 474,440.000                                   |  |
|     | RWE AG                          | 19,000 | 29.700  | 564,300.000                                   |  |
|     | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG          | 6,650  | 10.470  | 69,625.500                                    |  |
|     | FRAPORT AG FRANKFURT<br>AIRPORT | 1,180  | 43.000  | 50,740.000                                    |  |
|     | BRENNTAG AG                     | 4,700  | 44.960  | 211,312.000                                   |  |
|     | FRESENIUS SE & CO KGAA          | 13,550 | 42.220  | 572,081.000                                   |  |
|     | UNITED INTERNET AG-REG<br>SHARE | 3,320  | 35.120  | 116,598.400                                   |  |
|     | HOCHTIEF AG                     | 710    | 76.050  | 53,995.500                                    |  |
|     | SAP SE                          | 33,442 | 115.300 | 3,855,862.600                                 |  |
|     | MUENCHENER RUECKVER AG-REG      | 4,610  | 224.700 | 1,035,867.000                                 |  |

|                                  |         |         |               |  |
|----------------------------------|---------|---------|---------------|--|
| ZALANDO SE                       | 4,950   | 61.800  | 305,910.000   |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG              | 4,900   | 45.600  | 223,440.000   |  |
| KION GROUP AG                    | 1,850   | 51.840  | 95,904.000    |  |
| WIRECARD AG                      | 3,620   | 92.130  | 333,510.600   |  |
| COVESTRO AG                      | 5,200   | 32.720  | 170,144.000   |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG              | 1,150   | 288.000 | 331,200.000   |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF       | 5,000   | 50.120  | 250,600.000   |  |
| DELIVERY HERO SE                 | 4,150   | 84.300  | 349,845.000   |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR       | 1,250   | 86.400  | 108,000.000   |  |
| METRO AG                         | 5,000   | 8.488   | 42,440.000    |  |
| NEMETSCHEK SE                    | 2,000   | 59.950  | 119,900.000   |  |
| SCOUT24 AG                       | 3,600   | 67.600  | 243,360.000   |  |
| AROUNDTOWN SA                    | 37,000  | 5.496   | 203,352.000   |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG          | 4,900   | 42.625  | 208,862.500   |  |
| KNORR-BREMSE AG                  | 1,450   | 94.000  | 136,300.000   |  |
| TEAMVIEWER AG                    | 4,450   | 42.530  | 189,258.500   |  |
| BEIERSDORF AG                    | 3,290   | 98.240  | 323,209.600   |  |
| FUCHS PETROLUB SE-PREF           | 1,950   | 35.740  | 69,693.000    |  |
| MERCK KGAA                       | 4,250   | 101.300 | 430,525.000   |  |
| ADIDAS AG                        | 6,170   | 230.100 | 1,419,717.000 |  |
| PUMA SE                          | 2,710   | 65.600  | 177,776.000   |  |
| HENKEL AG & CO KGAA              | 3,400   | 73.950  | 251,430.000   |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG          | 105,950 | 14.590  | 1,545,810.500 |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG &      | 6,920   | 74.240  | 513,740.800   |  |
| DAIMLER AG-REGISTERED<br>SHARES  | 27,200  | 36.020  | 979,744.000   |  |
| QIAGEN N.V.                      | 7,298   | 38.150  | 278,418.700   |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG         | 40,500  | 19.530  | 790,965.000   |  |
| HANNOVER RUECK SE                | 1,850   | 154.700 | 286,195.000   |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG             | 31,500  | 30.210  | 951,615.000   |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG               | 6,060   | 149.450 | 905,667.000   |  |
| LANXESS AG                       | 2,500   | 45.400  | 113,500.000   |  |
| MTU AERO ENGINES AG              | 1,710   | 155.900 | 266,589.000   |  |
| DEUTSCHE WOHNEN SE               | 10,600  | 39.650  | 420,290.000   |  |
| SYMRISE AG                       | 4,220   | 95.820  | 404,360.400   |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND<br>HOLDI  | 33,800  | 2.596   | 87,744.800    |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-<br>PRF | 1,550   | 44.080  | 68,324.000    |  |

|                                 |         |           |               |
|---------------------------------|---------|-----------|---------------|
| VONOVIA SE                      | 16,450  | 53.140    | 874,153.000   |
| LEG IMMOBILIEN AG               | 2,300   | 117.000   | 269,100.000   |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV          | 28,826  | 40.200    | 1,158,805.200 |
| NN GROUP NV                     | 9,050   | 30.120    | 272,586.000   |
| ARCELORMITTAL                   | 23,300  | 9.527     | 221,979.100   |
| HEINEKEN NV                     | 8,200   | 81.460    | 667,972.000   |
| AEGON NV                        | 58,244  | 2.573     | 149,861.810   |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE<br>N | 35,033  | 23.420    | 820,472.860   |
| AKZO NOBEL N.V.                 | 6,538   | 74.240    | 485,381.120   |
| KONINKLIJKE DSM NV              | 5,450   | 118.900   | 648,005.000   |
| WOLTERS KLUWER                  | 8,900   | 66.600    | 592,740.000   |
| ING GROEP NV                    | 126,250 | 6.372     | 804,465.000   |
| KONINKLIJKE KPN NV              | 114,650 | 2.249     | 257,847.850   |
| ASML HOLDING NV                 | 13,620  | 306.000   | 4,167,720.000 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA            | 13,050  | 7.644     | 99,754.200    |
| GALAPAGOS NV                    | 1,390   | 172.200   | 239,358.000   |
| ADYEN NV                        | 590     | 1,170.500 | 690,595.000   |
| UNILEVER NV                     | 46,500  | 47.330    | 2,200,845.000 |
| JUST EAT TAKEAWAY               | 4,000   | 82.200    | 328,800.000   |
| PROSUS NV                       | 15,500  | 77.000    | 1,193,500.000 |
| VOPAK                           | 2,300   | 47.830    | 110,009.000   |
| RANDSTAD NV                     | 3,700   | 38.520    | 142,524.000   |
| HEINEKEN HOLDING NV             | 3,750   | 73.150    | 274,312.500   |
| ALTICE EUROPE NV                | 20,500  | 3.600     | 73,800.000    |
| JCDECAUX SA                     | 2,700   | 18.460    | 49,842.000    |
| TOTAL SA                        | 79,650  | 35.095    | 2,795,316.750 |
| MICHELIN (CGDE)                 | 5,450   | 89.940    | 490,173.000   |
| AIR LIQUIDE SA                  | 15,277  | 123.050   | 1,879,834.850 |
| KERING                          | 2,400   | 487.350   | 1,169,640.000 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE           | 17,900  | 91.120    | 1,631,048.000 |
| BOUYGUES SA                     | 7,400   | 27.540    | 203,796.000   |
| BNP PARIBAS                     | 35,450  | 34.970    | 1,239,686.500 |
| PEUGEOT SA                      | 19,150  | 13.465    | 257,854.750   |
| NATIXIS                         | 29,550  | 2.272     | 67,137.600    |
| THALES SA                       | 3,500   | 70.580    | 247,030.000   |
| DANONE                          | 19,500  | 61.240    | 1,194,180.000 |
| CARREFOUR SA                    | 19,800  | 14.040    | 277,992.000   |
| SUEZ                            | 9,925   | 10.370    | 102,922.250   |

|                                 |        |         |               |  |
|---------------------------------|--------|---------|---------------|--|
| VIVENDI                         | 26,891 | 22.120  | 594,828.920   |  |
| L'OREAL                         | 8,070  | 263.400 | 2,125,638.000 |  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN       | 16,850 | 29.910  | 503,983.500   |  |
| LEGRAND SA                      | 8,517  | 62.500  | 532,312.500   |  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON       | 1,550  | 34.720  | 53,816.000    |  |
| PERNOD RICARD SA                | 6,737  | 143.650 | 967,770.050   |  |
| EURAZEO SE                      | 1,254  | 46.080  | 57,784.320    |  |
| SOCIETE GENERALE SA             | 25,750 | 14.766  | 380,224.500   |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS<br>VUI | 8,900  | 379.150 | 3,374,435.000 |  |
| ACCOR SA                        | 6,150  | 25.780  | 158,547.000   |  |
| CAPGEMINI SE                    | 5,120  | 96.160  | 492,339.200   |  |
| VALEO SA                        | 7,150  | 22.000  | 157,300.000   |  |
| PUBLICIS GROUPE                 | 7,050  | 29.600  | 208,680.000   |  |
| BUREAU VERITAS SA               | 9,700  | 18.840  | 182,748.000   |  |
| EIFFAGE                         | 2,740  | 80.860  | 221,556.400   |  |
| SODEXO SA                       | 2,700  | 64.000  | 172,800.000   |  |
| IPSEN                           | 1,150  | 70.750  | 81,362.500    |  |
| INGENICO GROUP                  | 1,970  | 127.750 | 251,667.500   |  |
| ORPEA                           | 1,800  | 99.280  | 178,704.000   |  |
| AMUNDI SA                       | 1,950  | 66.000  | 128,700.000   |  |
| TELEPERFORMANCE                 | 1,920  | 208.400 | 400,128.000   |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT           | 2,750  | 66.940  | 184,085.000   |  |
| FAURECIA                        | 2,250  | 32.870  | 73,957.500    |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC             | 370    | 570.600 | 211,122.000   |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH        | 900    | 209.400 | 188,460.000   |  |
| SEB SA                          | 650    | 134.200 | 87,230.000    |  |
| ESSILORLUXOTTICA                | 9,000  | 113.900 | 1,025,100.000 |  |
| DASSAULT AVIATION SA            | 80     | 848.000 | 67,840.000    |  |
| WORLDLINE SA                    | 4,514  | 67.800  | 306,049.200   |  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM      | 3,000  | 31.010  | 93,030.000    |  |
| AXA SA                          | 62,550 | 18.286  | 1,143,789.300 |  |
| EDENRED                         | 7,950  | 39.220  | 311,799.000   |  |
| RENAULT SA                      | 5,800  | 22.000  | 127,600.000   |  |
| HERMES INTERNATIONAL            | 1,020  | 738.400 | 753,168.000   |  |
| STMICROELECTRONICS NV           | 20,150 | 22.900  | 461,435.000   |  |
| REMY COINTREAU                  | 630    | 115.200 | 72,576.000    |  |
| ATOS SE                         | 2,960  | 69.520  | 205,779.200   |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA            | 4,180  | 147.150 | 615,087.000   |  |

|                             |         |         |               |
|-----------------------------|---------|---------|---------------|
| WENDEL                      | 780     | 82.400  | 64,272.000    |
| ORANGE                      | 63,300  | 10.410  | 658,953.000   |
| ALSTOM                      | 6,300   | 41.250  | 259,875.000   |
| CNP ASSURANCES              | 4,850   | 10.980  | 53,253.000    |
| SANOFI                      | 36,175  | 89.020  | 3,220,298.500 |
| VINCI SA                    | 16,650  | 82.980  | 1,381,617.000 |
| AIRBUS SE                   | 18,950  | 66.950  | 1,268,702.500 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT        | 17,500  | 20.450  | 357,875.000   |
| CREDIT AGRICOLE SA          | 37,600  | 8.126   | 305,537.600   |
| BIOMERIEUX                  | 1,340   | 113.400 | 151,956.000   |
| ENGIE                       | 58,023  | 10.955  | 635,641.960   |
| EDF                         | 18,550  | 8.164   | 151,442.200   |
| SES                         | 11,000  | 6.798   | 74,778.000    |
| SAFRAN SA                   | 10,420  | 89.840  | 936,132.800   |
| ILIAD SA                    | 490     | 160.700 | 78,743.000    |
| ARKEMA                      | 2,220   | 80.080  | 177,777.600   |
| ADP                         | 910     | 98.950  | 90,044.500    |
| SCOR SE                     | 4,950   | 24.380  | 120,681.000   |
| GETLINK SE                  | 14,200  | 12.960  | 184,032.000   |
| BOLLORE                     | 24,100  | 2.784   | 67,094.400    |
| UCB SA                      | 4,130   | 87.720  | 362,283.600   |
| KBC GROUP NV                | 7,700   | 49.070  | 377,839.000   |
| COLRUYT SA                  | 1,600   | 53.620  | 85,792.000    |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 2,450   | 73.180  | 179,291.000   |
| SOLVAY SA                   | 2,200   | 70.420  | 154,924.000   |
| UMICORE                     | 6,350   | 41.730  | 264,985.500   |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  | 24,400  | 45.200  | 1,102,880.000 |
| AGEAS                       | 5,790   | 32.790  | 189,854.100   |
| PROXIMUS                    | 4,950   | 19.420  | 96,129.000    |
| TELENET GROUP HOLDING NV    | 1,450   | 37.420  | 54,259.000    |
| ELIA GROUP SA/NV            | 1,050   | 94.500  | 99,225.000    |
| SOFINA                      | 550     | 228.500 | 125,675.000   |
| PRYSMIAN SPA                | 7,850   | 19.205  | 150,759.250   |
| ASSICURAZIONI GENERALI      | 35,743  | 13.425  | 479,849.770   |
| MEDIOBANCA SPA              | 18,865  | 6.808   | 128,432.920   |
| TENARIS SA                  | 13,300  | 6.254   | 83,178.200    |
| UNICREDIT SPA               | 69,656  | 7.942   | 553,207.950   |
| TELECOM ITALIA SPA          | 262,982 | 0.353   | 92,937.830    |
| TELECOM ITALIA-RSP          | 171,950 | 0.372   | 63,999.790    |

|                                 |         |         |               |
|---------------------------------|---------|---------|---------------|
| INTESA SANPAOLO                 | 478,237 | 1.622   | 775,700.410   |
| ATLANTIA SPA                    | 15,457  | 14.375  | 222,194.370   |
| POSTE ITALIANE SPA              | 16,000  | 8.248   | 131,968.000   |
| MONCLER SPA                     | 6,300   | 34.020  | 214,326.000   |
| RECORDATI SPA                   | 3,050   | 40.560  | 123,708.000   |
| ENI SPA                         | 81,300  | 8.587   | 698,123.100   |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA       | 18,700  | 7.460   | 139,502.000   |
| PIRELLI & C SPA                 | 11,000  | 3.900   | 42,900.000    |
| DIASORIN SPA                    | 850     | 167.000 | 141,950.000   |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS<br>ITAL | 8,300   | 8.955   | 74,326.500    |
| NEXI SPA                        | 10,900  | 14.160  | 154,344.000   |
| LEONARDO SPA                    | 13,175  | 6.196   | 81,632.300    |
| ENEL SPA                        | 258,734 | 7.345   | 1,900,401.230 |
| SNAM SPA                        | 66,600  | 4.325   | 288,045.000   |
| TERNA SPA                       | 46,300  | 6.042   | 279,744.600   |
| EXOR NV                         | 3,230   | 48.570  | 156,881.100   |
| CNH INDUSTRIAL NV               | 32,800  | 6.078   | 199,358.400   |
| FINECOBANK SPA                  | 19,700  | 11.580  | 228,126.000   |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES<br>NV | 34,100  | 8.193   | 279,381.300   |
| FERRARI NV                      | 4,145   | 148.650 | 616,154.250   |
| TELEFONICA SA                   | 149,227 | 4.542   | 677,789.030   |
| ENDESA SA                       | 9,250   | 21.430  | 198,227.500   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA<br>ARGENTA | 213,012 | 3.129   | 666,514.540   |
| IBERDROLA SA                    | 185,434 | 9.750   | 1,807,981.500 |
| BANKINTER SA                    | 18,300  | 4.237   | 77,537.100    |
| REPSOL SA                       | 43,400  | 8.688   | 377,059.200   |
| GRIFOLS SA                      | 9,200   | 27.920  | 256,864.000   |
| BANCO SANTANDER SA              | 527,750 | 2.213   | 1,167,910.750 |
| AMADEUS IT GROUP SA             | 14,050  | 48.400  | 680,020.000   |
| NATURGY ENERGY GROUP SA         | 9,400   | 16.505  | 155,147.000   |
| MAPFRE SA                       | 30,650  | 1.712   | 52,472.800    |
| CAIXABANK SA                    | 109,300 | 1.858   | 203,134.050   |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV     | 7,876   | 22.630  | 178,233.880   |
| AENA SME SA                     | 2,250   | 124.000 | 279,000.000   |
| CELLNEX TELECOM SA              | 8,000   | 48.750  | 390,000.000   |
| INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL      | 34,700  | 24.410  | 847,027.000   |

|                                 |         |         |  |  |
|---------------------------------|---------|---------|--|--|
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE<br>ENE | 6,650   | 14.840  | 98,686.000                                 |  |
| ENAGAS SA                       | 7,950   | 20.720  | 164,724.000                                |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION<br>SA | 13,900  | 16.270  | 226,153.000                                |  |
| FERROVIAL SA                    | 16,270  | 24.600  | 400,242.000                                |  |
| UPM-KYMMENE OYJ                 | 16,900  | 25.730  | 434,837.000                                |  |
| NOKIA OYJ                       | 181,400 | 3.727   | 676,077.800                                |  |
| WARTSILA OYJ ABP                | 12,000  | 7.218   | 86,616.000                                 |  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS            | 18,850  | 10.600  | 199,810.000                                |  |
| METSO OYJ                       | 3,450   | 29.790  | 102,775.500                                |  |
| ELISA OYJ                       | 4,600   | 53.020  | 243,892.000                                |  |
| SAMPO OYJ-A SHS                 | 15,300  | 30.570  | 467,721.000                                |  |
| FORTUM OYJ                      | 13,850  | 16.700  | 231,295.000                                |  |
| KONE OYJ-B                      | 10,950  | 59.480  | 651,306.000                                |  |
| NESTE OYJ                       | 13,900  | 34.910  | 485,249.000                                |  |
| ORION OYJ-CLASS B               | 3,200   | 43.210  | 138,272.000                                |  |
| VERBUND AG                      | 2,000   | 39.000  | 78,000.000                                 |  |
| OMV AG                          | 4,450   | 31.400  | 139,730.000                                |  |
| ERSTE GROUP BANK AG             | 9,450   | 22.500  | 212,625.000                                |  |
| VOESTALPINE AG                  | 4,250   | 19.260  | 81,855.000                                 |  |
| RAIFFEISEN BANK<br>INTERNATIONA | 4,400   | 17.260  | 75,944.000                                 |  |
| ANDRITZ AG                      | 2,100   | 32.720  | 68,712.000                                 |  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC         | 6,800   | 27.240  | 185,232.000                                |  |
| KINGSPAN GROUP PLC              | 5,000   | 52.300  | 261,500.000                                |  |
| JERONIMO MARTINS                | 7,700   | 15.090  | 116,193.000                                |  |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA     | 82,700  | 4.107   | 339,648.900                                |  |
| GALP ENERGIA SGPS SA            | 15,050  | 10.800  | 162,540.000                                |  |
| KERRY GROUP PLC-A               | 5,150   | 109.200 | 562,380.000                                |  |
| CRH PLC                         | 25,350  | 29.600  | 750,360.000                                |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC       | 2,643   | 120.700 | 319,010.100                                |  |
| ユーロ 小計                          |         |         | ユーロ<br>115,790,895.510<br>(13,973,645,269) |  |
| 香港・ドル                           | 株       | 香港・ドル   | 香港・ドル                                      |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD       | 44,500  | 44.300  | 1,971,350.000                              |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP<br>L | 73,000  | 54.450  | 3,974,850.000                              |  |
| MTR CORP                        | 49,500  | 40.850  | 2,022,075.000                              |  |

|                                 |         |         |  |  |
|---------------------------------|---------|---------|--|--|
| SUN HUNG KAI PROPERTIES         | 43,000  | 100.300 | 4,312,900.000                              |  |
| SINO LAND CO                    | 104,000 | 9.670   | 1,005,680.000                              |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD       | 86,169  | 52.050  | 4,485,096.450                              |  |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A        | 15,500  | 44.600  | 691,300.000                                |  |
| CLP HOLDINGS LTD                | 52,500  | 78.050  | 4,097,625.000                              |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT      | 48,507  | 29.550  | 1,433,381.850                              |  |
| HONG KONG & CHINA GAS           | 339,358 | 12.540  | 4,255,549.320                              |  |
| HANG SENG BANK LTD              | 24,500  | 129.500 | 3,172,750.000                              |  |
| WHEELLOCK & CO LTD              | 27,000  | 60.250  | 1,626,750.000                              |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT           | 198,000 | 9.240   | 1,829,520.000                              |  |
| WH GROUP LTD                    | 321,000 | 6.740   | 2,163,540.000                              |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR     | 38,300  | 296.200 | 11,344,460.000                             |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD        | 66,000  | 17.420  | 1,149,720.000                              |  |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY          | 9,300   | 75.600  | 703,080.000                                |  |
| NWS HOLDINGS LTD                | 42,500  | 7.140   | 303,450.000                                |  |
| KERRY PROPERTIES LTD            | 17,500  | 20.550  | 359,625.000                                |  |
| BANK OF EAST ASIA LTD           | 45,240  | 18.440  | 834,225.600                                |  |
| SJM HOLDINGS LTD                | 58,000  | 9.250   | 536,500.000                                |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD            | 38,200  | 19.480  | 744,136.000                                |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD           | 86,669  | 47.000  | 4,073,443.000                              |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS<br>L | 20,000  | 41.150  | 823,000.000                                |  |
| PCCW LTD                        | 117,000 | 4.470   | 522,990.000                                |  |
| AIA GROUP LTD                   | 389,400 | 71.400  | 27,803,160.000                             |  |
| WHARF REAL ESTATE<br>INVESTMENT | 36,000  | 34.450  | 1,240,200.000                              |  |
| BUDWEISER BREWING CO APAC<br>LT | 53,900  | 23.550  | 1,269,345.000                              |  |
| SANDS CHINA LTD                 | 77,600  | 32.550  | 2,525,880.000                              |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO<br>LTD | 44,000  | 73.950  | 3,253,800.000                              |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD      | 125,500 | 24.100  | 3,024,550.000                              |  |
| WYNN MACAU LTD                  | 54,000  | 14.640  | 790,560.000                                |  |
| 香港・ドル 小計                        |         |         | 香港・ドル<br>98,344,492.220<br>(1,361,087,772) |  |
| 合計                              |         |         | 125,564,531,893<br>[125,564,531,893]       |  |

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類                         | 通貨      | 銘柄                           | 券面総額   | 評価額           | 備考 |
|----------------------------|---------|------------------------------|--------|---------------|----|
| 投資証券                       | アメリカ・ドル |                              |        | アメリカ・ドル       |    |
|                            |         | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 4,417  | 723,283.750   |    |
|                            |         | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 9,687  | 736,018.260   |    |
|                            |         | BOSTON PROPERTIES INC        | 4,600  | 444,084.000   |    |
|                            |         | VORNADO REALTY TRUST         | 5,397  | 216,797.490   |    |
|                            |         | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 3,550  | 1,055,663.500 |    |
|                            |         | EQUITY RESIDENTIAL           | 11,850 | 753,304.500   |    |
|                            |         | EQUINIX INC                  | 2,748  | 1,859,406.720 |    |
|                            |         | AMERICAN TOWER CORP          | 14,100 | 3,638,928.000 |    |
|                            |         | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 22,243 | 281,151.520   |    |
|                            |         | INVITATION HOMES INC         | 17,700 | 489,759.000   |    |
|                            |         | VICI PROPERTIES INC          | 14,400 | 320,976.000   |    |
|                            |         | VENTAS INC                   | 12,200 | 480,802.000   |    |
|                            |         | WEYERHAEUSER CO              | 24,114 | 524,720.640   |    |
|                            |         | AGNC INVESTMENT CORP         | 16,800 | 228,648.000   |    |
|                            |         | CROWN CASTLE INTL CORP       | 13,350 | 2,194,339.500 |    |
|                            |         | IRON MOUNTAIN INC            | 8,910  | 247,876.200   |    |
|                            |         | VEREIT INC                   | 33,500 | 218,085.000   |    |
|                            |         | SUN COMMUNITIES INC          | 2,900  | 401,447.000   |    |
|                            |         | PROLOGIS INC                 | 23,702 | 2,238,890.920 |    |
|                            |         | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 3,970  | 632,301.900   |    |
|                            |         | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 3,200  | 304,992.000   |    |
|                            |         | DUKE REALTY CORP             | 11,450 | 404,757.500   |    |
|                            |         | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 2,050  | 511,844.000   |    |
|                            |         | FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 2,360  | 213,509.200   |    |
|                            |         | WELLTOWER INC                | 12,900 | 712,596.000   |    |
|                            |         | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 16,450 | 452,046.000   |    |
|                            |         | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 3,550  | 422,734.000   |    |
|                            |         | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 5,400  | 342,846.000   |    |
|                            |         | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 45,100 | 314,347.000   |    |
|                            |         | NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 5,350  | 190,674.000   |    |
|                            |         | REALTY INCOME CORP           | 10,500 | 634,515.000   |    |
| PUBLIC STORAGE             | 4,940   | 970,561.800                  |        |               |    |
| REGENCY CENTERS CORP       | 5,300   | 253,817.000                  |        |               |    |
| UDR INC                    | 9,150   | 357,673.500                  |        |               |    |
| WP CAREY INC               | 5,400   | 373,194.000                  |        |               |    |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 6,900   | 209,001.000                  |        |               |    |

|            |                              |         |  |  |
|------------|------------------------------|---------|--|--|
|            | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 8,300   | 1,128,800.000                                |  |
|            | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 4,000   | 386,840.000                                  |  |
|            | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 16,050  | 311,049.000                                  |  |
| アメリカ・ドル    | 小計                           |         | アメリカ・ドル<br>26,182,280.900<br>(2,807,787,804) |  |
| イギリス・ポンド   |                              |         | イギリス・ポンド                                     |  |
|            | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 21,662  | 134,217.750                                  |  |
|            | SEGREO PLC                   | 35,250  | 307,239.000                                  |  |
|            | BRITISH LAND CO PLC          | 25,550  | 105,495.950                                  |  |
| イギリス・ポンド   | 小計                           |         | イギリス・ポンド<br>546,952.700<br>(73,368,235)      |  |
| オーストラリア・ドル |                              |         | オーストラリア・ドル                                   |  |
|            | LENLEASE GROUP               | 21,500  | 263,805.000                                  |  |
|            | TRANSURBAN GROUP             | 86,300  | 1,224,597.000                                |  |
|            | SYDNEY AIRPORT               | 33,300  | 215,118.000                                  |  |
|            | APA GROUP                    | 38,100  | 427,482.000                                  |  |
|            | SCENTRE GROUP                | 159,922 | 366,221.380                                  |  |
|            | DEXUS                        | 33,150  | 319,566.000                                  |  |
|            | GPT GROUP                    | 63,160  | 269,693.200                                  |  |
|            | MIRVAC GROUP                 | 126,100 | 297,596.000                                  |  |
|            | STOCKLAND                    | 72,000  | 259,920.000                                  |  |
|            | GOODMAN GROUP                | 52,900  | 780,804.000                                  |  |
|            | VICINITY CENTRES             | 99,273  | 156,851.340                                  |  |
| オーストラリア・ドル | 小計                           |         | オーストラリア・ドル<br>4,581,653.920<br>(334,735,635) |  |
| カナダ・ドル     |                              |         | カナダ・ドル                                       |  |
|            | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 4,800   | 70,512.000                                   |  |
|            | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 2,100   | 45,507.000                                   |  |
|            | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 2,400   | 117,816.000                                  |  |
|            | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 4,700   | 78,302.000                                   |  |
| カナダ・ドル     | 小計                           |         | カナダ・ドル<br>312,137.000<br>(24,552,696)        |  |
| シンガポール・ドル  |                              |         | シンガポール・ドル                                    |  |

|              |                              |         |  |       |
|--------------|------------------------------|---------|--|-------|
|              | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST  | 79,600  | 140,096.000                              |       |
|              | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 101,000 | 313,100.000                              |       |
|              | CAPITALAND MALL TRUST        | 77,200  | 158,260.000                              |       |
|              | SUNTEC REIT                  | 63,000  | 92,610.000                               |       |
|              | MAPLETREE LOGISTICS TRUST    | 69,800  | 131,922.000                              |       |
|              | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST   | 65,500  | 133,620.000                              |       |
| シンガポール・ドル 小計 |                              |         | シンガポール・ドル<br>969,608.000<br>(74,524,071) |       |
| ユーロ          | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 4,200   | 240,828.000                              | ユーロ   |
|              | ICADE                        | 950     | 62,225.000                               |       |
|              | GECINA SA                    | 1,400   | 163,240.000                              |       |
|              | KLEPIERRE                    | 6,250   | 115,031.250                              |       |
|              | COVIVIO                      | 1,500   | 98,100.000                               |       |
| ユーロ 小計       |                              |         | ユーロ<br>679,424.250<br>(81,992,918)       |       |
| 香港・ドル        | LINK REIT                    | 67,000  | 4,495,700.000                            | 香港・ドル |
|              | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 75,000  | 582,000.000                              |       |
|              | HKT TRUST AND HKT LTD-SS     | 122,000 | 1,400,560.000                            |       |
| 香港・ドル 小計     |                              |         | 香港・ドル<br>6,478,260.000<br>(89,659,119)   |       |
| 投資証券 合計      |                              |         | 3,486,620,478<br>[3,486,620,478]         |       |
| 合計           |                              |         | 3,486,620,478<br>[3,486,620,478]         |       |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

| 通貨      | 銘柄数                   | 組入株式<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---------|-----------------------|--------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 株式 589銘柄<br>投資証券 39銘柄 | 96.9%        | 3.1%               | 71.3%          |

|             |      |       |       |       |       |
|-------------|------|-------|-------|-------|-------|
| イギリス・ポンド    | 株式   | 85銘柄  | 98.9% | 1.1%  | 4.9%  |
|             | 投資証券 | 3銘柄   |       |       |       |
| イスラエル・シケル   | 株式   | 8銘柄   | 100%  | -%    | 0.1%  |
| オーストラリア・ドル  | 株式   | 53銘柄  | 88.6% | 11.4% | 2.3%  |
|             | 投資証券 | 11銘柄  |       |       |       |
| カナダ・ドル      | 株式   | 81銘柄  | 99.4% | 0.6%  | 3.4%  |
|             | 投資証券 | 4銘柄   |       |       |       |
| シンガポール・ドル   | 株式   | 16銘柄  | 85.7% | 14.3% | 0.4%  |
|             | 投資証券 | 6銘柄   |       |       |       |
| スイス・フラン     | 株式   | 40銘柄  | 100%  | -%    | 3.5%  |
| スウェーデン・クローナ | 株式   | 36銘柄  | 100%  | -%    | 1.0%  |
| デンマーク・クローネ  | 株式   | 18銘柄  | 100%  | -%    | 0.8%  |
| ニュージーランド・ドル | 株式   | 7銘柄   | 100%  | -%    | 0.1%  |
| ノルウェー・クローネ  | 株式   | 9銘柄   | 100%  | -%    | 0.2%  |
| ユーロ         | 株式   | 241銘柄 | 99.4% | 0.6%  | 10.9% |
|             | 投資証券 | 5銘柄   |       |       |       |
| 香港・ドル       | 株式   | 32銘柄  | 93.8% | 6.2%  | 1.1%  |
|             | 投資証券 | 3銘柄   |       |       |       |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 17,640,172          | 18,286,434          |
| 親投資信託受益証券       | 1,733,708,318       | 1,786,668,244       |
| 未収入金            | 1,800,000           | -                   |
| 流動資産合計          | 1,753,148,490       | 1,804,954,678       |
| 資産合計            | 1,753,148,490       | 1,804,954,678       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 1,680,882           | -                   |
| 未払受託者報酬         | 185,117             | 195,636             |
| 未払委託者報酬         | 3,656,777           | 3,864,682           |
| その他未払費用         | 46,691              | 48,879              |
| 流動負債合計          | 5,569,467           | 4,109,197           |
| 負債合計            | 5,569,467           | 4,109,197           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,267,003,630       | 1,326,765,507       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 480,575,393         | 474,079,974         |
| (分配準備積立金)       | 131,493,498         | 99,240,564          |
| 元本等合計           | 1,747,579,023       | 1,800,845,481       |
| 純資産合計           | 1,747,579,023       | 1,800,845,481       |
| 負債純資産合計         | 1,753,148,490       | 1,804,954,678       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |             | 第4期                          |             |
|---|------------------------------|-------------|------------------------------|-------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |             |
| <b>営業収益</b>                               |                              |             |                              |             |
| 受取利息                                      |                              | 2           |                              | 40          |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 11,024,810  |                              | 17,900,074  |
| 営業収益合計                                    |                              | 11,024,812  |                              | 17,900,034  |
| <b>営業費用</b>                               |                              |             |                              |             |
| 支払利息                                      |                              | 12,490      |                              | 8,809       |
| 受託者報酬                                     |                              | 371,469     |                              | 386,714     |
| 委託者報酬                                     |                              | 7,338,062   |                              | 7,639,386   |
| その他費用                                     |                              | 94,138      |                              | 97,157      |
| 営業費用合計                                    |                              | 7,816,159   |                              | 8,132,066   |
| 営業利益又は営業損失( )                             |                              | 3,208,653   |                              | 26,032,100  |
| 経常利益又は経常損失( )                             |                              | 3,208,653   |                              | 26,032,100  |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |                              | 3,208,653   |                              | 26,032,100  |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |                              | 427,232     |                              | 12,583,753  |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |                              | 465,608,522 |                              | 480,575,393 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |                              | 126,152,840 |                              | 169,526,958 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 126,152,840 |                              | 169,526,958 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                              | 114,821,854 |                              | 137,406,524 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | 114,821,854 |                              | 137,406,524 |
| 分配金                                       |                              | 1 -         |                              | 1 -         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |                              | 480,575,393 |                              | 474,079,974 |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 1,232,384,733円 | 1,267,003,630円 |
| 期中追加設定元本額           | 339,152,791円   | 415,919,823円   |
| 期中一部解約元本額           | 304,533,894円   | 356,157,946円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,267,003,630口 | 1,326,765,507口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |  |
|------------|---|--|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(3,641,583円)、投資信託約款に規定される収益調整金(349,093,063円)及び分配準備積立金(127,851,915円)より分配対象額は480,586,561円(1万口当たり3,793.10円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(374,855,468円)及び分配準備積立金(99,240,564円)より分配対象額は474,096,032円(1万口当たり3,573.32円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|--|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 10,473,940               | 26,364,269               |
| 合計        | 10,473,940               | 26,364,269               |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3793円<br>(13,793円) | 1.3573円<br>(13,573円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                             | 券面総額        | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|---------------------------------|-------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 278,398,026 | 370,519,932   |    |
|              | 外国株式インデックスマザーファンド               | 554,243,792 | 1,416,148,312 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                                 |             | 1,786,668,244 |    |
| 合計           |                                 |             | 1,786,668,244 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

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

## 「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在  |
|-----------------|-----------------|---------------|
|                 | 金額（円）           | 金額（円）         |
| 資産の部            |                 |               |
| 流動資産            |                 |               |
| 預金              | 11,758,171      | 35,720,817    |
| コール・ローン         | 36,874,733      | 17,379,311    |
| 株式              | 6,274,186,968   | 7,422,789,977 |
| 投資証券            | 609,190,229     | 1,126,008,715 |
| 派生商品評価勘定        | 204,249         | 7,731,468     |
| 未収入金            | -               | 151,133       |
| 未収配当金           | 46,788,410      | 35,819,515    |
| 差入委託証拠金         | 24,175,918      | 50,200,294    |
| 流動資産合計          | 7,003,178,678   | 8,695,801,230 |
| 資産合計            | 7,003,178,678   | 8,695,801,230 |
| 負債の部            |                 |               |
| 流動負債            |                 |               |
| 派生商品評価勘定        | 4,395,222       | 48,910        |
| 未払金             | -               | 9,401,784     |
| 未払株式払込金         | 357,906         | -             |
| 未払解約金           | 1,820,000       | 4,441,000     |
| その他未払費用         | -               | 309           |
| 流動負債合計          | 6,573,128       | 13,892,003    |
| 負債合計            | 6,573,128       | 13,892,003    |
| 純資産の部           |                 |               |
| 元本等             |                 |               |
| 元本              | 1 4,567,104,546 | 6,523,403,479 |
| 剰余金             |                 |               |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,429,501,004   | 2,158,505,748 |
| 元本等合計           | 6,996,605,550   | 8,681,909,227 |
| 純資産合計           | 6,996,605,550   | 8,681,909,227 |
| 負債純資産合計         | 7,003,178,678   | 8,695,801,230 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|     |                              |
|-----|------------------------------|
| 区 分 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|-----|------------------------------|

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

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

## （貸借対照表に関する注記）

| 区 分   | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
|---|----------------|----------------|
| 1. 1 期首                                       | 2018年6月16日     | 2019年6月18日     |
| 期首元本額   | 3,410,057,687円 | 4,567,104,546円 |
| 期中追加設定元本額                                     | 1,486,881,231円 | 2,338,263,593円 |
| 期中一部解約元本額                                     | 329,834,372円   | 381,964,660円   |
| 期末元本額の内訳                                      |                |                |
| ファンド名   |                |                |
| 新興国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）             | 8,415,448円     | 19,677,357円    |
| ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）      | 223,805,289円   | 278,398,026円   |
| ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） | 216,916,938円   | 323,143,373円   |
| D - I ' s 新興国株式インデックス                         | 94,741,433円    | 121,641,068円   |
| i F r e e 新興国株式インデックス                         | 1,569,065,380円 | 2,353,246,698円 |
| i F r e e 8 資産バランス                            | 1,104,455,012円 | 1,913,084,219円 |
| D C ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス                   | 919,980,442円   | 1,033,624,453円 |
| ファンド  |                |                |

|    |                      |                |                |
|----|----------------------|----------------|----------------|
|    | ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 | 368,062,743円   | 388,133,425円   |
|    | ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド  | 61,661,861円    | 92,454,860円    |
| 計  |                      | 4,567,104,546円 | 6,523,403,479円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数        | 4,567,104,546口 | 6,523,403,479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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 株式   | 20,517,551             | 537,385,185            |
| 投資証券 | 4,794,582              | 41,719,644             |
| 合計   | 15,722,969             | 495,665,541            |

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年7月6日から2019年6月17日まで、及び2019年7月6日から2020年6月15日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

| 種 類  | 2019年6月17日 現在 |           |            |             | 2020年6月15日 現在 |           |             |             |
|------|---------------|-----------|------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
|      | 契約額等          |           | 時価<br>(円)  | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|      | (円)           | うち<br>1年超 |            |             | (円)           | うち<br>1年超 |             |             |
| 市場取引 |               |           |            |             |               |           |             |             |
| 株価指数 |               |           |            |             |               |           |             |             |
| 先物取引 |               |           |            |             |               |           |             |             |
| 買 建  | 80,737,639    | -         | 76,632,464 | 4,105,175   | 97,985,724    | -         | 105,717,192 | 7,731,468   |

|    |            |   |            |           |            |   |             |           |
|----|------------|---|------------|-----------|------------|---|-------------|-----------|
|    |            |   |            |           |            |   |             |           |
| 合計 | 80,737,639 | - | 76,632,464 | 4,105,175 | 97,985,724 | - | 105,717,192 | 7,731,468 |

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

| 種 類            | 2019年6月17日 現在 |           |            |             | 2020年6月15日 現在 |           |            |             |
|----------------|---------------|-----------|------------|-------------|---------------|-----------|------------|-------------|
|                | 契約額等          |           | 時価<br>(円)  | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)  | 評価損益<br>(円) |
|                | (円)           | うち<br>1年超 |            |             | (円)           | うち<br>1年超 |            |             |
| 市場取引以外の取引      |               |           |            |             |               |           |            |             |
| 為替予約取引         |               |           |            |             |               |           |            |             |
| 売 建            | 217,750       | -         | 217,680    | 70          | -             | -         | -          | -           |
| インドネシア・<br>ルピア | 153,224       | -         | 153,224    | 0           | -             | -         | -          | -           |
| トルコ・リラ         | 64,526        | -         | 64,456     | 70          | -             | -         | -          | -           |
| 買 建            | 22,021,010    | -         | 21,935,142 | 85,868      | 10,767,910    | -         | 10,719,000 | 48,910      |
| アメリカ・ドル        | 22,021,010    | -         | 21,935,142 | 85,868      | 10,767,910    | -         | 10,719,000 | 48,910      |
| 合計             | 22,238,760    | -         | 22,152,822 | 85,798      | 10,767,910    | -         | 10,719,000 | 48,910      |

## (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6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.5320円<br>(15,320円) | 1.3309円<br>(13,309円) |

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

### (1) 株式

| 通貨                        | 銘柄                           | 株式数     | 評価額         |               | 備考 |
|---------------------------|------------------------------|---------|-------------|---------------|----|
|                           |                              |         | 単価          | 金額            |    |
| アメリカ・ドル                   |                              | 株       | アメリカ・ドル     | アメリカ・ドル       |    |
|                           | SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF   | 33,700  | 4.990       | 168,163.000   |    |
|                           | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 6,400   | 217.640     | 1,392,896.000 |    |
|                           | BAIDU INC - SPON ADR         | 4,400   | 116.270     | 511,588.000   |    |
|                           | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR   | 8,000   | 17.720      | 141,760.000   |    |
|                           | CANADIAN SOLAR INC           | 2,800   | 17.740      | 49,672.000    |    |
|                           | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR   | 2,500   | 34.890      | 87,225.000    |    |
|                           | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR    | 19,950  | 9.190       | 183,340.500   |    |
|                           | JD.COM INC-ADR               | 8,200   | 57.990      | 475,518.000   |    |
|                           | NETEASE INC-ADR              | 500     | 409.480     | 204,740.000   |    |
|                           | TRIP.COM GROUP LTD-ADR       | 5,600   | 27.140      | 151,984.000   |    |
|                           | VTB BANK JSC -GDR-REG S      | 164,298 | 1.016       | 166,926.760   |    |
|                           | NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR   | 4,560   | 19.070      | 86,959.200    |    |
|                           | TATNEFT PAO-SPONSORED ADR    | 6,050   | 49.340      | 298,507.000   |    |
|                           | SURGUTNEFTEGAS-SP ADR        | 29,600  | 5.620       | 166,352.000   |    |
|                           | MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR  | 9,210   | 27.960      | 257,511.600   |    |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 24,970                       | 12.520  | 312,624.400 |               |    |
| RUSHYDRO PJSC-ADR         | 60,495                       | 1.052   | 63,640.740  |               |    |

|         |                                  |           |           |   |  |
|---------|----------------------------------|-----------|-----------|---|--|
|         | SBERBANK PJSC - SPONSORED<br>ADR | 81,100    | 11.995    | 972,794.500                                 |  |
|         | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG<br>S  | 1,220     | 154.800   | 188,856.000                                 |  |
|         | LUKOIL PJSC-SPON ADR             | 16,830    | 76.100    | 1,280,763.000                               |  |
|         | ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS<br>GDR  | 48,700    | 5.254     | 255,869.800                                 |  |
|         | GAZPROM PJSC-SPON ADR            | 327,290   | 5.540     | 1,813,186.600                               |  |
|         | SEVERSTAL - GDR REG S            | 10,270    | 13.400    | 137,618.000                                 |  |
|         | TATNEFT PJSC - PREF              | 3,510     | 8.132     | 28,544.170                                  |  |
|         | SISTEMA PJSFC                    | 14,700    | 0.231     | 3,400.750                                   |  |
|         | ROSSETI PJSC                     | 2,989,000 | 0.020     | 62,736.120                                  |  |
|         | INTER RAO UES PJSC               | 1,016,000 | 0.069     | 70,666.860                                  |  |
|         | ALROSA PJSC                      | 79,160    | 0.903     | 71,559.130                                  |  |
|         | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS<br>PJ  | 36,229    | 1.666     | 60,376.130                                  |  |
|         | AEROFLOT PJSC                    | 40,250    | 1.259     | 50,690.800                                  |  |
|         | アメリカ・ドル 小計                       |           |           | アメリカ・ドル<br>9,716,470.060<br>(1,041,994,249) |  |
| インド・ルピー |                                  | 株         | インド・ルピー   | インド・ルピー                                     |  |
|         | TATA STEEL LTD                   | 18,540    | 317.600   | 5,888,304.000                               |  |
|         | AXIS BANK LTD                    | 23,390    | 408.000   | 9,543,120.000                               |  |
|         | MARUTI SUZUKI INDIA LTD          | 1,350     | 5,561.750 | 7,508,362.500                               |  |
|         | HINDUSTAN UNILEVER LTD           | 2,730     | 2,107.250 | 5,752,792.500                               |  |
|         | HINDUSTAN PETROLEUM CORP         | 46,940    | 210.850   | 9,897,299.000                               |  |
|         | STATE BANK OF INDIA              | 55,470    | 179.150   | 9,937,450.500                               |  |
|         | NTPC LTD                         | 91,600    | 96.900    | 8,876,040.000                               |  |
|         | POWER FINANCE CORPORATION        | 35,940    | 83.600    | 3,004,584.000                               |  |
|         | JSW STEEL LTD                    | 33,520    | 188.950   | 6,333,604.000                               |  |
|         | INDIAN OIL CORP LTD              | 102,070   | 88.300    | 9,012,781.000                               |  |
|         | BHARAT PETROLEUM CORP LTD        | 42,205    | 373.900   | 15,780,449.500                              |  |
|         | VODAFONE IDEA LTD                | 1,105,890 | 10.150    | 11,224,783.500                              |  |
|         | JINDAL STEEL & POWER LTD         | 27,690    | 141.650   | 3,922,288.500                               |  |
|         | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE        | 3,050     | 684.400   | 2,087,420.000                               |  |
|         | TECH MAHINDRA LTD                | 5,820     | 554.700   | 3,228,354.000                               |  |
|         | YES BANK LTD                     | 17,640    | 29.500    | 520,380.000                                 |  |
|         | TATA MOTORS LTD-A-DVR            | 31,820    | 44.700    | 1,422,354.000                               |  |
|         | REC LTD                          | 38,360    | 106.050   | 4,068,078.000                               |  |
|         | COAL INDIA LTD                   | 72,510    | 134.650   | 9,763,471.500                               |  |

|                |                                 |         |            |  |  |
|----------------|---------------------------------|---------|------------|--|--|
|                | BHARTI INFRATEL LTD             | 20,680  | 225.000    | 4,653,000.000                                    |  |
|                | INDIABULLS HOUSING FINANCE<br>L | 21,740  | 153.450    | 3,336,003.000                                    |  |
|                | GAIL INDIA LTD                  | 37,866  | 96.350     | 3,648,389.100                                    |  |
|                | HINDALCO INDUSTRIES LTD         | 52,800  | 146.050    | 7,711,440.000                                    |  |
|                | GRASIM INDUSTRIES LTD           | 10,680  | 601.950    | 6,428,826.000                                    |  |
|                | WIPRO LTD                       | 20,423  | 207.900    | 4,245,941.700                                    |  |
|                | TATA CONSULTANCY SVCS LTD       | 8,416   | 2,039.500  | 17,164,432.000                                   |  |
|                | INFOSYS LTD                     | 47,240  | 692.050    | 32,692,442.000                                   |  |
|                | LARSEN & TOUBRO LTD             | 5,572   | 926.400    | 5,161,900.800                                    |  |
|                | TATA MOTORS LTD                 | 106,680 | 105.300    | 11,233,404.000                                   |  |
|                | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE     | 14,790  | 1,792.200  | 26,506,638.000                                   |  |
|                | RELIANCE INDUSTRIES LTD         | 40,040  | 1,588.800  | 63,615,552.000                                   |  |
|                | OIL & NATURAL GAS CORP LTD      | 121,125 | 83.900     | 10,162,387.500                                   |  |
|                | ITC LTD                         | 43,290  | 193.900    | 8,393,931.000                                    |  |
|                | MAHINDRA & MAHINDRA LTD         | 16,950  | 508.450    | 8,618,227.500                                    |  |
|                | HERO MOTOCORP LTD               | 2,510   | 2,401.850  | 6,028,643.500                                    |  |
|                | BHARTI AIRTEL LTD               | 21,142  | 560.100    | 11,841,634.200                                   |  |
|                | SUN PHARMACEUTICAL INDUS        | 15,240  | 480.100    | 7,316,724.000                                    |  |
|                | HCL TECHNOLOGIES LTD            | 15,140  | 570.750    | 8,641,155.000                                    |  |
|                | VEDANTA LTD                     | 133,460 | 103.300    | 13,786,418.000                                   |  |
| インド・ルピー        | 小計                              |         |            | インド・ルピー<br>388,959,005.800<br>(552,321,788)      |  |
| インドネシア・<br>ルピア |                                 | 株       | インドネシア・ルピア | インドネシア・ルピア                                       |  |
|                | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT      | 256,300 | 4,790.000  | 1,227,677,000.000                                |  |
|                | TELEKOMUNIKASI INDONESIA<br>PER | 927,200 | 3,030.000  | 2,809,416,000.000                                |  |
|                | BANK NEGARA INDONESIA<br>PERSER | 172,700 | 4,470.000  | 771,969,000.000                                  |  |
|                | BANK CENTRAL ASIA TBK PT        | 61,500  | 28,350.000 | 1,743,525,000.000                                |  |
|                | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT     | 337,000 | 4,890.000  | 1,647,930,000.000                                |  |
|                | BANK RAKYAT INDONESIA<br>PERSER | 776,100 | 3,030.000  | 2,351,583,000.000                                |  |
| インドネシア・ルピア     | 小計                              |         |            | インドネシア・ルピア<br>10,552,100,000.000<br>(81,251,170) |  |
| オフショア・人<br>民元  |                                 | 株       | オフショア・人民元  | オフショア・人民元  |  |

|                               |         |           |               |  |
|-------------------------------|---------|-----------|---------------|--|
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A     | 65,000  | 15.970    | 1,038,050.000 |  |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A  | 68,200  | 8.500     | 579,700.000   |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A  | 13,100  | 74.150    | 971,365.000   |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-A      | 231,800 | 5.220     | 1,209,996.000 |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A    | 5,500   | 17.960    | 98,780.000    |  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A     | 6,000   | 28.140    | 168,840.000   |  |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A     | 8,400   | 8.320     | 69,888.000    |  |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A      | 400     | 1,416.370 | 566,548.000   |  |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A   | 4,600   | 56.000    | 257,600.000   |  |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A  | 99,600  | 10.550    | 1,050,780.000 |  |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A     | 40,400  | 3.490     | 140,996.000   |  |
| CITIC SECURITIES CO-A         | 11,000  | 22.610    | 248,710.000   |  |
| CHINA MERCHANTS BANK-A        | 35,900  | 34.500    | 1,238,550.000 |  |
| PING AN BANK CO LTD-A         | 37,800  | 12.990    | 491,022.000   |  |
| GF SECURITIES CO LTD-A        | 9,800   | 13.400    | 131,320.000   |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A   | 217,500 | 5.010     | 1,089,675.000 |  |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A         | 37,900  | 17.990    | 681,821.000   |  |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A   | 23,800  | 3.540     | 84,252.000    |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A  | 29,100  | 5.270     | 153,357.000   |  |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA-A | 84,500  | 2.510     | 212,095.000   |  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A  | 62,100  | 2.780     | 172,638.000   |  |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A       | 9,600   | 13.080    | 125,568.000   |  |
| YANZHOU COAL MINING CO-A      | 4,900   | 8.650     | 42,385.000    |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A     | 30,300  | 6.380     | 193,314.000   |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A  | 483,400 | 3.380     | 1,633,892.000 |  |
| BANK OF CHINA LTD-A           | 244,200 | 3.480     | 849,816.000   |  |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A  | 170,400 | 4.040     | 688,416.000   |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A   | 173,300 | 5.100     | 883,830.000   |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-A     | 26,300  | 16.280    | 428,164.000   |  |
| CHINA VANKE CO LTD -A         | 19,100  | 25.710    | 491,061.000   |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A  | 12,200  | 27.750    | 338,550.000   |  |

|             |                                 |         |             |  |  |
|-------------|---------------------------------|---------|-------------|--|--|
|             | CHINA CITIC BANK CORP LTD-A     | 41,200  | 5.040       | 207,648.000                                  |  |
|             | CHINA MINSHENG BANKING-A        | 152,500 | 5.680       | 866,200.000                                  |  |
|             | CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A      | 155,100 | 3.750       | 581,625.000                                  |  |
|             | CRRC CORP LTD-A                 | 55,200  | 5.720       | 315,744.000                                  |  |
|             | CHINA UNITED NETWORK-A          | 91,300  | 4.920       | 449,196.000                                  |  |
|             | HUATAI SECURITIES CO LTD-A      | 9,000   | 17.820      | 160,380.000                                  |  |
|             | HAITONG SECURITIES CO LTD-A     | 12,300  | 11.730      | 144,279.000                                  |  |
|             | CHINA COMMUNICATIONS CONST-A    | 26,800  | 7.650       | 205,020.000                                  |  |
|             | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A       | 81,500  | 4.570       | 372,455.000                                  |  |
|             | NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A    | 3,500   | 44.200      | 154,700.000                                  |  |
|             | HUAXIA BANK CO LTD-A            | 60,300  | 6.290       | 379,287.000                                  |  |
|             | AIR CHINA LTD-A                 | 14,800  | 6.680       | 98,864.000                                   |  |
|             | BYD CO LTD -A                   | 1,800   | 61.480      | 110,664.000                                  |  |
|             | GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A    | 4,400   | 9.450       | 41,580.000                                   |  |
|             | WEICHAO POWER CO LTD-A          | 9,800   | 13.680      | 134,064.000                                  |  |
|             | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A     | 25,900  | 3.970       | 102,823.000                                  |  |
|             | HUANENG POWER INTL INC-A        | 38,600  | 4.210       | 162,506.000                                  |  |
|             | オフショア・人民元 小計                    |         |             | オフショア・人民元<br>20,818,014.000<br>(314,976,552) |  |
| サウジアラビア・リアル |                                 | 株       | サウジアラビア・リアル | サウジアラビア・リアル                                  |  |
|             | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP     | 21,460  | 88.500      | 1,899,210.000                                |  |
|             | SAUDI TELECOM CO                | 7,500   | 98.500      | 738,750.000                                  |  |
|             | AL RAJHI BANK                   | 17,400  | 59.200      | 1,030,080.000                                |  |
|             | SAMBA FINANCIAL GROUP           | 12,620  | 23.420      | 295,560.400                                  |  |
|             | RIYAD BANK                      | 16,360  | 17.560      | 287,281.600                                  |  |
|             | ETIHAD ETISALAT CO              | 12,070  | 29.000      | 350,030.000                                  |  |
|             | SAVOLA                          | 7,120   | 43.600      | 310,432.000                                  |  |
|             | YANBU NATIONAL<br>PETROCHEMICAL | 6,210   | 51.400      | 319,194.000                                  |  |
|             | ALINMA BANK                     | 17,426  | 14.940      | 260,344.440                                  |  |
|             | NATIONAL COMMERCIAL BANK        | 13,050  | 38.650      | 504,382.500                                  |  |
|             | SAUDI ARABIAN OIL CO            | 9,880   | 32.250      | 318,630.000                                  |  |
|             | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL<br>CO | 30,990  | 8.600       | 266,514.000                                  |  |

|                |                              |           |           |                 |  |
|----------------|------------------------------|-----------|-----------|-----------------|--|
| サウジアラビア・リアル 小計 |                              |           |           | サウジアラビア・リアル     |  |
|                |                              |           |           | 6,580,408.940   |  |
|                |                              |           |           | (188,331,303)   |  |
| シンガポール・ドル      |                              | 株         | シンガポール・ドル | シンガポール・ドル       |  |
|                | YANGZIJANG SHIPBUILDING      | 88,700    | 0.980     | 86,926.000      |  |
| シンガポール・ドル 小計   |                              |           |           | シンガポール・ドル       |  |
|                |                              |           |           | 86,926.000      |  |
|                |                              |           |           | (6,681,132)     |  |
| タイ・パーツ         |                              | 株         | タイ・パーツ    | タイ・パーツ          |  |
|                | BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG | 20,800    | 121.500   | 2,527,200.000   |  |
|                | SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 30,900    | 358.000   | 11,062,200.000  |  |
|                | KASIKORNBANK PCL-FOREIGN     | 22,700    | 107.500   | 2,440,250.000   |  |
|                | KASIKORNBANK PCL-NVDR        | 11,600    | 107.500   | 1,247,000.000   |  |
|                | SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 106,800   | 84.250    | 8,997,900.000   |  |
|                | THANACHART CAPITAL PCL-NVDR  | 37,200    | 39.750    | 1,478,700.000   |  |
|                | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR   | 68,500    | 28.750    | 1,969,375.000   |  |
|                | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 22,100    | 192.500   | 4,254,250.000   |  |
|                | KRUNG THAI BANK - NVDR       | 299,400   | 11.200    | 3,353,280.000   |  |
|                | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR     | 316,300   | 6.350     | 2,008,505.000   |  |
|                | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR   | 38,400    | 91.000    | 3,494,400.000   |  |
|                | IRPC PCL - NVDR              | 885,300   | 2.760     | 2,443,428.000   |  |
|                | PTT PCL-NVDR                 | 590,200   | 37.250    | 21,984,950.000  |  |
|                | THAI OIL PCL-NVDR            | 70,600    | 44.500    | 3,141,700.000   |  |
|                | CP ALL PCL-NVDR              | 69,300    | 70.500    | 4,885,650.000   |  |
|                | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR  | 131,600   | 30.500    | 4,013,800.000   |  |
|                | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 121,400   | 45.500    | 5,523,700.000   |  |
| タイ・パーツ 小計      |                              |           |           | タイ・パーツ          |  |
|                |                              |           |           | 84,826,288.000  |  |
|                |                              |           |           | (294,347,220)   |  |
| チリ・ペソ          |                              | 株         | チリ・ペソ     | チリ・ペソ           |  |
|                | ENEL CHILE SA                | 699,767   | 60.310    | 42,202,947.770  |  |
|                | BANCO SANTANDER CHILE        | 2,105,880 | 34.700    | 73,074,036.000  |  |
|                | ENEL AMERICAS SA             | 853,363   | 129.610   | 110,604,378.430 |  |
|                | FALABELLA SA                 | 21,800    | 2,339.000 | 50,990,200.000  |  |
|                | BANCO DE CHILE               | 1,219,792 | 75.890    | 92,570,014.880  |  |
| チリ・ペソ 小計       |                              |           |           | チリ・ペソ           |  |

|           |                                  |         |          |  |  |
|-----------|----------------------------------|---------|----------|--|--|
|           |                                  |         |          | 369,441,577.080                          |  |
|           |                                  |         |          | (49,911,557)                             |  |
| トルコ・リラ    |                                  | 株       | トルコ・リラ   | トルコ・リラ                                   |  |
|           | TURKIYE GARANTI BANKASI          | 106,020 | 8.140    | 863,002.800                              |  |
|           | AKBANK T.A.S.                    | 149,272 | 5.810    | 867,270.320                              |  |
|           | TURKIYE IS BANKASI-C             | 127,100 | 5.150    | 654,565.000                              |  |
|           | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS      | 69,660  | 14.220   | 990,565.200                              |  |
|           | TUPRAS-TURKIYE PETROL<br>RAFINE  | 9,090   | 87.450   | 794,920.500                              |  |
|           | EREGLI DEMIR VE CELIK<br>FABRIK  | 86,881  | 8.500    | 738,488.500                              |  |
|           | HACI OMER SABANCI HOLDING        | 80,390  | 9.090    | 730,745.100                              |  |
|           | TURKIYE HALK BANKASI             | 110,830 | 5.510    | 610,673.300                              |  |
|           | TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-<br>D | 96,120  | 4.740    | 455,608.800                              |  |
|           | KOC HOLDING AS                   | 39,915  | 17.180   | 685,739.700                              |  |
|           | TURK HAVA YOLLARI AO             | 56,780  | 12.760   | 724,512.800                              |  |
|           | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS        | 9,440   | 63.650   | 600,856.000                              |  |
| トルコ・リラ 小計 |                                  |         |          | トルコ・リラ<br>8,716,948.020<br>(137,117,592) |  |
| ブラジル・リアル  |                                  | 株       | ブラジル・リアル | ブラジル・リアル                                 |  |
|           | CIA PARANAENSE DE ENERGIA        | 600     | 61.730   | 37,038.000                               |  |
|           | IRB BRASIL RESSEGUROS SA         | 14,600  | 11.490   | 167,754.000                              |  |
|           | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT        | 3,600   | 63.010   | 226,836.000                              |  |
|           | PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA       | 26,800  | 22.420   | 600,856.000                              |  |
|           | CIA BRASILEIRA DE<br>DISTRIBUIC  | 6,600   | 64.090   | 422,994.000                              |  |
|           | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-<br>PR | 130,000 | 20.600   | 2,678,000.000                            |  |
|           | BANCO BRADESCO SA-PREF           | 143,726 | 21.630   | 3,108,793.380                            |  |
|           | ITAU UNIBANCO HOLDING S-<br>PREF | 183,336 | 26.060   | 4,777,736.160                            |  |
|           | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA      | 24,600  | 10.870   | 267,402.000                              |  |
|           | VALE SA                          | 103,590 | 53.400   | 5,531,706.000                            |  |
|           | GERDAU SA-PREF                   | 36,700  | 13.880   | 509,396.000                              |  |
|           | PETROBRAS - PETROLEO BRAS        | 82,100  | 21.240   | 1,743,804.000                            |  |
|           | CIA ENERGETICA MINAS GER-<br>PRF | 41,397  | 11.030   | 456,608.910                              |  |

|                 |                                  |        |                               |   |  |
|-----------------|----------------------------------|--------|-------------------------------|---|--|
|                 | BRASKEM SA-PREF A                | 12,500 | 24.700                        | 308,750.000                                 |  |
|                 | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR<br>B  | 4,800  | 31.430                        | 150,864.000                                 |  |
|                 | BANCO DO BRASIL S.A.             | 45,300 | 33.350                        | 1,510,755.000                               |  |
|                 | CENTRAIS ELETRICAS<br>BRASILIER  | 12,300 | 29.940                        | 368,262.000                                 |  |
|                 | CIA PARANAENSE DE ENERGI-<br>PFB | 3,300  | 64.360                        | 212,388.000                                 |  |
|                 | EMBRAER SA                       | 28,200 | 8.820                         | 248,724.000                                 |  |
|                 | METALURGICA GERDAU SA-PREF       | 75,300 | 6.510                         | 490,203.000                                 |  |
|                 | CCR SA                           | 25,200 | 14.360                        | 361,872.000                                 |  |
|                 | BRF SA                           | 19,700 | 21.560                        | 424,732.000                                 |  |
|                 | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP      | 6,800  | 53.960                        | 366,928.000                                 |  |
|                 | TIM PARTICIPACOES SA             | 19,426 | 14.340                        | 278,568.840                                 |  |
|                 | TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF     | 15,300 | 49.830                        | 762,399.000                                 |  |
|                 | LOJAS RENNER S.A.                | 5,005  | 42.980                        | 215,114.900                                 |  |
|                 | LOJAS AMERICANAS SA-PREF         | 8,584  | 31.300                        | 268,679.200                                 |  |
|                 | JBS SA                           | 42,900 | 21.980                        | 942,942.000                                 |  |
|                 | SUZANO SA                        | 8,945  | 37.010                        | 331,054.450                                 |  |
|                 | MARFRIG GLOBAL FOODS SA          | 19,700 | 12.880                        | 253,736.000                                 |  |
|                 | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO        | 14,100 | 49.850                        | 702,885.000                                 |  |
|                 | CIELO SA                         | 75,228 | 4.210                         | 316,709.880                                 |  |
|                 | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD      | 9,000  | 21.600                        | 194,400.000                                 |  |
|                 | CIA ENERGETICA DE MINAS GER      | 3,200  | 11.860                        | 37,952.000                                  |  |
|                 | BANCO SANTANDER BRASIL-<br>UNIT  | 14,600 | 29.920                        | 436,832.000                                 |  |
|                 | TELEFONICA BRASIL S.A.           | 1,000  | 49.950                        | 49,950.000                                  |  |
|                 | KLABIN SA - UNIT                 | 14,400 | 19.240                        | 277,056.000                                 |  |
|                 | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA        | 56,500 | 17.990                        | 1,016,435.000                               |  |
|                 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA         | 19,900 | 24.470                        | 486,953.000                                 |  |
|                 | LOJAS AMERICANAS SA              | 2,293  | 26.060                        | 59,755.580                                  |  |
|                 | COGNA EDUCACAO                   | 47,500 | 6.350                         | 301,625.000                                 |  |
|                 | BANCO BRADESCO S.A.              | 38,241 | 19.890                        | 760,613.490                                 |  |
|                 | AMBEV SA                         | 87,800 | 13.570                        | 1,191,446.000                               |  |
|                 | ブラジル・リアル 小計                      |        |                               | ブラジル・リアル<br>33,857,509.790<br>(718,794,933) |  |
| マレーシア・リ<br>ンギット | MISC BHD                         | 42,900 | 株<br>マレーシア・リンギッ<br>ト<br>8.220 | マレーシア・リンギッ<br>ト<br>352,638.000              |  |

|                |                                  |           |         |  |  |
|----------------|----------------------------------|-----------|---------|--|--|
|                | MALAYAN BANKING BHD              | 67,500    | 7.910   | 533,925.000                                  |  |
|                | PUBLIC BANK BERHAD               | 34,900    | 16.800  | 586,320.000                                  |  |
|                | CIMB GROUP HOLDINGS BHD          | 69,100    | 3.810   | 263,271.000                                  |  |
|                | TENAGA NASIONAL BHD              | 34,700    | 11.880  | 412,236.000                                  |  |
| マレーシア・リングット 小計 |                                  |           |         | マレーシア・リングット<br>2,148,390.000<br>(53,817,169) |  |
| メキシコ・ペソ        |                                  | 株         | メキシコ・ペソ | メキシコ・ペソ                                      |  |
|                | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV        | 13,400    | 98.720  | 1,322,848.000                                |  |
|                | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER<br>L  | 776,600   | 15.380  | 11,944,108.000                               |  |
|                | GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO       | 71,900    | 26.260  | 1,888,094.000                                |  |
|                | CEMEX SAB-CPO                    | 1,006,719 | 6.190   | 6,231,590.610                                |  |
|                | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-<br>UBD | 43,000    | 147.110 | 6,325,730.000                                |  |
|                | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE<br>CV  | 29,623    | 35.580  | 1,053,986.340                                |  |
|                | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER<br>B  | 64,800    | 53.210  | 3,448,008.000                                |  |
|                | WALMART DE MEXICO SAB DE CV      | 95,600    | 54.390  | 5,199,684.000                                |  |
|                | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O       | 64,800    | 78.310  | 5,074,488.000                                |  |
| メキシコ・ペソ 小計     |                                  |           |         | メキシコ・ペソ<br>42,488,536.950<br>(202,245,436)   |  |
| 香港・ドル          |                                  | 株         | 香港・ドル   | 香港・ドル  |  |
|                | CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-<br>H | 141,000   | 6.850   | 965,850.000                                  |  |
|                | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H        | 277,000   | 4.160   | 1,152,320.000                                |  |
|                | CHINA MERCHANTS PORT<br>HOLDING  | 40,000    | 9.850   | 394,000.000                                  |  |
|                | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS<br>LT  | 76,000    | 12.040  | 915,040.000                                  |  |
|                | CHINA EVERBRIGHT INTL LTD        | 110,000   | 4.130   | 454,300.000                                  |  |
|                | JIANGXI COPPER CO LTD-H          | 75,000    | 7.810   | 585,750.000                                  |  |
|                | BEIJING ENTERPRISES WATER<br>GR  | 140,000   | 2.950   | 413,000.000                                  |  |
|                | CHINA GAS HOLDINGS LTD           | 19,600    | 26.900  | 527,240.000                                  |  |
|                | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-<br>H | 1,743,800 | 3.410   | 5,946,358.000                                |  |

|                              |           |         |                |  |
|------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    | 15,500    | 26.650  | 413,075.000    |  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 106,000   | 5.420   | 574,520.000    |  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 98,000    | 5.050   | 494,900.000    |  |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 13,500    | 35.300  | 476,550.000    |  |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 93,000    | 10.140  | 943,020.000    |  |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 18,200    | 441.000 | 8,026,200.000  |  |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H     | 692,000   | 2.300   | 1,591,600.000  |  |
| AIR CHINA LTD-H              | 60,000    | 5.110   | 306,600.000    |  |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD   | 332,000   | 4.330   | 1,437,560.000  |  |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 47,000    | 33.100  | 1,555,700.000  |  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP  | 150,000   | 5.700   | 855,000.000    |  |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 58,000    | 9.350   | 542,300.000    |  |
| PETROCHINA CO LTD-H          | 1,258,000 | 2.660   | 3,346,280.000  |  |
| CNOOC LTD                    | 593,000   | 8.830   | 5,236,190.000  |  |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD   | 88,000    | 6.600   | 580,800.000    |  |
| HUANENG POWER INTL INC-H     | 338,000   | 2.850   | 963,300.000    |  |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 19,500    | 53.500  | 1,043,250.000  |  |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 115,000   | 4.210   | 484,150.000    |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 3,811,000 | 6.200   | 23,628,200.000 |  |
| CHINA MOBILE LTD             | 215,000   | 54.250  | 11,663,750.000 |  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 65,600    | 12.160  | 797,696.000    |  |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 538,000   | 3.400   | 1,829,200.000  |  |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | 30,600    | 8.310   | 254,286.000    |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H   | 28,400    | 12.600  | 357,840.000    |  |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 14,000    | 59.950  | 839,300.000    |  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 266,000   | 4.620   | 1,228,920.000  |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 70,000    | 3.720   | 260,400.000    |  |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H    | 142,000   | 2.310   | 328,020.000    |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 170,500   | 12.500  | 2,131,250.000  |  |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 26,000    | 15.440  | 401,440.000    |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 51,200    | 19.500  | 998,400.000    |  |

|                              |           |         |                |  |
|------------------------------|-----------|---------|----------------|--|
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 70,000    | 31.950  | 2,236,500.000  |  |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO   | 26,000    | 22.800  | 592,800.000    |  |
| YANZHOU COAL MINING CO-H     | 100,000   | 6.400   | 640,000.000    |  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 43,000    | 13.760  | 591,680.000    |  |
| BYD CO LTD-H                 | 8,000     | 51.500  | 412,000.000    |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 1,467,000 | 3.080   | 4,518,360.000  |  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 21,000    | 25.900  | 543,900.000    |  |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 212,000   | 2.400   | 508,800.000    |  |
| CITIC LTD                    | 88,000    | 7.810   | 687,280.000    |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 3,083,000 | 5.120   | 15,784,960.000 |  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | 582,000   | 1.490   | 867,180.000    |  |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | 91,600    | 12.800  | 1,172,480.000  |  |
| MEITUAN DIANPING-CLASS B     | 10,600    | 165.600 | 1,755,360.000  |  |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 42,000    | 14.700  | 617,400.000    |  |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 215,000   | 1.250   | 268,750.000    |  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 122,000   | 24.150  | 2,946,300.000  |  |
| CRRC CORP LTD - H            | 124,000   | 3.650   | 452,600.000    |  |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 311,000   | 4.790   | 1,489,690.000  |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 91,500    | 80.600  | 7,374,900.000  |  |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 29,000    | 34.500  | 1,000,500.000  |  |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 384,580   | 5.430   | 2,088,269.400  |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 220,000   | 9.890   | 2,175,800.000  |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 7,000     | 70.650  | 494,550.000    |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 40,900    | 25.000  | 1,022,500.000  |  |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 194,000   | 2.020   | 391,880.000    |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 56,000    | 6.690   | 374,640.000    |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 5,500     | 95.500  | 525,250.000    |  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 202,000   | 7.090   | 1,432,180.000  |  |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 107,500   | 5.450   | 585,875.000    |  |

|       |                              |           |         |   |  |
|-------|------------------------------|-----------|---------|---|--|
|       | WEICHAI POWER CO LTD-H       | 44,000    | 13.980  | 615,120.000                                 |  |
|       | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 268,000   | 1.500   | 402,000.000                                 |  |
|       | CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 64,600    | 21.700  | 1,401,820.000                               |  |
|       | SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 34,900    | 12.800  | 446,720.000                                 |  |
|       | CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 121,000   | 15.980  | 1,933,580.000                               |  |
|       | ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 10,000    | 91.350  | 913,500.000                                 |  |
|       | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 62,000    | 7.170   | 444,540.000                                 |  |
|       | KUNLUN ENERGY CO LTD         | 140,000   | 4.840   | 677,600.000                                 |  |
|       | GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H  | 80,400    | 8.950   | 719,580.000                                 |  |
|       | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 114,000   | 3.360   | 383,040.000                                 |  |
|       | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 230,000   | 8.830   | 2,030,900.000                               |  |
|       | BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 438,100   | 4.790   | 2,098,499.000                               |  |
|       | CHINA EVERGRANDE GROUP       | 80,000    | 19.420  | 1,553,600.000                               |  |
|       | AGILE GROUP HOLDINGS LTD     | 52,000    | 9.040   | 470,080.000                                 |  |
|       | GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 1,226,000 | 0.248   | 304,048.000                                 |  |
|       | CHINA MERCHANTS BANK-H       | 91,500    | 36.900  | 3,376,350.000                               |  |
|       | BANK OF CHINA LTD-H          | 3,386,000 | 2.900   | 9,819,400.000                               |  |
|       | CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 33,500    | 14.900  | 499,150.000                                 |  |
|       | CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 160,000   | 2.930   | 468,800.000                                 |  |
|       | HAITONG SECURITIES CO LTD-H  | 68,000    | 6.060   | 412,080.000                                 |  |
|       | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 30,000    | 36.650  | 1,099,500.000                               |  |
|       | 香港・ドル 小計                     |           |         | 香港・ドル<br>168,565,846.400<br>(2,332,951,314) |  |
| 台湾・ドル |                              | 株         | 台湾・ドル   | 台湾・ドル                                       |  |
|       | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO  | 20,000    | 103.500 | 2,070,000.000                               |  |
|       | TAIWAN CEMENT                | 127,232   | 42.900  | 5,458,252.800                               |  |
|       | ASIA CEMENT CORP             | 63,000    | 44.050  | 2,775,150.000                               |  |
|       | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 94,000    | 66.300  | 6,232,200.000                               |  |
|       | THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 42,000    | 44.500  | 1,869,000.000                               |  |
|       | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 82,112    | 72.000  | 5,912,064.000                               |  |

|                                 |         |           |                |  |
|---------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| FORMOSA PLASTICS CORP           | 49,600  | 86.400    | 4,285,440.000  |  |
| NAN YA PLASTICS CORP            | 44,140  | 65.300    | 2,882,342.000  |  |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE       | 43,390  | 74.200    | 3,219,538.000  |  |
| CHINA STEEL CORP                | 97,686  | 20.650    | 2,017,215.900  |  |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD         | 3,000   | 678.000   | 2,034,000.000  |  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP         | 58,616  | 50.800    | 2,977,692.800  |  |
| DELTA ELECTRONICS INC           | 47,000  | 155.000   | 7,285,000.000  |  |
| YAGEO CORPORATION               | 6,000   | 381.000   | 2,286,000.000  |  |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD       | 30,000  | 53.800    | 1,614,000.000  |  |
| QUANTA COMPUTER INC             | 85,000  | 67.800    | 5,763,000.000  |  |
| AU OPTRONICS CORP               | 745,000 | 9.100     | 6,779,500.000  |  |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD         | 88,400  | 113.000   | 9,989,200.000  |  |
| MEDIATEK INC                    | 28,003  | 492.500   | 13,791,477.500 |  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD       | 23,000  | 219.000   | 5,037,000.000  |  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO      | 123,411 | 43.250    | 5,337,525.750  |  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO     | 154,838 | 40.700    | 6,301,906.600  |  |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL     | 224,000 | 9.160     | 2,051,840.000  |  |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO      | 144,027 | 27.650    | 3,982,346.550  |  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO     | 138,828 | 17.850    | 2,478,079.800  |  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO<br>LT | 158,993 | 31.500    | 5,008,279.500  |  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING       | 128,768 | 13.200    | 1,699,737.600  |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING     | 419,334 | 8.530     | 3,576,919.020  |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS      | 167,000 | 11.200    | 1,870,400.000  |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO<br>LT | 272,028 | 20.200    | 5,494,965.600  |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO      | 119,172 | 22.850    | 2,723,080.200  |  |
| LARGAN PRECISION CO LTD         | 1,000   | 4,140.000 | 4,140,000.000  |  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS<br>COR | 11,000  | 213.500   | 2,348,500.000  |  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD            | 31,000  | 107.500   | 3,332,500.000  |  |
| WISTRON CORP                    | 129,110 | 30.700    | 3,963,677.000  |  |
| INNOLUX CORP                    | 966,000 | 7.790     | 7,525,140.000  |  |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD     | 31,000  | 68.000    | 2,108,000.000  |  |
| PEGATRON CORP                   | 63,000  | 69.100    | 4,353,300.000  |  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY<br>HOLDING | 15,000  | 133.500   | 2,002,500.000  |  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD        | 20,646  | 124.000   | 2,560,104.000  |  |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC        | 19,400  | 99.200    | 1,924,480.000  |  |

|               |                                 |         |           |   |  |
|---------------|---------------------------------|---------|-----------|---|--|
|               | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP      | 32,000  | 91.000    | 2,912,000.000                               |  |
|               | COMPAL ELECTRONICS              | 107,000 | 18.900    | 2,022,300.000                               |  |
|               | TAIWAN SEMICONDUCTOR<br>MANUFAC | 266,000 | 316.000   | 84,056,000.000                              |  |
|               | HON HAI PRECISION INDUSTRY      | 367,902 | 78.000    | 28,696,356.000                              |  |
|               | PRESIDENT CHAIN STORE CORP      | 8,000   | 296.000   | 2,368,000.000                               |  |
|               | ASUSTEK COMPUTER INC            | 13,760  | 226.000   | 3,109,760.000                               |  |
|               | FAR EASTERN NEW CENTURY<br>CORP | 69,000  | 27.450    | 1,894,050.000                               |  |
|               | UNITED MICROELECTRONICS<br>CORP | 458,000 | 15.700    | 7,190,600.000                               |  |
| 台湾・ドル         | 小計                              |         |           | 台湾・ドル<br>301,310,420.620<br>(1,087,730,618) |  |
| 南アフリカ・ラ<br>ンド |                                 | 株       | 南アフリカ・ランド | 南アフリカ・ランド                                   |  |
|               | GOLD FIELDS LTD                 | 15,420  | 132.570   | 2,044,229.400                               |  |
|               | NEPI ROCKCASTLE PLC             | 7,500   | 86.370    | 647,775.000                                 |  |
|               | MULTICHOICE GROUP LTD           | 12,730  | 103.360   | 1,315,772.800                               |  |
|               | OLD MUTUAL LTD                  | 169,540 | 12.740    | 2,159,939.600                               |  |
|               | VODACOM GROUP LTD               | 17,120  | 128.180   | 2,194,441.600                               |  |
|               | SHOPRITE HOLDINGS LTD           | 22,720  | 106.620   | 2,422,406.400                               |  |
|               | NEDBANK GROUP LTD               | 11,900  | 115.220   | 1,371,118.000                               |  |
|               | BIDVEST GROUP LTD               | 8,870   | 149.960   | 1,330,145.200                               |  |
|               | BID CORP LTD                    | 7,310   | 263.500   | 1,926,185.000                               |  |
|               | NETCARE LTD                     | 56,690  | 13.860    | 785,723.400                                 |  |
|               | STANDARD BANK GROUP LTD         | 36,420  | 111.150   | 4,048,083.000                               |  |
|               | SASOL LTD                       | 23,640  | 139.950   | 3,308,418.000                               |  |
|               | REMGRO LTD                      | 12,410  | 110.000   | 1,365,100.000                               |  |
|               | DISCOVERY LTD                   | 8,940   | 108.500   | 969,990.000                                 |  |
|               | EXXARO RESOURCES LTD            | 8,030   | 137.180   | 1,101,555.400                               |  |
|               | TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD     | 21,020  | 37.710    | 792,664.200                                 |  |
|               | SANLAM LTD                      | 42,720  | 60.000    | 2,563,200.000                               |  |
|               | TIGER BRANDS LTD                | 6,680   | 172.900   | 1,154,972.000                               |  |
|               | RMB HOLDINGS LTD                | 8,679   | 57.800    | 501,646.200                                 |  |
|               | FIRSTRAND LTD                   | 88,930  | 43.670    | 3,883,573.100                               |  |
|               | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD         | 39,960  | 33.540    | 1,340,258.400                               |  |
|               | THE FOSCHINI GROUP LTD          | 7,840   | 72.740    | 570,281.600                                 |  |
|               | ABSA GROUP LTD                  | 25,460  | 96.010    | 2,444,414.600                               |  |
|               | NASPERS LTD-N SHS               | 1,729   | 2,980.000 | 5,152,420.000                               |  |

|                              |        |         |  |  |
|------------------------------|--------|---------|--|--|
| MTN GROUP LTD                | 38,590 | 52.530  | 2,027,132.700                                |  |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 6,430  | 120.430 | 774,364.900                                  |  |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 13,280 | 140.700 | 1,868,496.000                                |  |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 5,450  | 427.740 | 2,331,183.000                                |  |
| SAPPI LIMITED                | 47,080 | 28.980  | 1,364,378.400                                |  |
| TELKOM SA SOC LTD            | 35,000 | 23.660  | 828,100.000                                  |  |
| SPAR GROUP LIMITED/THE       | 7,770  | 177.620 | 1,380,107.400                                |  |
| MR PRICE GROUP LTD           | 5,900  | 143.900 | 849,010.000                                  |  |
| SIBANYE STILLWATER LTD       | 26,500 | 34.950  | 926,175.000                                  |  |
| 南アフリカ・ランド 小計                 |        |         | 南アフリカ・ランド<br>57,743,260.300<br>(360,317,944) |  |
| 合計                           |        |         | 7,422,789,977<br>[7,422,789,977]             |  |

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類      | 通貨        | 銘柄                           | 券面総額    | 評価額  | 備考 |
|---------|-----------|------------------------------|---------|--|----|
| 投資証券    | アメリカ・ドル   | INVESCO FTSE RAFI EMERGING M | 587,000 | アメリカ・ドル<br>10,360,550.000                    |    |
|         | アメリカ・ドル   | 小計                           |         | アメリカ・ドル<br>10,360,550.000<br>(1,111,065,382) |    |
|         | メキシコ・ペソ   | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA  | 80,200  | メキシコ・ペソ<br>1,633,674.000                     |    |
|         | メキシコ・ペソ   | 小計                           |         | メキシコ・ペソ<br>1,633,674.000<br>(7,776,288)      |    |
|         | 南アフリカ・ランド | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD   | 76,930  | 南アフリカ・ランド<br>1,148,564.900                   |    |
|         | 南アフリカ・ランド | 小計                           |         | 南アフリカ・ランド<br>1,148,564.900<br>(7,167,045)    |    |
| 投資証券 合計 |           |                              |         | 1,126,008,715<br>[1,126,008,715]             |    |
| 合計      |           |                              |         | 1,126,008,715<br>[1,126,008,715]             |    |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

| 通貨           | 銘柄数                 | 組入株式<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|--------------|---------------------|--------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル      | 株式 30銘柄<br>投資証券 1銘柄 | 48.4%        | 51.6%              | 25.2%          |
| インド・ルピー      | 株式 39銘柄             | 100%         | -%                 | 6.5%           |
| インドネシア・ルピア   | 株式 6銘柄              | 100%         | -%                 | 1.0%           |
| オフショア・人民元    | 株式 48銘柄             | 100%         | -%                 | 3.7%           |
| サウジアラビア・リアル  | 株式 12銘柄             | 100%         | -%                 | 2.2%           |
| シンガポール・ドル    | 株式 1銘柄              | 100%         | -%                 | 0.1%           |
| タイ・バーツ       | 株式 17銘柄             | 100%         | -%                 | 3.4%           |
| チリ・ペソ        | 株式 5銘柄              | 100%         | -%                 | 0.6%           |
| トルコ・リラ       | 株式 12銘柄             | 100%         | -%                 | 1.6%           |
| ブラジル・リアル     | 株式 43銘柄             | 100%         | -%                 | 8.4%           |
| マレーシア・リングgit | 株式 5銘柄              | 100%         | -%                 | 0.6%           |
| メキシコ・ペソ      | 株式 9銘柄<br>投資証券 1銘柄  | 96.3%        | 3.7%               | 2.5%           |
| 香港・ドル        | 株式 90銘柄             | 100%         | -%                 | 27.2%          |
| 台湾・ドル        | 株式 49銘柄             | 100%         | -%                 | 12.7%          |
| 南アフリカ・ランド    | 株式 33銘柄<br>投資証券 1銘柄 | 98.0%        | 2.0%               | 4.3%           |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2019年6月18日から2020年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 58,479,756          | 107,244,297         |
| 親投資信託受益証券       | 27,345,256,937      | 33,307,008,758      |
| 流動資産合計          | 27,403,736,693      | 33,414,253,055      |
| 資産合計            | 27,403,736,693      | 33,414,253,055      |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 11,495,232          | 49,257,065          |
| 未払受託者報酬         | 1,424,362           | 1,793,161           |
| 未払委託者報酬         | 17,804,946          | 22,415,110          |
| その他未払費用         | 720,048             | 896,677             |
| 流動負債合計          | 31,444,588          | 74,362,013          |
| 負債合計            | 31,444,588          | 74,362,013          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 26,970,241,880    | 1 33,258,556,611    |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 402,050,225         | 81,334,431          |
| （分配準備積立金）       | 680,324,762         | 520,762,855         |
| 元本等合計           | 27,372,292,105      | 33,339,891,042      |
| 純資産合計           | 27,372,292,105      | 33,339,891,042      |
| 負債純資産合計         | 27,403,736,693      | 33,414,253,055      |

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |             | 第4期                          |             |
|---|------------------------------|-------------|------------------------------|-------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |             |
| <b>営業収益</b>                               |                              |             |                              |             |
| 受取利息                                      |                              | 22          |                              | 968         |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 667,413,051 |                              | 367,186,776 |
| 営業収益合計                                    |                              | 667,413,073 |                              | 367,185,808 |
| <b>営業費用</b>                               |                              |             |                              |             |
| 支払利息                                      |                              | 44,511      |                              | 36,377      |
| 受託者報酬                                     |                              | 2,860,177   |                              | 3,373,050   |
| 委託者報酬                                     |                              | 35,753,275  |                              | 42,164,333  |
| その他費用                                     |                              | 1,435,679   |                              | 1,694,994   |
| 営業費用合計                                    |                              | 40,093,642  |                              | 47,268,754  |
| 営業利益又は営業損失( )                             |                              | 627,319,431 |                              | 414,454,562 |
| 経常利益又は経常損失( )                             |                              | 627,319,431 |                              | 414,454,562 |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |                              | 627,319,431 |                              | 414,454,562 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |                              | 36,031,343  |                              | 25,487,970  |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |                              | 214,956,463 |                              | 402,050,225 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |                              | 72,577,897  |                              | 189,382,554 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 72,577,897  |                              | -           |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | -           |                              | 189,382,554 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                              | 46,859,297  |                              | 121,131,756 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | -           |                              | 121,131,756 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | 46,859,297  |                              | -           |
| 分配金                                       |                              | 1 -         |                              | 1 -         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |                              | 402,050,225 |                              | 81,334,431  |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期             | 第4期             |
|---------------------|-----------------|-----------------|
|                     | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
| 1. 1 期首元本額          | 25,335,886,514円 | 26,970,241,880円 |
| 期中追加設定元本額           | 9,926,740,515円  | 14,370,293,804円 |
| 期中一部解約元本額           | 8,292,385,149円  | 8,081,979,073円  |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 26,970,241,880口 | 33,258,556,611口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(591,308,207円)、投資信託約款に規定される収益調整金(40,607,892円)及び分配準備積立金(89,016,555円)より分配対象額は720,932,654円(1万口当たり267.31円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(368,252,651円)及び分配準備積立金(520,762,855円)より分配対象額は889,015,506円(1万口当たり267.30円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>                                       |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 642,477,378              | 355,209,070              |
| 合計        | 642,477,378              | 355,209,070              |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0149円<br>(10,149円) | 1.0024円<br>(10,024円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄               | 券面総額           | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|--------------|-------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 日本債券インデックスマザーファンド | 23,424,297,601 | 33,307,008,758 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                   |                | 33,307,008,758 |    |
| 合計           |                   |                | 33,307,008,758 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金 額 (円)      | 金 額 (円)      |
| 資産の部 |              |              |
| 流動資産 |              |              |

|                 |                  |                |
|-----------------|------------------|----------------|
| コール・ローン         | 360,887,346      | 620,052,568    |
| 国債証券            | 69,574,913,070   | 87,708,826,340 |
| 地方債証券           | 4,268,356,600    | 4,340,851,300  |
| 特殊債券            | 3,042,776,500    | 3,306,333,300  |
| 社債券             | 3,220,570,700    | 2,671,610,000  |
| 未収利息            | 214,730,664      | 224,798,960    |
| 前払費用            | 7,066,913        | 16,895,375     |
| 流動資産合計          | 80,689,301,793   | 98,889,367,843 |
| 資産合計            | 80,689,301,793   | 98,889,367,843 |
| 負債の部            |                  |                |
| 流動負債            |                  |                |
| 未払金             | 121,902,500      | 376,905,600    |
| 未払解約金           | 92,742,073       | 3,772,285      |
| その他未払費用         | -                | 1,044          |
| 流動負債合計          | 214,644,573      | 380,678,929    |
| 負債合計            | 214,644,573      | 380,678,929    |
| 純資産の部           |                  |                |
| 元本等             |                  |                |
| 元本              | 1 55,985,054,926 | 69,278,918,714 |
| 剰余金             |                  |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 24,489,602,294   | 29,229,770,200 |
| 元本等合計           | 80,474,657,220   | 98,508,688,914 |
| 純資産合計           | 80,474,657,220   | 98,508,688,914 |
| 負債純資産合計         | 80,689,301,793   | 98,889,367,843 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                 |                              |
|-----------------|------------------------------|
| 区 分             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券         |

|  |  |
|--|--|
|  | <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
|--|--|

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                          | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
|------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首                      | 2018年6月16日      | 2019年6月18日      |
| 期首元本額                        | 53,122,088,329円 | 55,985,054,926円 |
| 期中追加設定元本額                    | 13,594,968,519円 | 33,429,197,062円 |
| 期中一部解約元本額                    | 10,732,001,922円 | 20,135,333,274円 |
| 期末元本額の内訳                     |                 |                 |
| ファンド名                        |                 |                 |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 110,544,053円    | 94,250,066円     |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 667,506,184円    | 543,945,103円    |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 81,173,073円     | 68,129,248円     |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 934,094,036円    | 733,380,244円    |
| DCダイワ日本債券インデックス              | 6,683,254,527円  | 7,907,898,882円  |
| ダイワ・バランスファンド35VA             | 11,850,024,585円 | 10,244,117,584円 |
| ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)  | 1,979,999,931円  | 1,837,765,507円  |
| ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用) | 271,217,036円    | 242,209,209円    |

|                                  |                 |                 |
|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワ国内バランスファンド<br>30VA(適格機関投資家専用) | 377,796,020円    | 351,662,678円    |
| ダイワ・ノーロード 日本債券<br>ファンド           | 76,456,533円     | 78,373,970円     |
| ダイワファンドラップ 日本<br>債券インデックス        | 19,024,110,851円 | 23,424,297,601円 |
| ダイワ日本債券インデックス<br>(ダイワSMA専用)      | 3,556,309,557円  | 13,064,603,650円 |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 日本債券インデックス   | 1,464,191,094円  | 1,590,741,522円  |
| ダイワ・インデックスセレクト<br>日本債券           | 1,188,807,626円  | 1,114,983,405円  |
| ダイワ投信倶楽部日本債券イ<br>ンデックス           | 6,681,339,672円  | 6,929,593,267円  |
| ダイワライフスタイル25                     | 436,056,658円    | 428,801,797円    |
| ダイワライフスタイル50                     | 471,431,380円    | 504,023,654円    |
| ダイワライフスタイル75                     | 130,742,110円    | 120,141,327円    |
| 計                                | 55,985,054,926円 | 69,278,918,714円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                 | 55,985,054,926口 | 69,278,918,714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6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。  |

|                                |  |
|--------------------------------|--|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>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                          | 2020年6月15日現在  |
|------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類   | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|-------|------------------------|------------------------|
|       | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 国債証券  | 1,750,414,970          | 789,513,120            |
| 地方債証券 | 33,470,900             | 21,563,600             |
| 特殊債券  | 21,243,900             | 16,998,900             |
| 社債券   | 16,769,600             | 23,128,800             |
| 合計    | 1,821,899,370          | 851,204,420            |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年12月1日から2019年6月17日まで、及び2019年12月3日から2020年6月15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

| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## (1口当たり情報)

|              | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.4374円      | 1.4219円      |
| (1万口当たり純資産額) | (14,374円)    | (14,219円)    |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類  | 銘 柄        | 券面総額<br>(円)   | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|------|------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 4 0 2 2年国債 | 150,000,000   | 150,429,000   |    |
|      | 4 0 5 2年国債 | 150,000,000   | 150,534,000   |    |
|      | 4 0 6 2年国債 | 700,000,000   | 702,653,000   |    |
|      | 4 0 7 2年国債 | 100,000,000   | 100,395,000   |    |
|      | 4 0 8 2年国債 | 150,000,000   | 150,627,000   |    |
|      | 4 0 9 2年国債 | 1,100,000,000 | 1,104,851,000 |    |
|      | 4 1 0 2年国債 | 2,000,000,000 | 2,009,240,000 |    |
|      | 1 2 9 5年国債 | 540,000,000   | 541,809,000   |    |
|      | 1 3 0 5年国債 | 680,000,000   | 682,781,200   |    |
|      | 1 3 1 5年国債 | 1,170,000,000 | 1,175,463,900 |    |
|      | 1 3 2 5年国債 | 880,000,000   | 884,699,200   |    |
|      | 1 3 3 5年国債 | 550,000,000   | 553,245,000   |    |
|      | 1 3 4 5年国債 | 470,000,000   | 473,078,500   |    |
|      | 1 3 5 5年国債 | 2,820,000,000 | 2,840,304,000 |    |
|      | 1 3 6 5年国債 | 950,000,000   | 957,467,000   |    |
|      | 1 3 7 5年国債 | 700,000,000   | 705,852,000   |    |
|      | 1 3 8 5年国債 | 900,000,000   | 907,938,000   |    |
|      | 1 3 9 5年国債 | 700,000,000   | 706,475,000   |    |
|      | 1 4 0 5年国債 | 600,000,000   | 605,808,000   |    |
|      | 1 4 1 5年国債 | 920,000,000   | 929,264,400   |    |
|      | 1 4 2 5年国債 | 1,750,000,000 | 1,767,867,500 |    |
|      | 1 4 3 5年国債 | 520,000,000   | 525,470,400   |    |
|      | 1 4 0年国債   | 70,000,000    | 104,586,300   |    |
|      | 2 4 0年国債   | 110,000,000   | 160,035,700   |    |
|      | 3 4 0年国債   | 150,000,000   | 220,045,500   |    |
|      | 4 4 0年国債   | 107,000,000   | 158,448,810   |    |
|      | 5 4 0年国債   | 125,000,000   | 179,336,250   |    |
|      | 6 4 0年国債   | 105,000,000   | 148,678,950   |    |
|      | 7 4 0年国債   | 121,000,000   | 165,083,930   |    |
|      | 8 4 0年国債   | 230,000,000   | 293,907,800   |    |

|     |       |               |               |  |
|-----|-------|---------------|---------------|--|
| 9   | 40年国債 | 220,000,000   | 211,083,400   |  |
| 10  | 40年国債 | 275,000,000   | 309,155,000   |  |
| 11  | 40年国債 | 320,000,000   | 349,936,000   |  |
| 12  | 40年国債 | 620,000,000   | 614,017,000   |  |
| 13  | 40年国債 | 230,000,000   | 227,359,600   |  |
| 317 | 10年国債 | 214,000,000   | 217,426,140   |  |
| 318 | 10年国債 | 200,000,000   | 202,948,000   |  |
| 319 | 10年国債 | 100,000,000   | 101,925,000   |  |
| 320 | 10年国債 | 230,000,000   | 234,077,900   |  |
| 321 | 10年国債 | 175,000,000   | 178,596,250   |  |
| 322 | 10年国債 | 130,000,000   | 132,441,400   |  |
| 323 | 10年国債 | 380,000,000   | 388,162,400   |  |
| 325 | 10年国債 | 310,000,000   | 316,758,000   |  |
| 326 | 10年国債 | 30,000,000    | 30,650,700    |  |
| 327 | 10年国債 | 450,000,000   | 460,894,500   |  |
| 328 | 10年国債 | 350,000,000   | 357,371,000   |  |
| 329 | 10年国債 | 500,000,000   | 514,440,000   |  |
| 330 | 10年国債 | 612,000,000   | 631,167,840   |  |
| 331 | 10年国債 | 365,000,000   | 374,037,400   |  |
| 332 | 10年国債 | 250,000,000   | 256,620,000   |  |
| 333 | 10年国債 | 700,000,000   | 719,705,000   |  |
| 334 | 10年国債 | 900,000,000   | 926,856,000   |  |
| 335 | 10年国債 | 690,000,000   | 708,933,600   |  |
| 336 | 10年国債 | 275,000,000   | 282,925,500   |  |
| 337 | 10年国債 | 400,000,000   | 407,804,000   |  |
| 338 | 10年国債 | 580,000,000   | 594,575,400   |  |
| 339 | 10年国債 | 590,000,000   | 605,463,900   |  |
| 340 | 10年国債 | 760,000,000   | 781,135,600   |  |
| 341 | 10年国債 | 1,500,000,000 | 1,535,370,000 |  |
| 342 | 10年国債 | 1,080,000,000 | 1,094,094,000 |  |
| 343 | 10年国債 | 920,000,000   | 932,530,400   |  |
| 344 | 10年国債 | 820,000,000   | 831,644,000   |  |
| 345 | 10年国債 | 850,000,000   | 862,265,500   |  |
| 346 | 10年国債 | 700,000,000   | 710,493,000   |  |
| 347 | 10年国債 | 950,000,000   | 964,772,500   |  |
| 348 | 10年国債 | 550,000,000   | 558,657,000   |  |
| 349 | 10年国債 | 1,050,000,000 | 1,066,695,000 |  |
| 350 | 10年国債 | 430,000,000   | 436,720,900   |  |
| 351 | 10年国債 | 800,000,000   | 812,264,000   |  |

|     |       |               |               |
|-----|-------|---------------|---------------|
| 352 | 10年国債 | 690,000,000   | 700,329,300   |
| 353 | 10年国債 | 750,000,000   | 760,590,000   |
| 354 | 10年国債 | 600,000,000   | 607,914,000   |
| 355 | 10年国債 | 760,000,000   | 769,272,000   |
| 356 | 10年国債 | 510,000,000   | 515,676,300   |
| 357 | 10年国債 | 1,000,000,000 | 1,010,470,000 |
| 358 | 10年国債 | 590,000,000   | 595,752,500   |
| 1   | 30年国債 | 16,000,000    | 20,168,480    |
| 2   | 30年国債 | 24,000,000    | 29,591,040    |
| 3   | 30年国債 | 30,000,000    | 36,830,400    |
| 4   | 30年国債 | 36,000,000    | 46,742,760    |
| 5   | 30年国債 | 28,000,000    | 34,522,880    |
| 6   | 30年国債 | 24,000,000    | 30,323,760    |
| 7   | 30年国債 | 55,000,000    | 69,301,100    |
| 8   | 30年国債 | 27,000,000    | 32,557,680    |
| 9   | 30年国債 | 43,000,000    | 49,754,010    |
| 10  | 30年国債 | 45,000,000    | 50,446,350    |
| 11  | 30年国債 | 40,000,000    | 47,973,200    |
| 12  | 30年国債 | 60,000,000    | 75,263,400    |
| 13  | 30年国債 | 75,000,000    | 93,313,500    |
| 14  | 30年国債 | 82,000,000    | 106,727,920   |
| 15  | 30年国債 | 50,000,000    | 65,943,000    |
| 16  | 30年国債 | 250,000,000   | 330,652,500   |
| 17  | 30年国債 | 130,000,000   | 170,574,300   |
| 18  | 30年国債 | 80,000,000    | 104,084,000   |
| 19  | 30年国債 | 57,000,000    | 74,390,130    |
| 21  | 30年国債 | 60,000,000    | 78,720,000    |
| 22  | 30年国債 | 170,000,000   | 228,859,100   |
| 24  | 30年国債 | 92,000,000    | 124,543,160   |
| 25  | 30年国債 | 150,000,000   | 198,919,500   |
| 26  | 30年国債 | 180,000,000   | 242,247,600   |
| 27  | 30年国債 | 150,000,000   | 205,342,500   |
| 28  | 30年国債 | 170,000,000   | 234,044,100   |
| 29  | 30年国債 | 200,000,000   | 273,430,000   |
| 30  | 30年国債 | 220,000,000   | 298,139,600   |
| 31  | 30年国債 | 300,000,000   | 403,431,000   |
| 32  | 30年国債 | 285,000,000   | 390,230,550   |
| 33  | 30年国債 | 311,000,000   | 410,031,730   |
| 34  | 30年国債 | 270,000,000   | 368,091,000   |

|    |       |             |             |  |
|----|-------|-------------|-------------|--|
| 35 | 30年国債 | 300,000,000 | 398,748,000 |  |
| 36 | 30年国債 | 350,000,000 | 467,236,000 |  |
| 37 | 30年国債 | 400,000,000 | 527,504,000 |  |
| 38 | 30年国債 | 200,000,000 | 260,308,000 |  |
| 39 | 30年国債 | 192,000,000 | 254,563,200 |  |
| 40 | 30年国債 | 200,000,000 | 260,978,000 |  |
| 41 | 30年国債 | 170,000,000 | 218,433,000 |  |
| 42 | 30年国債 | 176,000,000 | 226,378,240 |  |
| 43 | 30年国債 | 200,000,000 | 257,804,000 |  |
| 44 | 30年国債 | 200,000,000 | 258,072,000 |  |
| 45 | 30年国債 | 200,000,000 | 249,110,000 |  |
| 46 | 30年国債 | 140,000,000 | 174,496,000 |  |
| 47 | 30年国債 | 400,000,000 | 508,556,000 |  |
| 48 | 30年国債 | 290,000,000 | 355,313,800 |  |
| 49 | 30年国債 | 120,000,000 | 147,098,400 |  |
| 50 | 30年国債 | 400,000,000 | 432,316,000 |  |
| 51 | 30年国債 | 240,000,000 | 230,008,800 |  |
| 52 | 30年国債 | 300,000,000 | 302,103,000 |  |
| 53 | 30年国債 | 250,000,000 | 257,660,000 |  |
| 54 | 30年国債 | 365,000,000 | 394,565,000 |  |
| 55 | 30年国債 | 260,000,000 | 280,898,800 |  |
| 56 | 30年国債 | 300,000,000 | 324,315,000 |  |
| 57 | 30年国債 | 230,000,000 | 248,489,700 |  |
| 58 | 30年国債 | 370,000,000 | 399,489,000 |  |
| 59 | 30年国債 | 300,000,000 | 316,296,000 |  |
| 60 | 30年国債 | 210,000,000 | 232,528,800 |  |
| 61 | 30年国債 | 200,000,000 | 210,770,000 |  |
| 62 | 30年国債 | 200,000,000 | 200,000,000 |  |
| 63 | 30年国債 | 230,000,000 | 223,606,000 |  |
| 64 | 30年国債 | 330,000,000 | 320,347,500 |  |
| 65 | 30年国債 | 100,000,000 | 97,053,000  |  |
| 66 | 30年国債 | 320,000,000 | 310,502,400 |  |
| 52 | 20年国債 | 52,000,000  | 53,497,080  |  |
| 53 | 20年国債 | 66,000,000  | 68,265,780  |  |
| 54 | 20年国債 | 65,000,000  | 67,330,250  |  |
| 55 | 20年国債 | 140,000,000 | 145,355,000 |  |
| 58 | 20年国債 | 200,000,000 | 209,356,000 |  |
| 59 | 20年国債 | 45,000,000  | 47,110,950  |  |
| 60 | 20年国債 | 10,000,000  | 10,393,500  |  |

|       |         |             |             |  |
|-------|---------|-------------|-------------|--|
| 6 1   | 2 0 年国債 | 100,000,000 | 103,214,000 |  |
| 6 2   | 2 0 年国債 | 95,000,000  | 97,743,600  |  |
| 6 3   | 2 0 年国債 | 130,000,000 | 137,688,200 |  |
| 6 4   | 2 0 年国債 | 90,000,000  | 96,049,800  |  |
| 6 5   | 2 0 年国債 | 175,000,000 | 187,633,250 |  |
| 6 6   | 2 0 年国債 | 185,000,000 | 197,702,100 |  |
| 6 7   | 2 0 年国債 | 55,000,000  | 59,239,400  |  |
| 6 8   | 2 0 年国債 | 120,000,000 | 130,610,400 |  |
| 6 9   | 2 0 年国債 | 110,000,000 | 119,310,400 |  |
| 7 0   | 2 0 年国債 | 83,000,000  | 91,485,090  |  |
| 7 1   | 2 0 年国債 | 125,000,000 | 136,770,000 |  |
| 7 2   | 2 0 年国債 | 105,000,000 | 115,061,100 |  |
| 7 3   | 2 0 年国債 | 120,000,000 | 131,571,600 |  |
| 7 4   | 2 0 年国債 | 73,000,000  | 80,370,080  |  |
| 7 5   | 2 0 年国債 | 80,000,000  | 88,500,000  |  |
| 7 6   | 2 0 年国債 | 51,000,000  | 55,930,680  |  |
| 7 7   | 2 0 年国債 | 130,000,000 | 143,189,800 |  |
| 7 8   | 2 0 年国債 | 61,000,000  | 67,194,550  |  |
| 7 9   | 2 0 年国債 | 50,000,000  | 55,329,500  |  |
| 8 0   | 2 0 年国債 | 53,000,000  | 58,916,390  |  |
| 8 1   | 2 0 年国債 | 76,000,000  | 84,533,280  |  |
| 8 2   | 2 0 年国債 | 87,000,000  | 97,229,460  |  |
| 8 3   | 2 0 年国債 | 93,000,000  | 104,455,740 |  |
| 8 5   | 2 0 年国債 | 58,000,000  | 65,485,480  |  |
| 8 6   | 2 0 年国債 | 80,000,000  | 91,252,800  |  |
| 8 7   | 2 0 年国債 | 55,000,000  | 62,417,300  |  |
| 8 8   | 2 0 年国債 | 100,000,000 | 114,652,000 |  |
| 8 9   | 2 0 年国債 | 78,000,000  | 88,955,880  |  |
| 9 0   | 2 0 年国債 | 20,000,000  | 22,928,000  |  |
| 9 1   | 2 0 年国債 | 60,000,000  | 69,162,600  |  |
| 9 2   | 2 0 年国債 | 310,000,000 | 355,052,300 |  |
| 9 3   | 2 0 年国債 | 100,000,000 | 114,407,000 |  |
| 9 4   | 2 0 年国債 | 130,000,000 | 149,614,400 |  |
| 9 5   | 2 0 年国債 | 50,000,000  | 58,534,500  |  |
| 9 6   | 2 0 年国債 | 55,000,000  | 63,610,250  |  |
| 9 7   | 2 0 年国債 | 40,000,000  | 46,764,800  |  |
| 9 8   | 2 0 年国債 | 320,000,000 | 371,776,000 |  |
| 9 9   | 2 0 年国債 | 100,000,000 | 116,696,000 |  |
| 1 0 0 | 2 0 年国債 | 155,000,000 | 182,803,900 |  |

|     |       |             |               |  |
|-----|-------|-------------|---------------|--|
| 101 | 20年国債 | 350,000,000 | 418,257,000   |  |
| 103 | 20年国債 | 170,000,000 | 202,702,900   |  |
| 104 | 20年国債 | 10,000,000  | 11,762,300    |  |
| 105 | 20年国債 | 126,000,000 | 148,785,840   |  |
| 106 | 20年国債 | 150,000,000 | 178,372,500   |  |
| 107 | 20年国債 | 90,000,000  | 106,632,900   |  |
| 108 | 20年国債 | 462,000,000 | 539,472,780   |  |
| 109 | 20年国債 | 55,000,000  | 64,406,650    |  |
| 110 | 20年国債 | 260,000,000 | 309,041,200   |  |
| 111 | 20年国債 | 200,000,000 | 240,406,000   |  |
| 112 | 20年国債 | 150,000,000 | 178,948,500   |  |
| 113 | 20年国債 | 310,000,000 | 370,989,400   |  |
| 114 | 20年国債 | 70,000,000  | 84,063,000    |  |
| 115 | 20年国債 | 180,000,000 | 217,875,600   |  |
| 116 | 20年国債 | 200,000,000 | 242,938,000   |  |
| 117 | 20年国債 | 900,000,000 | 1,084,437,000 |  |
| 118 | 20年国債 | 95,000,000  | 113,905,950   |  |
| 119 | 20年国債 | 93,000,000  | 109,647,930   |  |
| 120 | 20年国債 | 280,000,000 | 324,522,800   |  |
| 121 | 20年国債 | 200,000,000 | 238,386,000   |  |
| 122 | 20年国債 | 160,000,000 | 189,072,000   |  |
| 123 | 20年国債 | 200,000,000 | 243,256,000   |  |
| 124 | 20年国債 | 300,000,000 | 361,743,000   |  |
| 125 | 20年国債 | 130,000,000 | 159,994,900   |  |
| 126 | 20年国債 | 110,000,000 | 133,025,200   |  |
| 127 | 20年国債 | 165,000,000 | 197,770,650   |  |
| 128 | 20年国債 | 150,000,000 | 180,190,500   |  |
| 129 | 20年国債 | 230,000,000 | 273,775,900   |  |
| 130 | 20年国債 | 140,000,000 | 167,064,800   |  |
| 131 | 20年国債 | 150,000,000 | 177,322,500   |  |
| 133 | 20年国債 | 430,000,000 | 514,366,000   |  |
| 134 | 20年国債 | 650,000,000 | 779,330,500   |  |
| 135 | 20年国債 | 92,000,000  | 109,234,360   |  |
| 136 | 20年国債 | 145,000,000 | 170,476,500   |  |
| 138 | 20年国債 | 100,000,000 | 116,615,000   |  |
| 139 | 20年国債 | 370,000,000 | 435,867,400   |  |
| 140 | 20年国債 | 400,000,000 | 476,952,000   |  |
| 141 | 20年国債 | 200,000,000 | 238,954,000   |  |
| 142 | 20年国債 | 240,000,000 | 289,701,600   |  |

|         |          |             |                |             |  |
|---------|----------|-------------|----------------|-------------|--|
| 143     | 20年国債    | 210,000,000 | 248,742,900    |             |  |
| 144     | 20年国債    | 200,000,000 | 234,388,000    |             |  |
| 145     | 20年国債    | 380,000,000 | 455,745,400    |             |  |
| 146     | 20年国債    | 280,000,000 | 336,436,800    |             |  |
| 147     | 20年国債    | 700,000,000 | 833,315,000    |             |  |
| 148     | 20年国債    | 500,000,000 | 589,405,000    |             |  |
| 149     | 20年国債    | 402,000,000 | 474,516,780    |             |  |
| 150     | 20年国債    | 200,000,000 | 233,604,000    |             |  |
| 151     | 20年国債    | 400,000,000 | 456,408,000    |             |  |
| 152     | 20年国債    | 500,000,000 | 570,860,000    |             |  |
| 153     | 20年国債    | 400,000,000 | 463,108,000    |             |  |
| 154     | 20年国債    | 500,000,000 | 571,935,000    |             |  |
| 155     | 20年国債    | 400,000,000 | 445,796,000    |             |  |
| 156     | 20年国債    | 200,000,000 | 204,392,000    |             |  |
| 157     | 20年国債    | 400,000,000 | 396,004,000    |             |  |
| 158     | 20年国債    | 400,000,000 | 414,332,000    |             |  |
| 159     | 20年国債    | 280,000,000 | 294,372,400    |             |  |
| 160     | 20年国債    | 260,000,000 | 277,479,800    |             |  |
| 161     | 20年国債    | 600,000,000 | 630,150,000    |             |  |
| 162     | 20年国債    | 350,000,000 | 367,230,500    |             |  |
| 163     | 20年国債    | 290,000,000 | 304,221,600    |             |  |
| 164     | 20年国債    | 600,000,000 | 618,666,000    |             |  |
| 165     | 20年国債    | 270,000,000 | 278,275,500    |             |  |
| 166     | 20年国債    | 600,000,000 | 639,336,000    |             |  |
| 167     | 20年国債    | 300,000,000 | 308,628,000    |             |  |
| 168     | 20年国債    | 370,000,000 | 373,914,600    |             |  |
| 169     | 20年国債    | 300,000,000 | 297,591,000    |             |  |
| 170     | 20年国債    | 140,000,000 | 138,735,800    |             |  |
| 171     | 20年国債    | 300,000,000 | 296,988,000    |             |  |
| 172     | 20年国債    | 115,000,000 | 115,847,550    |             |  |
| 27      | メキシコ国債   | 100,000,000 | 93,983,900     |             |  |
| 11      | フィリピン共和国 | 100,000,000 | 99,909,400     |             |  |
| 国債証券 合計 |          |             | 87,708,826,340 |             |  |
| 地方債証券   | 699      | 東京都公債       | 100,000,000    | 101,264,600 |  |
|         | 713      | 東京都公債       | 100,000,000    | 101,687,000 |  |
|         | 751      | 東京都公債       | 100,000,000    | 101,719,900 |  |
|         | 16       | 東京都20年      | 100,000,000    | 116,057,800 |  |
|         | 24-1     | 北海道公債       | 100,000,000    | 101,812,900 |  |
|         | 24-6     | 北海道公債       | 100,000,000    | 101,787,400 |  |

|           |                |             |               |  |
|-----------|----------------|-------------|---------------|--|
| 2 2 2     | 神奈川県公債         | 100,000,000 | 99,880,300    |  |
| 3 1       | 神奈川県 2 0 年     | 100,000,000 | 109,643,200   |  |
| 3 6 1     | 大阪府公債          | 100,000,000 | 101,824,000   |  |
| 4 2 0     | 大阪府公債          | 200,000,000 | 200,782,000   |  |
| 2 4 - 5   | 京都府公債          | 100,000,000 | 101,795,600   |  |
| 2 6 - 1 7 | 兵庫県公債          | 100,000,000 | 101,886,700   |  |
| 3         | 兵庫県公債 1 2 年    | 200,000,000 | 204,815,600   |  |
| 1 9       | 兵庫県公債 2 0 年    | 100,000,000 | 116,565,700   |  |
| 2 6 - 1 0 | 静岡県公債          | 100,000,000 | 102,136,900   |  |
| 2 1 - 5   | 愛知県公債          | 100,000,000 | 119,186,800   |  |
| 2 4 - 1 6 | 愛知県公債          | 100,000,000 | 101,907,900   |  |
| 2 9 - 5   | 広島県公債          | 100,000,000 | 101,057,400   |  |
| 4         | 埼玉県 3 0 年      | 100,000,000 | 118,120,200   |  |
| 2 9 - 1   | 福岡県公債          | 100,000,000 | 100,740,100   |  |
| 2 2 - 1   | 福岡県 1 5 年      | 100,000,000 | 108,740,500   |  |
| 1 6       | 千葉県 2 0 年      | 100,000,000 | 116,867,100   |  |
| 2 8 - 2   | 新潟県公債          | 100,000,000 | 100,599,300   |  |
| 1 0 8     | 共同発行地方         | 100,000,000 | 101,760,500   |  |
| 1 1 7     | 共同発行地方         | 100,000,000 | 101,737,800   |  |
| 1 2 6     | 共同発行地方         | 100,000,000 | 102,525,800   |  |
| 1 3 1     | 共同発行地方         | 100,000,000 | 102,330,100   |  |
| 1 6 8     | 共同発行地方         | 100,000,000 | 100,802,600   |  |
| 2 3 - 2   | 島根県公債          | 100,000,000 | 101,471,700   |  |
| 2 5 - 6   | 大阪市公債          | 200,000,000 | 204,515,000   |  |
| 1 1       | 名古屋市 2 0 年     | 100,000,000 | 118,732,100   |  |
| 2 0 - 1   | 神戸市 2 0 年      | 100,000,000 | 117,897,900   |  |
| 2 4 - 1 0 | 神戸市公債          | 100,000,000 | 101,806,500   |  |
| 2 4 - 3   | 横浜市公債          | 100,000,000 | 101,757,900   |  |
| 2 4 - 5   | 札幌市公債          | 100,000,000 | 101,634,500   |  |
| 4         | 川崎市公債 3 0 年    | 100,000,000 | 133,187,100   |  |
| 2 3 - 4   | 福岡市 2 0 年      | 100,000,000 | 118,607,500   |  |
| 2 4 - 4   | 福井県公債          | 100,000,000 | 101,205,400   |  |
| 地方債証券 合計  |                |             | 4,340,851,300 |  |
| 特殊債券      | 4 7 日本政策投資 C O | 100,000,000 | 108,254,000   |  |
|           | 1 9 政保政策投資 C   | 100,000,000 | 101,790,800   |  |
|           | 8 1 道路機構       | 100,000,000 | 101,535,900   |  |
|           | 2 4 7 道路機構     | 200,000,000 | 195,796,200   |  |
|           | 8 6 政保道路機構     | 100,000,000 | 117,434,300   |  |
|           | 1 6 8 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,780,800   |  |

|         |          |             |               |             |
|---------|----------|-------------|---------------|-------------|
| 173     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,866,400   |             |
| 175     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,856,800   |             |
| 186     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,800,000   |             |
| 190     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,706,700   |             |
| 223     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 116,075,000   |             |
| 236     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 101,406,000   |             |
| 261     | 政保道路機構   | 200,000,000 | 203,800,800   |             |
| 284     | 政保道路機構   | 200,000,000 | 194,225,200   |             |
| 298     | 政保道路機構   | 100,000,000 | 103,228,600   |             |
| 29      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 101,369,300   |             |
| 33      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 101,711,200   |             |
| 39      | 政保地方公共団  | 100,000,000 | 101,740,000   |             |
| F143    | 地方公共団体   | 100,000,000 | 108,869,900   |             |
| 1       | 地方公共団15年 | 100,000,000 | 109,251,600   |             |
| 48      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 102,227,600   |             |
| 51      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 102,505,700   |             |
| 31      | 地方公共団20  | 100,000,000 | 118,573,000   |             |
| 65      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 102,082,200   |             |
| 71      | 地方公共団体   | 100,000,000 | 101,912,000   |             |
| 25      | 日本政策金融   | 100,000,000 | 101,853,000   |             |
| 25      | 政保日本政策   | 100,000,000 | 102,158,500   |             |
| 127     | 都市再生     | 100,000,000 | 99,825,800    |             |
| 19      | 利付商工債    | 100,000,000 | 99,696,000    |             |
| 特殊債券 合計 |          |             | 3,306,333,300 |             |
| 社債券     | 20       | 成田国際空港      | 100,000,000   | 99,944,700  |
|         | 63       | 中日本高速道      | 100,000,000   | 102,524,400 |
|         | 21       | 西日本高速道      | 100,000,000   | 102,484,600 |
|         | 12       | アサヒグループHD   | 100,000,000   | 100,003,400 |
|         | 11       | 日本たばこ産業     | 100,000,000   | 102,252,200 |
|         | 5        | 野村不動産HD     | 100,000,000   | 102,570,400 |
|         | 23       | 森ビル         | 100,000,000   | 99,591,000  |
|         | 11       | セブンアンドアイ    | 100,000,000   | 100,868,400 |
|         | 4        | JXホールディングス  | 100,000,000   | 102,385,100 |
|         | 17       | パナソニック      | 100,000,000   | 100,704,200 |
|         | 15       | デンソー        | 100,000,000   | 99,758,000  |
|         | 7        | 凸版印刷        | 100,000,000   | 106,224,900 |
|         | 1        | 三菱UFJFG 劣後  | 100,000,000   | 101,119,000 |
|         | 11       | 三菱UFJ信託BK   | 100,000,000   | 102,370,500 |
|         | 78       | トヨタファイナンス   | 100,000,000   | 99,900,300  |

|        |             |             |                |  |
|--------|-------------|-------------|----------------|--|
| 175    | オリックス       | 100,000,000 | 102,816,200    |  |
| 13     | NTTファイナンス   | 100,000,000 | 105,805,600    |  |
| 107    | 東日本旅客鉄      | 100,000,000 | 116,000,600    |  |
| 41     | 東海旅客鉄道      | 100,000,000 | 116,239,800    |  |
| 509    | 関西電力        | 100,000,000 | 100,144,700    |  |
| 372    | 中国電力        | 100,000,000 | 102,366,700    |  |
| 482    | 九州電力        | 100,000,000 | 99,482,700     |  |
| 332    | 北海道電力       | 100,000,000 | 102,196,300    |  |
| 11     | 東京電力パワー     | 100,000,000 | 99,770,700     |  |
| 30     | 大阪瓦斯        | 100,000,000 | 101,657,600    |  |
| 4      | ファーストリテイリング | 100,000,000 | 102,428,000    |  |
| 社債券 合計 |             |             | 2,671,610,000  |  |
| 合計     |             |             | 98,027,620,940 |  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在         | 第4期<br>2020年6月15日現在         |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |                             |
| 流動資産            |                             |                             |
| コール・ローン         | 372,641,014                 | 308,884,774                 |
| 親投資信託受益証券       | 72,778,781,170              | 87,647,104,553              |
| 未収入金            | 13,020,670                  | 36,450,567                  |
| 流動資産合計          | 73,164,442,854              | 87,992,439,894              |
| <b>資産合計</b>     |                             |                             |
| 73,164,442,854  |                             |                             |
| <b>負債の部</b>     |                             |                             |
| 流動負債            |                             |                             |
| 未払解約金           | 174,650,664                 | 81,114,863                  |
| 未払受託者報酬         | 7,432,520                   | 9,559,233                   |
| 未払委託者報酬         | 133,786,207                 | 172,066,902                 |
| その他未払費用         | 1,094,942                   | 1,094,256                   |
| 流動負債合計          | 316,964,333                 | 263,835,254                 |
| <b>負債合計</b>     |                             |                             |
| 316,964,333     |                             |                             |
| <b>純資産の部</b>    |                             |                             |
| 元本等             |                             |                             |
| 元本              | <sup>1</sup> 73,543,593,762 | <sup>1</sup> 83,945,786,338 |
| 剰余金             |                             |                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | <sup>2</sup> 696,115,241    | <sup>2</sup> 3,782,818,302  |
| (分配準備積立金)       | 2,374,884,429               | 5,713,195,853               |
| 元本等合計           | 72,847,478,521              | 87,728,604,640              |
| <b>純資産合計</b>    |                             |                             |
| 72,847,478,521  |                             |                             |
| <b>負債純資産合計</b>  |                             |                             |
| 73,164,442,854  |                             |                             |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期                          |                      | 第4期                          |                      |
|-------------------------|------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------|
|                         | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |                      | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |                      |
| <b>営業収益</b>             |                              |                      |                              |                      |
| 受取利息                    |                              | 34                   |                              | 568                  |
| 有価証券売買等損益               |                              | 3,392,901,979        |                              | 4,855,968,795        |
| <b>営業収益合計</b>           |                              | <b>3,392,902,013</b> |                              | <b>4,855,969,363</b> |
| <b>営業費用</b>             |                              |                      |                              |                      |
| 支払利息                    |                              | 162,917              |                              | 118,907              |
| 受託者報酬                   |                              | 14,585,465           |                              | 18,096,417           |
| 委託者報酬                   |                              | 262,540,263          |                              | 325,737,150          |
| その他費用                   |                              | 2,186,760            |                              | 2,188,505            |
| <b>営業費用合計</b>           |                              | <b>279,475,405</b>   |                              | <b>346,140,979</b>   |
| <b>営業利益</b>             |                              | <b>3,113,426,608</b> |                              | <b>4,509,828,384</b> |
| 経常利益                    |                              | 3,113,426,608        |                              | 4,509,828,384        |
| <b>当期純利益</b>            |                              | <b>3,113,426,608</b> |                              | <b>4,509,828,384</b> |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |                              | 142,424,968          |                              | 608,411,231          |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         |                              | 3,385,950,232        |                              | 696,115,241          |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |                              | 953,602,457          |                              | 577,516,390          |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | 953,602,457          |                              | 111,912,176          |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | -                    |                              | 465,604,214          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |                              | 1,234,769,106        |                              | -                    |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |                              | 1,234,769,106        |                              | -                    |
| <b>分配金</b>              |                              | <b>1 -</b>           |                              | <b>1 -</b>           |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )         |                              | 696,115,241          |                              | 3,782,818,302        |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期   | 第4期             |
|---------------------|---|-----------------|
|                     | 2019年6月17日現在                                    | 2020年6月15日現在    |
| 1. 1 期首元本額          | 64,540,834,408円                                 | 73,543,593,762円 |
| 期中追加設定元本額           | 27,255,813,662円                                 | 32,566,137,503円 |
| 期中一部解約元本額           | 18,253,054,308円                                 | 22,163,944,927円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 73,543,593,762口                                 | 83,945,786,338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696,115,241円であります。 |                 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(2,165,508,764円)、投資信託約款に規定される収益調整金(522,621,308円)及び分配準備積立金(209,375,665円)より分配対象額は2,897,505,737円(1万口当たり393.98円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(3,901,410,235円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,495,531,421円)及び分配準備積立金(1,811,785,618円)より分配対象額は7,208,727,274円(1万口当たり858.74円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分               | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|-------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 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<br>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4期<br>2020年6月15日現在   |
|------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期<br>2019年6月17日現在      | 第4期<br>2020年6月15日現在      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 3,326,062,303            | 4,480,052,154            |
| 合計        | 3,326,062,303            | 4,480,052,154            |

## (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3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|---------------------|---------------------|
| 該当事項はありません。         | 該当事項はありません。         |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15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3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在  |
|---------------------------|---------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 0.9905円<br>(9,905円) | 1.0451円<br>(10,451円) |

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                        | 券面総額           | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|--------------|----------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド | 82,592,446,809 | 87,647,104,553 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                            |                | 87,647,104,553 |    |
| 合計           |                            |                | 87,647,104,553 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

|                 | 2019年6月17日現在     | 2020年6月15日現在    |
|-----------------|------------------|-----------------|
|                 | 金額(円)            | 金額(円)           |
| 資産の部            |                  |                 |
| 流動資産            |                  |                 |
| 預金              | 222,122,908      | 744,081,788     |
| コール・ローン         | 1,814,269,093    | 1,270,076,588   |
| 国債証券            | 86,713,568,595   | 111,031,651,188 |
| 派生商品評価勘定        | 20,454,927       | 248,659,459     |
| 未収利息            | 561,770,663      | 606,778,700     |
| 前払費用            | 44,471,503       | 92,992,972      |
| 差入委託証拠金         | 123,414,598      | 223,121,835     |
| 流動資産合計          | 89,500,072,287   | 114,217,362,530 |
| 資産合計            | 89,500,072,287   | 114,217,362,530 |
| 負債の部            |                  |                 |
| 流動負債            |                  |                 |
| 派生商品評価勘定        | 365,925,981      | 454,690,602     |
| 未払解約金           | 123,178,918      | 36,450,567      |
| その他未払費用         | -                | 3,204           |
| 流動負債合計          | 489,104,899      | 491,144,373     |
| 負債合計            | 489,104,899      | 491,144,373     |
| 純資産の部           |                  |                 |
| 元本等             |                  |                 |
| 元本              | 1 88,872,666,940 | 107,167,679,077 |
| 剰余金             |                  |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 138,300,448      | 6,558,539,080   |
| 元本等合計           | 89,010,967,388   | 113,726,218,157 |
| 純資産合計           | 89,010,967,388   | 113,726,218,157 |
| 負債純資産合計         | 89,500,072,287   | 114,217,362,530 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分                 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券                         |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
|                                   | <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>  |
| <p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>     | <p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>                      |
| <p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分              | 2019年6月17日現在                  | 2020年6月15日現在                  |
|------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 1. 1 期首<br>期首元本額 | 2018年6月16日<br>68,969,365,389円 | 2019年6月18日<br>88,872,666,940円 |

|                                     |                 |                  |
|-------------------------------------|-----------------|------------------|
| 期中追加設定元本額                           | 30,384,881,483円 | 53,233,783,948円  |
| 期中一部解約元本額                           | 10,481,579,932円 | 34,938,771,811円  |
| 期末元本額の内訳                            |                 |                  |
| ファンド名                               |                 |                  |
| ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)      | 72,662,521,137円 | 82,592,446,809円  |
| ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) | 3,492,377,916円  | 3,579,631,514円   |
| ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)    | 12,717,767,887円 | 20,995,600,754円  |
| 計                                   | 88,872,666,940円 | 107,167,679,077円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                    | 88,872,666,940口 | 107,167,679,077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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|-------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針   | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク   | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における債券先物取引を利用してあります。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してあります。 |
| 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<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br><br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |
|--------------------------------|--|

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 2020年6月15日現在   |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 3,330,070,609          | 4,244,459,271          |
| 合計   | 3,330,070,609          | 4,244,459,271          |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2018年6月16日から2019年6月17日まで、及び2019年6月18日から2020年6月15日まで）を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

| 種 類 | 2019年6月17日 現在 |           |             | 2020年6月15日 現在 |           |             |
|-----|---------------|-----------|-------------|---------------|-----------|-------------|
|     | 契約額等<br>(円)   | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |
|     | うち            |           |             | うち            |           |             |
|     |               |           |             |               |           |             |

|        |               | 1年超 |               |           |   | 1年超 |   |   |
|--------|---------------|-----|---------------|-----------|---|-----|---|---|
| 市場取引   |               |     |               |           |   |     |   |   |
| 債券先物取引 |               |     |               |           |   |     |   |   |
| 買 建    | 1,217,042,947 | -   | 1,219,378,229 | 2,335,282 | - | -   | - | - |
| 合計     | 1,217,042,947 | -   | 1,219,378,229 | 2,335,282 | - | -   | - | - |

## (注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

| 種 類        | 2019年6月17日 現在  |           |                |             | 2020年6月15日 現在   |           |                 |             |
|------------|----------------|-----------|----------------|-------------|-----------------|-----------|-----------------|-------------|
|            | 契約額等<br>(円)    | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)     | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)       | 評価損益<br>(円) |
| 市場取引以外の取引  |                |           |                |             |                 |           |                 |             |
| 為替予約取引     |                |           |                |             |                 |           |                 |             |
| 売 建        | 87,125,941,574 | -         | 87,473,747,910 | 347,806,336 | 112,349,851,437 | -         | 112,555,882,580 | 206,031,143 |
| アメリカ・ドル    | 41,806,504,464 | -         | 41,885,690,500 | 79,186,036  | 51,904,631,034  | -         | 51,671,797,020  | 232,834,014 |
| イギリス・ポンド   | 5,764,866,522  | -         | 5,762,815,540  | 2,050,982   | 7,542,106,252   | -         | 7,596,332,590   | 54,226,338  |
| イスラエル・シケル  | -              | -         | -              | -           | 446,436,019     | -         | 447,765,960     | 1,329,941   |
| オーストラリア・ドル | 1,767,496,665  | -         | 1,757,111,700  | 10,384,965  | 2,303,090,590   | -         | 2,352,923,460   | 49,832,870  |
| カナダ・ドル     | 1,732,183,922  | -         | 1,748,168,100  | 15,984,178  | 2,199,734,552   | -         | 2,220,353,940   | 20,619,388  |
| シンガポール・ドル  | 308,189,983    | -         | 309,912,240    | 1,722,257   | 454,531,642     | -         | 458,367,780     | 3,836,138   |

|             |                |   |                |             |                 |   |                 |             |
|-------------|----------------|---|----------------|-------------|-----------------|---|-----------------|-------------|
| スウェーデン・クローナ | 377,567,308    | - | 379,063,700    | 1,496,392   | 333,587,420     | - | 334,906,040     | 1,318,620   |
| デンマーク・クローネ  | 421,688,519    | - | 424,662,720    | 2,974,201   | 500,505,562     | - | 503,913,750     | 3,408,188   |
| ノルウェー・クローネ  | 181,719,881    | - | 182,984,780    | 1,264,899   | 173,462,217     | - | 173,155,360     | 306,857     |
| ポーランド・ズロチ   | 493,400,120    | - | 500,067,690    | 6,667,570   | 598,471,230     | - | 603,246,000     | 4,774,770   |
| マレーシア・リンギット | 293,046,504    | - | 293,167,200    | 120,696     | 497,259,416     | - | 504,903,600     | 7,644,184   |
| メキシコ・ペソ     | 581,335,800    | - | 597,840,000    | 16,504,200  | 775,416,428     | - | 759,897,840     | 15,518,588  |
| ユーロ         | 32,958,046,665 | - | 33,197,918,160 | 239,871,495 | 44,620,619,075  | - | 44,928,319,240  | 307,700,165 |
| 南アフリカ・ランド   | 439,895,221    | - | 434,345,580    | 5,549,641   | -               | - | -               | -           |
| 合計          | 87,125,941,574 | - | 87,473,747,910 | 347,806,336 | 112,349,851,437 | - | 112,555,882,580 | 206,031,143 |

## (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6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 1.0016円      | 1.0612円      |
| (1万口当たり純資産額) | (10,016円)    | (10,612円)    |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類  | 通貨            | 銘柄  | 券面総額           | 評価額            | 備考 |
|---|---------------|---|----------------|----------------|----|
| 国債証券  | アメリカ・ドル       |   | アメリカ・ドル        | アメリカ・ドル        |    |
|   |               | 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20211115     | 13,946,000.000 | 14,302,738.680 |    |
|   |               | 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20221115 | 15,000,000.000 | 15,513,750.000 |    |
|   |               | 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20230215     | 11,000,000.000 | 11,525,910.000 |    |
|   |               | 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230515  | 11,020,000.000 | 11,513,255.200 |    |
|   |               | 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230815   | 11,310,000.000 | 12,122,849.700 |    |
|   |               | 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20231115  | 12,905,000.000 | 14,005,925.550 |    |
|   |               | 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20240215  | 10,500,000.000 | 11,456,445.000 |    |
|   |               | 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20240515   | 12,580,000.000 | 13,670,811.800 |    |
|   |               | 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210630 | 20,990,000.000 | 21,414,627.700 |    |
|   |               | 6.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20230815  | 3,300,000.000  | 3,929,310.000  |    |
|   |               | 6.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20271115 | 4,750,000.000  | 6,690,422.500  |    |
|   |               | 5.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20280815   | 3,800,000.000  | 5,293,248.000  |    |
|   |               | 5.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20281115  | 2,700,000.000  | 3,734,424.000  |    |
| 6.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20300515  | 1,400,000.000 | 2,154,026.000                                       |                |                |    |
| 5.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20310215 | 1,130,000.000 | 1,675,835.200                                       |                |                |    |

|   |                |                |  |
|---|----------------|----------------|--|
| 4.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20360215   | 700,000.000    | 1,065,526.000  |  |
| 3.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20390215   | 2,630,000.000  | 3,699,252.800  |  |
| 4.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20391115 | 2,410,000.000  | 3,764,853.800  |  |
| 4.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20400215 | 1,390,000.000  | 2,239,192.700  |  |
| 4.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20410215  | 1,770,000.000  | 2,915,172.300  |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20420215 | 2,170,000.000  | 2,921,514.400  |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20430515 | 7,500,000.000  | 9,731,775.000  |  |
| 3.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20430815 | 1,100,000.000  | 1,595,506.000  |  |
| 3.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20431115  | 2,532,000.000  | 3,741,814.920  |  |
| 3.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20440215 | 1,000,000.000  | 1,454,840.000  |  |
| 3.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20440515 | 3,200,000.000  | 4,493,984.000  |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20440815 | 5,040,000.000  | 6,823,857.600  |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241115  | 7,810,000.000  | 8,476,895.900  |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220228  | 22,750,000.000 | 23,350,600.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20250515 | 8,300,000.000  | 9,022,930.000  |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20450515     | 3,970,000.000  | 5,292,486.400  |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20250815     | 9,020,000.000  | 9,776,056.400  |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220930  | 16,720,000.000 | 17,318,241.600 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20251115  | 10,700,000.000 | 11,767,432.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20451115     | 3,300,000.000  | 4,418,898.000  |  |

|   |                |                |  |
|---|----------------|----------------|--|
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260215 | 6,000,000.000  | 6,404,040.000  |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260515 | 5,165,000.000  | 5,523,296.050  |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20460515   | 2,070,000.000  | 2,549,639.700  |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20260815   | 5,750,000.000  | 6,111,157.500  |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230930 | 5,000,000.000  | 5,189,050.000  |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210930 | 31,700,000.000 | 32,081,351.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20261115     | 5,850,000.000  | 6,411,190.500  |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20461115 | 4,980,000.000  | 6,575,691.600  |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20270215  | 8,470,000.000  | 9,440,069.100  |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220131 | 8,000,000.000  | 8,218,720.000  |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20470215     | 3,500,000.000  | 4,734,555.000  |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20270515 | 3,350,000.000  | 3,771,865.500  |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20470515     | 2,250,000.000  | 3,045,037.500  |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240731 | 12,200,000.000 | 13,127,322.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20470815  | 3,310,000.000  | 4,295,486.300  |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20240831 | 7,000,000.000  | 7,464,800.000  |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20250131   | 5,300,000.000  | 5,832,438.000  |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20250331 | 2,500,000.000  | 2,773,425.000  |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20480515 | 4,500,000.000  | 6,261,480.000  |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20280515 | 4,400,000.000  | 5,180,296.000  |  |

|          |   |               |  |  |
|----------|---|---------------|--|--|
|          | 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20480815     | 1,500,000.000 | 2,047,320.000                                  |  |
|          | 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20281115 | 7,800,000.000 | 9,408,126.000                                  |  |
|          | 3.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20481115 | 1,850,000.000 | 2,700,408.000                                  |  |
|          | 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20290215 | 4,000,000.000 | 4,676,240.000                                  |  |
|          | 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20490215     | 3,200,000.000 | 4,387,488.000                                  |  |
|          | 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20490515 | 2,000,000.000 | 2,686,240.000                                  |  |
|          | 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20260630 | 4,000,000.000 | 4,338,720.000                                  |  |
|          | 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20490815  | 2,100,000.000 | 2,504,250.000                                  |  |
|          | 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20291115  | 6,900,000.000 | 7,586,757.000                                  |  |
|          | 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20491115 | 2,800,000.000 | 3,432,828.000                                  |  |
|          | 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20300215   | 2,500,000.000 | 2,691,000.000                                  |  |
|          | 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20500215     | 2,500,000.000 | 2,841,400.000                                  |  |
|          | アメリカ・ドル 小計  |               | アメリカ・ドル<br>477,166,096.900<br>(51,171,292,232) |  |
| イギリス・ポンド |   | イギリス・ポンド      | イギリス・ポンド                                       |  |
|          | 2% United Kingdom Gilt<br>20250907                  | 750,000.000   | 830,565.000                                    |  |
|          | 2.5% United Kingdom Gilt<br>20650722                | 960,000.000   | 1,735,104.000                                  |  |
|          | 1.5% United Kingdom Gilt<br>20260722                | 1,025,000.000 | 1,119,156.500                                  |  |
|          | 0.5% United Kingdom Gilt<br>20220722                | 250,000.000   | 252,857.500                                    |  |
|          | 1.5% United Kingdom Gilt<br>20470722                | 1,850,000.000 | 2,261,440.000                                  |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.75% United Kingdom Gilt<br>20370907  | 720,000.000   | 864,792.000   |  |
| 1.75% United Kingdom Gilt<br>20570722  | 1,100,000.000 | 1,553,640.000 |  |
| 1.25% United Kingdom Gilt<br>20270722  | 650,000.000   | 705,737.500   |  |
| 1.625% United Kingdom Gilt<br>20281022 | 800,000.000   | 903,192.000   |  |
| 1.625% United Kingdom Gilt<br>20711022 | 797,000.000   | 1,231,683.800 |  |
| 1% United Kingdom Gilt<br>20240422     | 400,000.000   | 415,796.000   |  |
| 1.625% United Kingdom Gilt<br>20541022 | 850,000.000   | 1,131,426.500 |  |
| 0.875% United Kingdom Gilt<br>20291022 | 1,600,000.000 | 1,707,472.000 |  |
| 1.25% United Kingdom Gilt<br>20411022  | 150,000.000   | 169,455.000   |  |
| 8% United Kingdom Gilt<br>20210607     | 350,000.000   | 377,254.500   |  |
| 6% United Kingdom Gilt<br>20281207     | 513,000.000   | 766,770.840   |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20320607  | 900,000.000   | 1,316,070.000 |  |
| 5% United Kingdom Gilt<br>20250307     | 2,075,000.000 | 2,565,343.250 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20360307  | 2,265,000.000 | 3,563,524.500 |  |
| 4.75% United Kingdom Gilt<br>20381207  | 950,000.000   | 1,658,605.000 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20551207  | 850,000.000   | 1,865,580.000 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20461207  | 770,000.000   | 1,453,144.000 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20271207  | 1,100,000.000 | 1,443,948.000 |  |
| 4.5% United Kingdom Gilt<br>20421207   | 911,000.000   | 1,659,933.100 |  |
| 4.75% United Kingdom Gilt<br>20301207  | 907,500.000   | 1,334,841.750 |  |

|                |  |               |   |  |
|----------------|--|---------------|---|--|
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20491207            | 843,000.000   | 1,671,753.300                                 |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20390907            | 1,130,000.000 | 1,894,332.000                                 |  |
|                | 4% United Kingdom Gilt<br>20220307               | 1,040,000.000 | 1,112,529.600                                 |  |
|                | 4.5% United Kingdom Gilt<br>20340907             | 300,000.000   | 469,590.000                                   |  |
|                | 4% United Kingdom Gilt<br>20600122               | 787,000.000   | 1,773,032.300                                 |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20401207            | 1,000,000.000 | 1,709,600.000                                 |  |
|                | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20210907            | 742,000.000   | 775,901.980                                   |  |
|                | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20520722            | 700,000.000   | 1,353,590.000                                 |  |
|                | 1.75% United Kingdom Gilt<br>20220907            | 1,880,000.000 | 1,954,786.400                                 |  |
|                | 3.25% United Kingdom Gilt<br>20440122            | 1,175,000.000 | 1,852,975.000                                 |  |
|                | 2.25% United Kingdom Gilt<br>20230907            | 1,790,000.000 | 1,921,135.400                                 |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20680722             | 798,900.000   | 1,828,522.320                                 |  |
|                | 2.75% United Kingdom Gilt<br>20240907            | 1,900,000.000 | 2,123,155.000                                 |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20450122             | 1,540,000.000 | 2,551,472.000                                 |  |
|                | イギリス・ポンド 小計                                      |               | イギリス・ポンド<br>55,879,708.040<br>(7,495,704,036) |  |
| イスラエル・<br>シュケル |  | イスラエル・シュケル    | イスラエル・シュケル                                    |  |
|                | 4.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20230331 | 3,500,000.000 | 3,898,510.000                                 |  |
|                | 5.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20420131  | 1,200,000.000 | 2,097,120.000                                 |  |
|                | 2% Israel Government Bond -<br>Fixed 20270331    | 4,000,000.000 | 4,393,360.000                                 |  |
|                | 3.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20470331 | 1,200,000.000 | 1,724,148.000                                 |  |

|   |  |               |   |  |
|---|--|---------------|---|--|
|   | 1% Israel Government Bond - Fixed 20300331 | 1,700,000.000 | 1,741,718.000                                 |  |
| イスラエル・シュケル 小計                             |  |               | イスラエル・シュケル<br>13,854,856.000<br>(427,422,308) |  |
| オーストラリア・ドル                                |  | オーストラリア・ドル    | オーストラリア・ドル                                    |  |
|   | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715  | 1,080,000.000 | 1,202,677.200                                 |  |
|   | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421   | 1,383,000.000 | 1,588,928.700                                 |  |
|   | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421  | 2,289,000.000 | 2,925,113.100                                 |  |
|   | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421  | 2,156,000.000 | 2,357,952.520                                 |  |
|   | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421  | 1,620,000.000 | 1,953,298.800                                 |  |
|   | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421  | 2,000,000.000 | 2,276,460.000                                 |  |
|   | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421   | 859,000.000   | 1,216,490.030                                 |  |
|   | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421  | 1,598,000.000 | 1,946,076.360                                 |  |
|   | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421  | 725,000.000   | 981,845.750                                   |  |
|   | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621  | 800,000.000   | 965,384.000                                   |  |
|   | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621  | 684,000.000   | 876,970.080                                   |  |
|   | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121  | 1,300,000.000 | 1,494,493.000                                 |  |
|   | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521  | 2,158,000.000 | 2,406,903.720                                 |  |
|   | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321     | 1,075,000.000 | 1,364,863.000                                 |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121 | 500,000.000                                | 579,440.000   |   |  |
| 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121 | 1,200,000.000                              | 1,258,104.000 |   |  |

|        |  |               |   |  |
|--------|--|---------------|---|--|
|        | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20291121           | 2,200,000.000 | 2,572,306.000                                   |  |
|        | 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300521            | 2,100,000.000 | 2,416,596.000                                   |  |
|        | 1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20320521           | 300,000.000   | 307,962.000                                     |  |
|        | 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20301221              | 1,000,000.000 | 1,004,060.000                                   |  |
|        | オーストラリア・ドル 小計  |               | オーストラリア・ドル<br>31,695,924.260<br>(2,315,704,226) |  |
| カナダ・ドル |  | カナダ・ドル        | カナダ・ドル  |  |
|        | 2.75% Canada Government<br>International Bond 20641201 | 680,000.000   | 1,089,026.800                                   |  |
|        | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290601             | 907,000.000   | 1,324,891.180                                   |  |
|        | 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330601             | 1,250,000.000 | 2,030,512.500                                   |  |
|        | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20370601                | 648,000.000   | 1,067,793.840                                   |  |
|        | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20410601                | 770,000.000   | 1,208,414.900                                   |  |
|        | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220601             | 400,000.000   | 419,624.000                                     |  |
|        | 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20451201              | 740,000.000   | 1,145,179.600                                   |  |
|        | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20230601              | 1,238,000.000 | 1,283,372.700                                   |  |
|        | 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240601              | 230,000.000   | 249,895.000                                     |  |
|        | 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20481201             | 1,100,000.000 | 1,558,469.000                                   |  |
|        | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250601             | 1,492,000.000 | 1,631,636.280                                   |  |
|        | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20260601              | 820,000.000   | 874,735.000                                     |  |
|        | 0.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210901             | 3,959,000.000 | 3,986,594.230                                   |  |
|        | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601                | 930,000.000   | 967,246.500                                     |  |

|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220301  | 3,940,000.000 | 3,958,715.000                               |  |
|               | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20280601    | 600,000.000   | 672,576.000                                 |  |
|               | 1.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230301 | 1,100,000.000 | 1,144,407.000                               |  |
|               | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290601 | 300,000.000   | 346,458.000                                 |  |
|               | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240301 | 1,000,000.000 | 1,072,280.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240901  | 1,400,000.000 | 1,469,524.000                               |  |
|               | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300601 | 600,000.000   | 641,898.000                                 |  |
|               | カナダ・ドル 小計                                  |               | カナダ・ドル<br>28,143,249.530<br>(2,213,748,008) |  |
| シンガポール・<br>ドル |  | シンガポール・ドル     | シンガポール・ドル                                   |  |
|               | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20270301      | 203,000.000   | 239,743.000                                 |  |
|               | 3.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20220901    | 1,000,000.000 | 1,061,700.000                               |  |
|               | 3% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20240901        | 150,000.000   | 165,792.000                                 |  |
|               | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20300901    | 300,000.000   | 354,450.000                                 |  |
|               | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20210601     | 390,000.000   | 397,363.200                                 |  |
|               | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20420401     | 89,000.000    | 113,030.000                                 |  |
|               | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20230701     | 200,000.000   | 214,340.000                                 |  |
|               | 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20330901    | 120,000.000   | 153,180.000                                 |  |
|               | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20250601    | 400,000.000   | 436,120.000                                 |  |
|               | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20460301     | 330,000.000   | 428,010.000                                 |  |
|               | 2.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20260601    | 200,000.000   | 217,240.000                                 |  |

|                 |   |                |   |  |
|-----------------|---|----------------|---|--|
|                 | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20360801    | 260,000.000    | 298,279.800                                 |  |
|                 | 2.625% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20280501   | 800,000.000    | 909,040.000                                 |  |
|                 | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20390701   | 300,000.000    | 355,083.000                                 |  |
|                 | 1.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20500301   | 200,000.000    | 226,022.000                                 |  |
| シンガポール・ドル 小計    |   |                | シンガポール・ドル<br>5,569,393.000<br>(428,063,546) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ |   | スウェーデン・クローナ    | スウェーデン・クローナ                                 |  |
|                 | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20390330  | 1,920,000.000  | 2,977,420.800                               |  |
|                 | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20220601  | 12,950,000.000 | 13,919,307.500                              |  |
|                 | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20231113  | 4,150,000.000  | 4,405,972.000                               |  |
|                 | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20250512  | 2,020,000.000  | 2,295,568.400                               |  |
|                 | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20261112    | 2,280,000.000  | 2,452,482.000                               |  |
|                 | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20280512 | 2,550,000.000  | 2,720,365.500                               |  |

|                |  |               |  |  |
|----------------|--|---------------|--|--|
| スウェーデン・クローナ 小計 |  |               | スウェーデン・クローナ<br>28,771,116.200<br>(330,292,414) |  |
| デンマーク・ク<br>ローネ |  | デンマーク・クローネ    | デンマーク・クローネ                                     |  |
|                | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20391115  | 6,740,000.000 | 12,643,566.000                                 |  |
|                | 3% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20211115    | 2,310,000.000 | 2,426,816.700                                  |  |
|                | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20231115  | 2,670,000.000 | 2,859,516.600                                  |  |
|                | 1.75% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20251115 | 4,330,000.000 | 4,863,629.200                                  |  |
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20271115  | 5,200,000.000 | 5,544,968.000                                  |  |

|                |  |               |   |  |
|----------------|--|---------------|---|--|
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20291115      | 2,200,000.000 | 2,365,440.000                                 |  |
| デンマーク・クローネ 小計  |  |               | デンマーク・クローネ<br>30,703,936.500<br>(497,096,732) |  |
| ノルウェー・ク<br>ローネ | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20230524     | 1,610,000.000 | 1,694,315.700                                 |  |
|                | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20240314     | 1,300,000.000 | 1,433,965.000                                 |  |
|                | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250313  | 150,000.000   | 160,314.000                                   |  |
|                | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260219   | 1,430,000.000 | 1,522,778.400                                 |  |
|                | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270217  | 3,000,000.000 | 3,266,160.000                                 |  |
|                | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20280426     | 4,000,000.000 | 4,470,000.000                                 |  |
|                | 1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300819 | 2,500,000.000 | 2,696,225.000                                 |  |
| ノルウェー・クローネ 小計  |  |               | ノルウェー・クローネ<br>15,243,758.100<br>(168,748,402) |  |
| ポーランド・ズ<br>ロチ  | 5.75% Poland Government Bond<br>20220923     | 1,200,000.000 | 1,348,500.000                                 |  |
|                | 2.5% Poland Government Bond<br>20260725      | 2,640,000.000 | 2,877,969.600                                 |  |
|                | 1.75% Poland Government Bond<br>20210725     | 1,520,000.000 | 1,547,557.600                                 |  |
|                | 2.5% Poland Government Bond<br>20270725      | 1,815,000.000 | 1,985,446.650                                 |  |
|                | 2.25% Poland Government Bond<br>20220425     | 800,000.000   | 829,992.000                                   |  |
|                | 2.5% Poland Government Bond<br>20230125      | 3,000,000.000 | 3,166,140.000                                 |  |
|                | 2.5% Poland Government Bond<br>20240425      | 1,400,000.000 | 1,502,242.000                                 |  |

|             |  |               |  |  |
|-------------|--|---------------|--|--|
|             | 2.75% Poland Government Bond<br>20291025 | 2,300,000.000 | 2,607,027.000                                |  |
|             | 5.75% Poland Government Bond<br>20290425 | 600,000.000   | 826,950.000                                  |  |
|             | 4% Poland Government Bond<br>20231025    | 710,000.000   | 793,417.900                                  |  |
|             | 2.75% Poland Government Bond<br>20280425 | 1,500,000.000 | 1,672,875.000                                |  |
|             | 3.25% Poland Government Bond<br>20250725 | 2,230,000.000 | 2,501,011.900                                |  |
|             | ポーランド・ズロチ 小計                             |               | ポーランド・ズロチ<br>21,659,129.650<br>(587,179,005) |  |
| マレーシア・リンギット |  | マレーシア・リンギット   | マレーシア・リンギット                                  |  |
|             | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20300415  | 1,760,000.000 | 1,974,984.000                                |  |
|             | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270315  | 1,250,000.000 | 1,333,162.500                                |  |
|             | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20330415  | 600,000.000   | 632,136.000                                  |  |
|             | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280615  | 1,500,000.000 | 1,577,520.000                                |  |
|             | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250915  | 1,150,000.000 | 1,229,752.500                                |  |
|             | 3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20220930  | 1,100,000.000 | 1,137,686.000                                |  |
|             | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230817    | 1,600,000.000 | 1,665,952.000                                |  |
|             | 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20460315  | 1,420,000.000 | 1,574,765.800                                |  |
|             | 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20211130   | 2,600,000.000 | 2,655,900.000                                |  |
|             | 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240930  | 2,000,000.000 | 2,124,300.000                                |  |
|             | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20370407  | 1,000,000.000 | 1,157,840.000                                |  |
|             | 3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260715  | 1,000,000.000 | 1,064,530.000                                |  |
|             | 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20290815  | 1,200,000.000 | 1,292,508.000                                |  |

|                 |  |                |   |  |
|-----------------|--|----------------|---|--|
|                 | 3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20340705    | 1,300,000.000  | 1,360,983.000                                   |  |
|                 | 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20400522    | 700,000.000    | 714,014.000                                     |  |
| マレーシア・リングgit 小計 |  |                | マレーシア・リングgit<br>21,496,033.800<br>(538,475,647) |  |
| メキシコ・ペソ         |  | メキシコ・ペソ        | メキシコ・ペソ   |  |
|                 | 5.75% Mexican Bonos 20260305               | 9,200,000.000  | 9,330,272.000                                   |  |
|                 | 8% Mexican Bonos 20471107                  | 11,450,000.000 | 12,560,535.500                                  |  |
|                 | 8% Mexican Bonos 20240905                  | 12,900,000.000 | 14,307,906.000                                  |  |
|                 | 8% Mexican Bonos 20231207                  | 6,740,000.000  | 7,370,055.200                                   |  |
|                 | 10% Mexican Bonos 20241205                 | 6,340,000.000  | 7,551,891.000                                   |  |
|                 | 7.5% Mexican Bonos 20270603                | 11,800,000.000 | 12,992,862.000                                  |  |
|                 | 10% Mexican Bonos 20361120                 | 2,750,000.000  | 3,645,867.500                                   |  |
|                 | 8.5% Mexican Bonos 20290531                | 6,500,000.000  | 7,615,790.000                                   |  |
|                 | 8.5% Mexican Bonos 20381118                | 5,000,000.000  | 5,802,600.000                                   |  |
|                 | 6.5% Mexican Bonos 20210610                | 13,700,000.000 | 13,897,691.000                                  |  |
|                 | 7.75% Mexican Bonos 20310529               | 22,700,000.000 | 25,395,398.000                                  |  |
|                 | 6.5% Mexican Bonos 20220609                | 15,900,000.000 | 16,382,883.000                                  |  |
|                 | 7.75% Mexican Bonos 20421113               | 4,750,000.000  | 5,071,337.500                                   |  |
|                 | 7.75% Mexican Bonos 20341123               | 10,300,000.000 | 11,569,578.000                                  |  |
| メキシコ・ペソ 小計      |  |                | メキシコ・ペソ<br>153,494,666.700<br>(730,634,613)     |  |
| ユーロ             |  | ユーロ            | ユーロ   |  |
|                 | 0.75% Finland Government Bond<br>20310415  | 690,000.000    | 755,722.500                                     |  |
|                 | 0.875% Finland Government<br>Bond 20250915 | 800,000.000    | 857,288.000                                     |  |
|                 | 0.5% Finland Government Bond<br>20260415   | 180,000.000    | 189,907.200                                     |  |
|                 | 1.375% Finland Government<br>Bond 20470415 | 270,000.000    | 346,285.800                                     |  |
|                 | 0.5% Finland Government Bond<br>20270915   | 200,000.000    | 212,142.000                                     |  |
|                 | 1.125% Finland Government<br>Bond 20340415 | 150,000.000    | 172,177.500                                     |  |
|                 | 0.5% Finland Government Bond<br>20280915   | 500,000.000    | 531,975.000                                     |  |

|   |             |             |  |
|---|-------------|-------------|--|
| 0.125% Finland Government Bond 20360415 | 150,000.000 | 150,103.500 |  |
| 1.2% Austria Government Bond 20251020   | 140,000.000 | 152,751.200 |  |
| 0.75% Austria Government Bond 20261020  | 490,000.000 | 526,431.500 |  |
| 1.5% Austria Government Bond 20470220   | 120,000.000 | 155,036.400 |  |
| 1.5% Austria Government Bond 20861102   | 280,000.000 | 404,457.200 |  |
| 0.5% Austria Government Bond 20270420   | 400,000.000 | 424,008.000 |  |
| 2.1% Austria Government Bond 21170920   | 50,000.000  | 94,033.500  |  |
| 0.75% Austria Government Bond 20280220  | 600,000.000 | 648,936.000 |  |
| 0.5% Austria Government Bond 20290220   | 700,000.000 | 744,751.000 |  |
| 0.75% Austria Government Bond 20510320  | 600,000.000 | 658,944.000 |  |
| 0.8% Belgium Government Bond 20250622   | 670,000.000 | 711,988.900 |  |
| 1% Belgium Government Bond 20310622     | 622,000.000 | 689,082.700 |  |
| 1.9% Belgium Government Bond 20380622   | 610,000.000 | 768,002.200 |  |
| 1% Belgium Government Bond 20260622     | 595,000.000 | 643,611.500 |  |
| 1.6% Belgium Government Bond 20470622   | 414,000.000 | 510,805.620 |  |
| 2.15% Belgium Government Bond 20660622  | 370,000.000 | 566,706.800 |  |
| 0.2% Belgium Government Bond 20231022   | 400,000.000 | 410,168.000 |  |
| 0.8% Belgium Government Bond 20270622   | 730,000.000 | 784,954.400 |  |
| 0.5% Belgium Government Bond 20241022   | 500,000.000 | 521,705.000 |  |
| 2.25% Belgium Government Bond 20570622  | 310,000.000 | 462,287.500 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.45% Belgium Government Bond<br>20370622 | 700,000.000   | 824,789.000   |  |
| 0.8% Belgium Government Bond<br>20280622  | 580,000.000   | 626,875.600   |  |
| 1.25% Belgium Government Bond<br>20330422 | 500,000.000   | 572,545.000   |  |
| 0.9% Belgium Government Bond<br>20290622  | 700,000.000   | 764,827.000   |  |
| 1.7% Belgium Government Bond<br>20500622  | 650,000.000   | 827,092.500   |  |
| 0.1% Belgium Government Bond<br>20300622  | 300,000.000   | 304,578.000   |  |
| Belgium Government Bond<br>20271022       | 3,000,000.000 | 3,049,110.000 |  |
| 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270704   | 1,955,000.000 | 2,950,681.500 |  |
| 5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280104 | 800,000.000   | 1,180,576.000 |  |
| 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20300104  | 896,000.000   | 1,484,376.320 |  |
| 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20310104   | 1,660,000.000 | 2,717,835.000 |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20340704  | 3,270,000.000 | 5,646,309.000 |  |
| 4% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20370104     | 690,000.000   | 1,179,996.600 |  |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20390704  | 420,000.000   | 778,583.400   |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20400704  | 2,510,000.000 | 5,016,184.800 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20420704  | 606,000.000   | 1,060,233.360 |  |
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220704  | 1,542,000.000 | 1,619,531.760 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20440704   | 1,648,000.000 | 2,673,006.560 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230215   | 1,150,000.000 | 1,218,839.000 |  |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230815     | 1,460,000.000 | 1,586,494.400 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240215 | 2,000,000.000 | 2,181,620.000 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20460815  | 1,225,000.000 | 2,036,133.750 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240515  | 990,000.000   | 1,076,120.100 |  |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240815    | 2,000,000.000 | 2,142,500.000 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20250215  | 1,190,000.000 | 1,256,616.200 |  |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20250815    | 6,100,000.000 | 6,635,763.000 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20260215  | 883,000.000   | 941,922.590   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20260815       | 2,050,000.000 | 2,132,164.000 |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270215 | 1,150,000.000 | 1,217,988.000 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270815  | 1,100,000.000 | 1,188,143.000 |  |
| 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20480815 | 1,260,000.000 | 1,698,883.200 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280215  | 750,000.000   | 813,150.000   |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280815 | 1,900,000.000 | 2,025,894.000 |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20290215 | 2,800,000.000 | 2,989,504.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20500815       | 750,000.000   | 742,350.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20211008       | 1,800,000.000 | 1,815,192.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220408       | 1,500,000.000 | 1,518,390.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20221007       | 1,800,000.000 | 1,828,926.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230414       | 150,000.000   | 153,024.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20231013       | 1,000,000.000 | 1,023,900.000 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240405       | 500,000.000   | 513,265.000   |  |
| 6% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20251025    | 3,415,000.000 | 4,609,327.950 |  |
| 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20290425  | 1,000,000.000 | 1,508,660.000 |  |
| 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20321025 | 1,700,000.000 | 2,899,333.000 |  |
| 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20350425 | 2,710,000.000 | 4,527,353.100 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20550425    | 1,232,000.000 | 2,497,572.000 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20381025    | 1,065,000.000 | 1,761,382.200 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20231025 | 1,200,000.000 | 1,397,460.000 |  |
| 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20410425  | 2,143,000.000 | 3,885,923.330 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20600425    | 650,000.000   | 1,387,223.500 |  |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260425  | 3,540,000.000 | 4,360,253.400 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20211025 | 3,314,000.000 | 3,486,328.000 |  |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220425    | 1,900,000.000 | 2,027,357.000 |  |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20271025 | 1,910,000.000 | 2,344,104.800 |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20221025 | 2,195,000.000 | 2,343,469.800 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20450525 | 1,190,000.000 | 1,939,021.700 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230525 | 4,730,000.000 | 5,056,370.000 |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20240525 | 2,200,000.000 | 2,445,498.000 |  |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20300525  | 2,686,000.000 | 3,382,990.140 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20241125 | 1,360,000.000 | 1,498,896.800 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20250525      | 4,400,000.000 | 4,618,064.000 |  |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20310525      | 1,500,000.000 | 1,751,205.000 |  |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260525      | 1,800,000.000 | 1,897,056.000 |  |
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20360525     | 1,250,000.000 | 1,441,037.500 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20660525     | 900,000.000   | 1,256,346.000 |  |
| 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20261125     | 2,970,000.000 | 3,085,354.800 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20390625     | 2,100,000.000 | 2,632,938.000 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20270525        | 1,400,000.000 | 1,528,072.000 |  |
| 2% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20480525        | 2,300,000.000 | 3,118,731.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230325           | 1,200,000.000 | 1,219,116.000 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20280525     | 1,500,000.000 | 1,619,055.000 |  |
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20340525     | 1,300,000.000 | 1,494,259.000 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20281125     | 2,250,000.000 | 2,432,182.500 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20240325           | 2,700,000.000 | 2,756,241.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220225           | 3,000,000.000 | 3,029,160.000 |  |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20500525      | 500,000.000   | 616,600.000   |  |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20290525      | 2,000,000.000 | 2,119,320.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20291125           | 4,200,000.000 | 4,243,974.000 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20520525     | 200,000.000   | 203,846.000   |  |
| 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20280115 | 580,000.000   | 843,691.200   |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20370115    | 1,200,000.000 | 2,014,752.000 |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230115 | 1,170,000.000 | 1,304,070.300 |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20420115 | 830,000.000   | 1,498,689.500 |  |
| 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20210715 | 1,100,000.000 | 1,145,980.000 |  |
| 2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20220715 | 500,000.000   | 530,300.000   |  |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20330115  | 290,000.000   | 388,663.800   |  |
| 1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230715 | 750,000.000   | 805,372.500   |  |
| 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20470115 | 1,140,000.000 | 1,944,555.000 |  |
| 2% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20240715    | 480,000.000   | 531,595.200   |  |
| 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20250715 | 690,000.000   | 718,572.900   |  |
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20260715  | 1,170,000.000 | 1,241,475.300 |  |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20270715 | 470,000.000   | 509,968.800   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND<br>20240115       | 400,000.000   | 408,844.000   |  |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20280715 | 600,000.000   | 655,668.000   |  |
| 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20290715 | 2,000,000.000 | 2,103,720.000 |  |
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20400115  | 250,000.000   | 273,975.000   |  |
| 7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20261101     | 1,600,000.000 | 2,211,792.000 |  |
| 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20271101      | 1,635,000.000 | 2,241,029.100 |  |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20241201      | 3,100,000.000 | 3,338,390.000 |  |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20460901     | 705,000.000   | 829,918.950   |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20250601  | 920,000.000   | 950,709.600   |  |
| 1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20320301 | 1,000,000.000 | 1,007,510.000 |  |
| 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20251201    | 500,000.000   | 529,455.000   |  |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220915 | 800,000.000   | 821,584.000   |  |
| 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20470301  | 2,200,000.000 | 2,369,114.000 |  |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20230315 | 1,200,000.000 | 1,220,364.000 |  |
| 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20360901 | 1,750,000.000 | 1,833,230.000 |  |
| 0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20231015 | 2,400,000.000 | 2,417,136.000 |  |
| 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20211101 | 3,000,000.000 | 3,012,030.000 |  |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20670301  | 1,400,000.000 | 1,496,138.000 |  |
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20330901 | 1,300,000.000 | 1,408,576.000 |  |
| 2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601  | 1,200,000.000 | 1,285,800.000 |  |
| 1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220401  | 1,500,000.000 | 1,527,180.000 |  |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20480301 | 350,000.000   | 426,716.500   |  |
| 2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20270801 | 1,550,000.000 | 1,644,596.500 |  |
| 0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220801  | 700,000.000   | 710,234.000   |  |
| 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20280201    | 3,200,000.000 | 3,384,288.000 |  |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20281201  | 1,400,000.000 | 1,569,470.000 |  |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20251115  | 2,500,000.000 | 2,710,350.000 |  |
| 3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20350301 | 500,000.000   | 594,685.000   |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20490901           | 200,000.000   | 260,792.000   |  |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20290801              | 1,000,000.000 | 1,141,800.000 |  |
| 2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20260715            | 200,000.000   | 212,796.000   |  |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20300801           | 2,000,000.000 | 1,910,300.000 |  |
| 5.25% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20291101 | 2,040,000.000 | 2,731,213.200 |  |
| 6% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20310501    | 1,588,000.000 | 2,289,260.800 |  |
| 5.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20330201 | 1,000,000.000 | 1,456,390.000 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20340801    | 1,450,000.000 | 2,015,732.000 |  |
| 4% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20370201    | 1,270,000.000 | 1,624,990.400 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20390801    | 1,640,000.000 | 2,384,576.400 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20230801 | 3,870,000.000 | 4,390,398.900 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20250301    | 1,700,000.000 | 2,031,381.000 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20400901    | 1,714,000.000 | 2,497,195.160 |  |
| 4.5% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20260301  | 3,250,000.000 | 3,888,527.500 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20210901 | 1,320,000.000 | 1,395,187.200 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del<br>Tesoro 20220301    | 780,000.000   | 844,638.600   |  |
| 5.5% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20220901  | 500,000.000   | 558,135.000   |  |
| 5.5% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20221101  | 6,770,000.000 | 7,603,251.600 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20280901 | 80,000.000    | 101,637.600   |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20440901 | 725,000.000   | 1,051,351.500 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 4.5% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20240301  | 830,000.000   | 948,856.000   |  |
| 3.75% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20240901 | 1,610,000.000 | 1,812,988.800 |  |
| 3.5% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20300301  | 1,370,000.000 | 1,626,888.700 |  |
| 2.15% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20211215 | 700,000.000   | 721,784.000   |  |
| 5.5% Belgium Government Bond<br>20280328            | 1,000,000.000 | 1,449,120.000 |  |
| 5% Belgium Government Bond<br>20350328              | 750,000.000   | 1,268,235.000 |  |
| 4% Belgium Government Bond<br>20220328              | 550,000.000   | 595,265.000   |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20410328           | 815,000.000   | 1,409,795.150 |  |
| 4.5% Belgium Government Bond<br>20260328            | 700,000.000   | 899,416.000   |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20220928           | 730,000.000   | 811,431.500   |  |
| 4% Belgium Government Bond<br>20320328              | 300,000.000   | 438,498.000   |  |
| 2.25% Belgium Government Bond<br>20230622           | 1,000,000.000 | 1,085,880.000 |  |
| 3.75% Belgium Government Bond<br>20450622           | 540,000.000   | 933,984.000   |  |
| 2.6% Belgium Government Bond<br>20240622            | 800,000.000   | 901,208.000   |  |
| 3% Belgium Government Bond<br>20340622              | 300,000.000   | 416,418.000   |  |
| 5.4% IRISH TREASURY 20250313                        | 688,000.000   | 876,525.760   |  |
| 3.9% IRISH TREASURY 20230320                        | 420,000.000   | 470,694.000   |  |
| 3.4% IRISH TREASURY 20240318                        | 600,000.000   | 686,310.000   |  |
| 2.4% IRISH TREASURY 20300515                        | 680,000.000   | 835,781.200   |  |
| 2% IRISH TREASURY 20450218                          | 710,000.000   | 940,352.400   |  |
| 1% IRISH TREASURY 20260515                          | 320,000.000   | 343,456.000   |  |
| 1.7% IRISH TREASURY 20370515                        | 570,000.000   | 687,779.100   |  |
| 0.9% IRISH TREASURY 20280515                        | 500,000.000   | 538,485.000   |  |
| 1.3% IRISH TREASURY 20330515                        | 150,000.000   | 170,145.000   |  |
| 1.35% IRISH TREASURY 20310318                       | 600,000.000   | 677,886.000   |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.5% IRISH TREASURY 20500515               | 150,000.000   | 180,714.000   |  |
| 6.25% Austria Government Bond<br>20270715  | 380,000.000   | 558,790.000   |  |
| 3.5% Austria Government Bond<br>20210915   | 660,000.000   | 693,567.600   |  |
| 4.15% Austria Government Bond<br>20370315  | 1,110,000.000 | 1,849,049.100 |  |
| 4.85% Austria Government Bond<br>20260315  | 700,000.000   | 916,244.000   |  |
| 3.65% Austria Government Bond<br>20220420  | 900,000.000   | 970,731.000   |  |
| 3.4% Austria Government Bond<br>20221122   | 860,000.000   | 944,426.200   |  |
| 3.8% Austria Government Bond<br>20620126   | 420,000.000   | 944,987.400   |  |
| 3.15% Austria Government Bond<br>20440620  | 530,000.000   | 885,259.000   |  |
| 1.75% Austria Government Bond<br>20231020  | 680,000.000   | 733,781.200   |  |
| 2.4% Austria Government Bond<br>20340523   | 430,000.000   | 570,906.700   |  |
| 1.65% Austria Government Bond<br>20241021  | 880,000.000   | 965,703.200   |  |
| 4% Finland Government Bond<br>20250704     | 200,000.000   | 246,218.000   |  |
| 2.75% Finland Government Bond<br>20280704  | 120,000.000   | 149,655.600   |  |
| 1.625% Finland Government<br>Bond 20220915 | 980,000.000   | 1,028,902.000 |  |
| 2.625% Finland Government<br>Bond 20420704 | 210,000.000   | 320,096.700   |  |
| 2% Finland Government Bond<br>20240415     | 350,000.000   | 384,853.000   |  |
| 6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20290131     | 1,420,000.000 | 2,092,441.000 |  |
| 1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20250430   | 1,400,000.000 | 1,510,782.000 |  |
| 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20300730  | 2,610,000.000 | 2,970,963.000 |  |
| 2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20251031  | 1,365,000.000 | 1,520,186.850 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20260430 | 1,000,000.000 | 1,109,650.000 |  |
| 0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20210730 | 1,000,000.000 | 1,012,920.000 |  |
| 2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20461031  | 689,000.000   | 926,388.060   |  |
| 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20660730 | 830,000.000   | 1,309,574.000 |  |
| 1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20261031  | 3,249,000.000 | 3,484,682.460 |  |
| 0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20220430  | 1,250,000.000 | 1,267,787.500 |  |
| 1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20270430  | 1,100,000.000 | 1,197,218.000 |  |
| 2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20330730 | 1,320,000.000 | 1,578,944.400 |  |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20271031 | 1,170,000.000 | 1,269,040.500 |  |
| 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20280430  | 1,650,000.000 | 1,787,626.500 |  |
| 2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20481031  | 550,000.000   | 718,993.000   |  |
| 0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20211031 | 1,500,000.000 | 1,508,190.000 |  |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20290430 | 800,000.000   | 870,456.000   |  |
| 1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20350730 | 600,000.000   | 679,500.000   |  |
| 0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20291031  | 1,200,000.000 | 1,214,304.000 |  |
| 0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20300430  | 1,000,000.000 | 998,150.000   |  |
| 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20320730 | 980,000.000   | 1,560,552.000 |  |
| 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20370131  | 800,000.000   | 1,198,304.000 |  |
| 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20400730  | 900,000.000   | 1,505,250.000 |  |
| 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20410730  | 2,343,000.000 | 3,884,131.680 |  |

|         |   |               |  |  |
|---------|---|---------------|--|--|
|         | 5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20260730  | 1,000,000.000 | 1,352,210.000                              |  |
|         | 5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20220131 | 600,000.000   | 660,828.000                                |  |
|         | 5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20230131  | 4,310,000.000 | 4,951,371.100                              |  |
|         | 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20231031  | 1,588,000.000 | 1,834,600.520                              |  |
|         | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20281031 | 2,100,000.000 | 2,925,384.000                              |  |
|         | 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20441031 | 890,000.000   | 1,605,738.000                              |  |
|         | 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20240430  | 2,200,000.000 | 2,536,424.000                              |  |
|         | 2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20241031 | 2,084,000.000 | 2,342,707.760                              |  |
|         | ユーロ 小計                                    |               | ユーロ<br>365,655,369.730<br>(44,127,290,019) |  |
| 国債証券 合計 |   |               | 111,031,651,188<br>[111,031,651,188]       |  |
| 合計      |   |               | 111,031,651,188<br>[111,031,651,188]       |  |

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

| 通貨           | 銘柄数       | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|--------------|-----------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル      | 国債証券 67銘柄 | 100%         | 46.0%          |
| イギリス・ポンド     | 国債証券 39銘柄 | 100%         | 6.8%           |
| イスラエル・シケル    | 国債証券 5銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| オーストラリア・ドル   | 国債証券 20銘柄 | 100%         | 2.1%           |
| カナダ・ドル       | 国債証券 21銘柄 | 100%         | 2.0%           |
| シンガポール・ドル    | 国債証券 15銘柄 | 100%         | 0.4%           |
| スウェーデン・クローナ  | 国債証券 6銘柄  | 100%         | 0.3%           |
| デンマーク・クローネ   | 国債証券 6銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| ノルウェー・クローネ   | 国債証券 7銘柄  | 100%         | 0.2%           |
| ポーランド・ズロチ    | 国債証券 12銘柄 | 100%         | 0.5%           |
| マレーシア・リングギット | 国債証券 15銘柄 | 100%         | 0.5%           |

|         |      |       |      |       |
|---------|------|-------|------|-------|
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 14銘柄  | 100% | 0.7%  |
| ユーロ     | 国債証券 | 241銘柄 | 100% | 39.7% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 14,528,190          | 18,501,508          |
| 親投資信託受益証券       | 3,672,973,565       | 4,945,239,664       |
| 未収入金            | -                   | 2,607,743           |
| 流動資産合計          | 3,687,501,755       | 4,966,348,915       |
| 資産合計            | 3,687,501,755       | 4,966,348,915       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 4,224,609           | 6,313,475           |
| 未払受託者報酬         | 354,656             | 519,988             |
| 未払委託者報酬         | 6,384,623           | 9,360,616           |
| その他未払費用         | 134,302             | 194,959             |
| 流動負債合計          | 11,098,190          | 16,389,038          |
| 負債合計            | 11,098,190          | 16,389,038          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 3,348,730,912     | 1 4,275,100,523     |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 327,672,653         | 674,859,354         |
| （分配準備積立金）       | 62,444,006          | 245,040,071         |
| 元本等合計           | 3,676,403,565       | 4,949,959,877       |
| 純資産合計           | 3,676,403,565       | 4,949,959,877       |
| 負債純資産合計         | 3,687,501,755       | 4,966,348,915       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期                          |                    | 第4期                          |                    |
|-------------------------|------------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|
|                         | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |                    | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |                    |
| <b>営業収益</b>             |                              |                    |                              |                    |
| 受取利息                    |                              | 1                  |                              | 44                 |
| 有価証券売買等損益               |                              | 87,989,142         |                              | 243,951,145        |
| <b>営業収益合計</b>           |                              | <b>87,989,143</b>  |                              | <b>243,951,189</b> |
| <b>営業費用</b>             |                              |                    |                              |                    |
| 支払利息                    |                              | 5,954              |                              | 5,030              |
| 受託者報酬                   |                              | 650,550            |                              | 944,174            |
| 委託者報酬                   |                              | 11,711,445         |                              | 16,996,709         |
| その他費用                   |                              | 244,400            |                              | 355,643            |
| <b>営業費用合計</b>           |                              | <b>12,612,349</b>  |                              | <b>18,301,556</b>  |
| <b>営業利益</b>             |                              | <b>75,376,794</b>  |                              | <b>225,649,633</b> |
| 経常利益                    |                              | 75,376,794         |                              | 225,649,633        |
| <b>当期純利益</b>            |                              | <b>75,376,794</b>  |                              | <b>225,649,633</b> |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |                              | 7,634,705          |                              | 27,055,667         |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         |                              | 159,269,428        |                              | 327,672,653        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |                              | 140,955,221        |                              | 268,857,433        |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | 140,955,221        |                              | 268,857,433        |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |                              | 40,294,085         |                              | 120,264,698        |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |                              | 40,294,085         |                              | 120,264,698        |
| 分配金                     |                              | 1 -                |                              | 1 -                |
| <b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>  |                              | <b>327,672,653</b> |                              | <b>674,859,354</b> |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 2,246,613,872円 | 3,348,730,912円 |
| 期中追加設定元本額           | 1,649,381,625円 | 2,078,908,391円 |
| 期中一部解約元本額           | 547,264,585円   | 1,152,538,780円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 3,348,730,912口 | 4,275,100,523口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|                   |  |  |
|-------------------|--|--|
| <p>1 分配金の計算過程</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(54,700,792円)、投資信託約款に規定される収益調整金(265,234,087円)及び分配準備積立金(7,743,214円)より分配対象額は327,678,093円(1万口当たり978.51円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(198,594,239円)、投資信託約款に規定される収益調整金(429,823,606円)及び分配準備積立金(46,445,832円)より分配対象額は674,863,677円(1万口当たり1,578.59円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|-------------------|--|--|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 84,061,696               | 224,193,329              |
| 合計        | 84,061,696               | 224,193,329              |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.0978円<br>(10,978円) | 1.1579円<br>(11,579円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄               | 券面総額          | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|-------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | 外国債券インデックスマザーファンド | 1,671,366,657 | 4,945,239,664 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                   |               | 4,945,239,664 |    |
| 合計           |                   |               | 4,945,239,664 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金額(円)        | 金額(円)        |
| 資産の部 |              |              |
| 流動資産 |              |              |

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 預金              | 283,833,241      | 667,928,965     |
| コール・ローン         | 961,052,430      | 1,364,247,470   |
| 国債証券            | 172,799,261,126  | 191,001,914,387 |
| 派生商品評価勘定        | 962,330          | 8,190,994       |
| 未収入金            | 210,828          | 4,734,146       |
| 未収利息            | 1,198,596,642    | 1,112,578,983   |
| 前払費用            | 36,497,176       | 59,451,596      |
| 流動資産合計          | 175,280,413,773  | 194,219,046,541 |
| 資産合計            | 175,280,413,773  | 194,219,046,541 |
| 負債の部            |                  |                 |
| 流動負債            |                  |                 |
| 派生商品評価勘定        | 2,553,600        | 1,577,610       |
| 未払金             | 1,168,600        | -               |
| 未払解約金           | 19,756,159       | 41,862,143      |
| その他未払費用         | -                | 4,053           |
| 流動負債合計          | 23,478,359       | 43,443,806      |
| 負債合計            | 23,478,359       | 43,443,806      |
| 純資産の部           |                  |                 |
| 元本等             |                  |                 |
| 元本              | 1 62,737,394,108 | 65,627,347,601  |
| 剰余金             |                  |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 112,519,541,306  | 128,548,255,134 |
| 元本等合計           | 175,256,935,414  | 194,175,602,735 |
| 純資産合計           | 175,256,935,414  | 194,175,602,735 |
| 負債純資産合計         | 175,280,413,773  | 194,219,046,541 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券                         |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
|                                   | <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>  |
| <p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>     | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>   |
| <p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分           | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 1. 1 期首       | 2018年6月16日      | 2019年6月18日      |
| 期首元本額         | 60,439,178,019円 | 62,737,394,108円 |
| 期中追加設定元本額     | 6,100,976,543円  | 10,608,003,880円 |
| 期中一部解約元本額     | 3,802,760,454円  | 7,718,050,387円  |
| 期末元本額の内訳      |                 |                 |
| ファンド名         |                 |                 |
| ダイワ外国債券インデックス | 654,072,209円    | 621,076,448円    |
| V A           |                 |                 |

|  |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|
| ダイワ国内重視バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私<br>募)                     | 22,454,828円     | 17,810,994円     |
| ダイワ国内重視バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私<br>募)                     | 147,272,269円    | 110,163,708円    |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド30VA(一般投資家私<br>募)                     | 41,724,252円     | 32,499,022円     |
| ダイワ国際分散バランスファン<br>ド50VA(一般投資家私<br>募)                     | 480,965,798円    | 357,989,526円    |
| 外国債券インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投資<br>家専用)                 | 11,613,534円     | 61,380,663円     |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス エマー<br>ジングプラス(為替ヘッジな<br>し)     | 384,151,534円    | 461,248,869円    |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス(為替ヘッ<br>ジなし)                   | 1,314,828,554円  | 1,671,366,657円  |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国債券インデックス<br>エマージングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 773,960,847円    | 636,150,174円    |
| D-I's 外国債券インデッ<br>クス                                     | 2,268,798円      | 1,079,976円      |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                                   | 69,170円         | 813,493円        |
| iFree 外国債券イン<br>デックス                                     | 554,887,492円    | 639,249,370円    |
| iFree 8資産バランス  | 613,821,475円    | 817,834,455円    |
| iFree 年金バランス   | 9,711,173円      | 32,559,558円     |
| DCダイワ外国債券インデッ<br>クス                                      | 43,728,026,780円 | 46,802,673,697円 |
| ダイワ・ライフ・バランス3<br>0                                       | 758,436,363円    | 779,403,095円    |
| ダイワ・ライフ・バランス5<br>0                                       | 377,625,094円    | 408,565,954円    |
| ダイワ・ライフ・バランス7<br>0                                       | 231,913,346円    | 245,441,653円    |

|                                  |                |                |
|----------------------------------|----------------|----------------|
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)       | 364,075,106円   | 395,428,004円   |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)      | 286,464,004円   | 314,331,404円   |
| DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)       | 93,554,489円    | 99,746,809円    |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2020               | 10,211,317円    | 9,276,813円     |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030               | 18,516,474円    | 20,253,456円    |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040               | 2,180,071円     | 4,169,007円     |
| ダイワつみたてインデックス外国債券                | 31,345,881円    | 124,719,051円   |
| ダイワつみたてインデックスバランス30              | 53,558円        | 3,010,075円     |
| ダイワつみたてインデックスバランス50              | 35,706円        | 818,648円       |
| ダイワつみたてインデックスバランス70              | 35,706円        | 812,361円       |
| ダイワ世界バランスファンド40VA                | 211,467,656円   | 188,609,451円   |
| ダイワ世界バランスファンド60VA                | 149,389,183円   | 136,649,195円   |
| ダイワ・バランスファンド35VA                 | 5,225,915,482円 | 4,342,555,265円 |
| ダイワ・ワールド・バランスファンド75VA            | 1,603,962円     | -円             |
| ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)      | 308,506,848円   | 264,162,108円   |
| ダイワ・インデックスセレクト 外国債券              | 148,300,880円   | 145,125,587円   |
| ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド               | 30,702,909円    | 30,410,471円    |
| ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用) | 3,934,856円     | 18,798,389円    |
| ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス               | 5,631,519,712円 | 5,724,174,641円 |
| ダイワライフスタイル25                     | 34,452,178円    | 32,344,719円    |

|    |               |                 |                 |
|----|---------------|-----------------|-----------------|
|    | ダイワライフスタイル50  | 60,560,622円     | 59,827,227円     |
|    | ダイワライフスタイル75  | 16,763,992円     | 14,817,608円     |
| 計  |               | 62,737,394,108円 | 65,627,347,601円 |
| 2. | 期末日における受益権の総数 | 62,737,394,108口 | 65,627,347,601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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク                | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。<br>信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制              | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項<br>についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                          | 2020年6月15日現在                                |
|------------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表<br>計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法              | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。     |

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 2019年6月17日現在           | 2020年6月15日現在           |
|------|------------------------|------------------------|
|      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 8,527,965,263          | 5,887,464,880          |
| 合計   | 8,527,965,263          | 5,887,464,880          |

（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6月17日まで、及び2019年12月3日から2020年6月15日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

| 種 類        | 2019年6月17日 現在 |           |             |             | 2020年6月15日 現在 |           |               |             |
|------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|            | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|            | (円)           | うち<br>1年超 |             |             | (円)           | うち<br>1年超 |               |             |
| 市場取引以外の取引  |               |           |             |             |               |           |               |             |
| 為替予約取引     |               |           |             |             |               |           |               |             |
| 買 建        | 962,987,000   | -         | 961,395,730 | 1,591,270   | 1,598,279,906 | -         | 1,604,893,290 | 6,613,384   |
| アメリカ・ドル    | 442,047,550   | -         | 440,916,760 | 1,130,790   | 255,154,838   | -         | 255,281,000   | 126,162     |
| イギリス・ポンド   | 61,551,731    | -         | 61,369,320  | 182,411     | 45,297,247    | -         | 45,464,340    | 167,093     |
| オーストラリア・ドル | 3,850,994     | -         | 3,808,170   | 42,824      | 26,012,160    | -         | 26,439,200    | 427,040     |
| カナダ・ドル     | 51,595,479    | -         | 51,707,880  | 112,401     | 38,659,303    | -         | 38,923,670    | 264,367     |

|                 |             |   |             |           |               |   |               |           |
|-----------------|-------------|---|-------------|-----------|---------------|---|---------------|-----------|
| シンガポール・<br>ドル   | 23,732,703  | - | 23,748,000  | 15,297    | 20,422,136    | - | 20,590,440    | 168,304   |
| スウェーデン・<br>クローナ | 2,156,276   | - | 2,152,600   | 3,676     | 24,137,565    | - | 24,532,760    | 395,195   |
| デンマーク・<br>クローネ  | 7,784,257   | - | 7,784,640   | 383       | -             | - | -             | -         |
| ノルウェー・<br>クローネ  | 12,093,167  | - | 12,120,840  | 27,673    | 10,795,217    | - | 10,871,980    | 76,763    |
| ポーランド・<br>ズロチ   | 23,728,799  | - | 23,938,200  | 209,401   | -             | - | -             | -         |
| メキシコ・ペソ         | 20,124,048  | - | 20,366,040  | 241,992   | 59,912,376    | - | 59,017,740    | 894,636   |
| ユーロ             | 306,243,343 | - | 305,431,280 | 812,063   | 1,117,889,064 | - | 1,123,772,160 | 5,883,096 |
| 南アフリカ・<br>ランド   | 8,078,653   | - | 8,052,000   | 26,653    | -             | - | -             | -         |
| 合計              | 962,987,000 | - | 961,395,730 | 1,591,270 | 1,598,279,906 | - | 1,604,893,290 | 6,613,384 |

## (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6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.7935円      | 2.9588円      |
| (1万口当たり純資産額) | (27,935円)    | (29,588円)    |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類  | 通貨          | 銘柄   | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|---|-------------|--|---------------|---------------|----|
| 国債証券  | アメリカ・ドル     |  | アメリカ・ドル       | アメリカ・ドル       |    |
|   |             | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210815 | 2,534,000.000 | 2,591,192.380 |    |
|   |             | 2% United States Treasury Note/Bond 20211115     | 2,153,000.000 | 2,208,073.740 |    |
|   |             | 2% United States Treasury Note/Bond 20220215     | 3,224,000.000 | 3,320,075.200 |    |
|   |             | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515  | 2,459,000.000 | 2,531,319.190 |    |
|   |             | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815 | 2,543,000.000 | 2,621,171.820 |    |
|   |             | 1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115 | 6,668,000.000 | 6,896,379.000 |    |
|   |             | 2% United States Treasury Note/Bond 20230215     | 4,350,000.000 | 4,557,973.500 |    |
|   |             | 1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515  | 4,685,000.000 | 4,894,700.600 |    |
|   |             | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815   | 4,568,000.000 | 4,896,302.160 |    |
|   |             | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115  | 5,021,000.000 | 5,449,341.510 |    |
|   |             | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215  | 5,229,000.000 | 5,705,309.610 |    |
|   |             | 2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515   | 4,912,000.000 | 5,337,919.520 |    |
|   |             | 2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630 | 3,485,000.000 | 3,555,501.550 |    |
|   |             | 8% United States Treasury Note/Bond 20211115     | 2,106,000.000 | 2,340,039.780 |    |
| 6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815 | 654,000.000 | 778,717.800                                      |               |               |    |
| 6% United States Treasury Note/Bond 20260215    | 855,000.000 | 1,122,914.250                                    |               |               |    |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 709,000.000   | 998,633.590   |  |
| 5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815   | 700,000.000   | 975,072.000   |  |
| 5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115  | 738,000.000   | 1,020,742.560 |  |
| 5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215  | 473,000.000   | 659,054.550   |  |
| 6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515  | 714,000.000   | 1,098,553.260 |  |
| 5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 891,000.000   | 1,321,388.640 |  |
| 4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215   | 676,000.000   | 1,028,993.680 |  |
| 5% United States Treasury Note/Bond 20370515     | 847,000.000   | 1,381,600.990 |  |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215 | 548,000.000   | 846,528.480   |  |
| 4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515   | 519,000.000   | 813,854.280   |  |
| 3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215   | 1,049,000.000 | 1,475,481.440 |  |
| 4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515  | 1,121,000.000 | 1,721,082.510 |  |
| 4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815   | 1,060,000.000 | 1,676,570.200 |  |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115 | 1,210,000.000 | 1,890,237.800 |  |
| 4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215 | 1,010,000.000 | 1,627,039.300 |  |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 1,678,000.000 | 2,632,882.680 |  |
| 3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 591,000.000   | 874,792.290   |  |
| 4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115  | 1,469,000.000 | 2,279,579.510 |  |
| 4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215  | 1,254,000.000 | 2,065,325.460 |  |
| 4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 1,365,000.000 | 2,154,829.950 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 3.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20410815  | 1,517,000.000 | 2,217,186.520 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20411115 | 1,450,000.000 | 1,948,539.000 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20420215 | 1,623,000.000 | 2,185,077.360 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20420515     | 1,353,000.000 | 1,788,178.920 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20420815  | 2,231,000.000 | 2,836,404.160 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20421115  | 1,630,000.000 | 2,071,746.300 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20430215 | 2,626,000.000 | 3,535,042.420 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20430515 | 1,898,000.000 | 2,462,787.860 |  |
| 3.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20430815 | 3,214,000.000 | 4,661,778.440 |  |
| 3.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20431115  | 2,081,000.000 | 3,075,322.610 |  |
| 3.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20440215 | 3,707,000.000 | 5,393,091.880 |  |
| 3.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20440515 | 3,327,000.000 | 4,672,338.990 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20210731  | 2,834,000.000 | 2,899,522.080 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20240815 | 6,162,000.000 | 6,696,307.020 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20440815 | 1,929,000.000 | 2,611,750.260 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20210831     | 1,301,000.000 | 1,329,452.870 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210930 | 3,625,000.000 | 3,713,921.250 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20211031     | 2,163,000.000 | 2,217,572.490 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241115  | 5,921,000.000 | 6,426,594.190 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20441115     | 3,846,000.000 | 5,113,526.220 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20211130 | 2,886,000.000 | 2,956,678.140 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20211231 | 3,169,000.000 | 3,263,309.440 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20220131   | 2,527,000.000 | 2,580,496.590 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20250215     | 5,743,000.000 | 6,190,322.270 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20450215   | 2,563,000.000 | 3,137,265.780 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220228  | 3,809,000.000 | 3,909,557.600 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220331  | 2,891,000.000 | 2,970,039.940 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20250515 | 5,788,000.000 | 6,292,134.800 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20450515     | 2,835,000.000 | 3,779,395.200 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220430  | 2,612,000.000 | 2,688,296.520 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220531 | 1,326,000.000 | 1,369,651.920 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20220630 | 2,821,000.000 | 2,931,837.090 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20220731     | 4,179,000.000 | 4,338,972.120 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20250815     | 5,743,000.000 | 6,224,378.260 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20450815 | 3,873,000.000 | 5,066,348.760 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220831 | 2,445,000.000 | 2,535,342.750 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220930  | 2,472,000.000 | 2,560,448.160 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20251115  | 5,840,000.000 | 6,422,598.400 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20451115     | 709,000.000   | 949,393.540   |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20221031 | 2,558,000.000 | 2,659,117.740 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20221130     | 6,287,000.000 | 6,564,005.220 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20221231 | 4,992,000.000 | 5,234,561.280 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260215 | 4,366,000.000 | 4,660,006.440 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230131  | 2,561,000.000 | 2,664,438.790 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20460215   | 3,648,000.000 | 4,484,741.760 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230228   | 2,962,000.000 | 3,064,485.200 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230331   | 3,623,000.000 | 3,753,754.070 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260515 | 3,729,000.000 | 3,987,680.730 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20230430 | 2,070,000.000 | 2,153,917.800 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20460515   | 3,423,000.000 | 4,216,143.330 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20230531 | 2,500,000.000 | 2,603,700.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210630 | 2,500,000.000 | 2,524,400.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230630 | 3,000,000.000 | 3,105,450.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20260815   | 5,400,000.000 | 5,739,174.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20460815  | 3,480,000.000 | 4,096,864.800 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210831 | 3,700,000.000 | 3,741,625.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210731 | 3,700,000.000 | 3,738,998.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20230731  | 2,780,000.000 | 2,868,821.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230831 | 2,400,000.000 | 2,487,744.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230930 | 2,505,000.000 | 2,599,714.050 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20210930 | 3,042,000.000 | 3,078,595.260 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20261115     | 5,300,000.000 | 5,808,429.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20211031  | 3,000,000.000 | 3,045,690.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20231031 | 2,500,000.000 | 2,616,975.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20461115 | 3,500,000.000 | 4,621,470.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20231130 | 2,490,000.000 | 2,651,850.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20211130  | 3,400,000.000 | 3,477,826.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20211231     | 4,000,000.000 | 4,111,680.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20231231  | 2,500,000.000 | 2,677,125.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20270215  | 6,140,000.000 | 6,843,214.200 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220131 | 3,010,000.000 | 3,092,293.400 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240131  | 2,480,000.000 | 2,659,006.400 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20470215     | 3,545,000.000 | 4,795,427.850 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220228 | 3,010,000.000 | 3,096,748.200 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240229 | 2,300,000.000 | 2,458,838.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240331 | 4,550,000.000 | 4,869,546.500 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220331 | 2,900,000.000 | 2,987,000.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20270515 | 6,400,000.000 | 7,205,952.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20470515     | 3,500,000.000 | 4,736,725.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220430 | 3,000,000.000 | 3,094,080.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240430     | 3,000,000.000 | 3,200,130.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220531  | 3,000,000.000 | 3,090,210.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240531     | 3,800,000.000 | 4,058,248.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220630  | 3,000,000.000 | 3,094,680.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20240630     | 2,400,000.000 | 2,566,488.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20270815  | 5,900,000.000 | 6,610,714.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220731 | 2,900,000.000 | 3,003,298.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240731 | 3,000,000.000 | 3,228,030.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20470815  | 3,450,000.000 | 4,477,168.500 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20220831 | 3,200,000.000 | 3,300,224.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20240831 | 2,000,000.000 | 2,132,800.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20220930 | 2,500,000.000 | 2,595,875.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20240930 | 2,500,000.000 | 2,695,875.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20221031     | 2,500,000.000 | 2,606,425.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20271115  | 5,500,000.000 | 6,177,160.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20471115  | 3,500,000.000 | 4,544,505.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241031  | 3,500,000.000 | 3,797,500.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20241130 | 3,200,000.000 | 3,458,496.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20241231  | 2,800,000.000 | 3,044,552.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230131 | 3,500,000.000 | 3,699,325.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20280215  | 5,650,000.000 | 6,575,187.500 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20230228 | 3,300,000.000 | 3,515,523.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20250131   | 2,600,000.000 | 2,861,196.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20250228  | 2,700,000.000 | 3,006,477.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20480215     | 3,800,000.000 | 5,165,150.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230331   | 2,900,000.000 | 3,084,875.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20250331 | 2,900,000.000 | 3,217,173.000 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20480515 | 4,200,000.000 | 5,844,048.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20280515 | 6,500,000.000 | 7,652,710.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230430  | 2,500,000.000 | 2,681,625.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20250430 | 1,900,000.000 | 2,133,928.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20250531 | 3,550,000.000 | 3,992,614.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230531  | 2,500,000.000 | 2,686,700.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20210615 | 3,000,000.000 | 3,073,230.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20230630 | 2,500,000.000 | 2,682,025.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20250630  | 3,000,000.000 | 3,360,000.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20210715 | 3,300,000.000 | 3,386,724.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230731  | 3,850,000.000 | 4,153,457.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20280815 | 6,700,000.000 | 7,916,452.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20480815     | 4,220,000.000 | 5,759,793.600 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20210815  | 2,500,000.000 | 2,574,500.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20250731 | 2,500,000.000 | 2,820,100.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20230831  | 3,600,000.000 | 3,890,520.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20250831  | 3,600,000.000 | 4,043,232.000 |  |
| 2.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20210915  | 3,500,000.000 | 3,611,965.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20250930     | 2,500,000.000 | 2,844,725.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20230930 | 3,000,000.000 | 3,258,750.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20211015 | 3,000,000.000 | 3,107,220.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20251031     | 2,500,000.000 | 2,848,625.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20231031 | 4,000,000.000 | 4,353,120.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20211115 | 4,000,000.000 | 4,152,320.000 |  |
| 3.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20281115 | 4,900,000.000 | 5,910,233.000 |  |
| 3.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20481115 | 4,520,000.000 | 6,597,753.600 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20251130 | 3,000,000.000 | 3,402,420.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20231130 | 2,000,000.000 | 2,180,920.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20211215 | 2,800,000.000 | 2,902,032.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20251231 | 3,500,000.000 | 3,925,985.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20231231 | 2,500,000.000 | 2,708,975.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20220115   | 3,000,000.000 | 3,108,840.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20290215 | 6,600,000.000 | 7,715,796.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20220215   | 3,000,000.000 | 3,114,480.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20240131   | 4,000,000.000 | 4,323,720.000 |  |
| 2.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260131 | 2,500,000.000 | 2,808,375.000 |  |
| 3% United States Treasury<br>Note/Bond 20490215     | 4,700,000.000 | 6,444,123.000 |  |
| 2.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20260228   | 2,500,000.000 | 2,794,125.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20240229 | 3,300,000.000 | 3,558,060.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20220315 | 3,500,000.000 | 3,632,720.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20260331  | 2,500,000.000 | 2,761,125.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20220415  | 3,700,000.000 | 3,838,602.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20220515 | 3,400,000.000 | 3,524,950.000 |  |
| 2.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20490515 | 4,650,000.000 | 6,245,508.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20290515 | 3,900,000.000 | 4,489,251.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240430  | 3,500,000.000 | 3,767,400.000 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20260430 | 2,800,000.000 | 3,115,420.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220615  | 3,500,000.000 | 3,608,395.000 |  |
| 2.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20260531 | 3,000,000.000 | 3,297,180.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20240630  | 3,500,000.000 | 3,707,515.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20210630 | 2,700,000.000 | 2,740,392.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20260630 | 2,800,000.000 | 3,037,104.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20220715  | 4,000,000.000 | 4,128,560.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20210731  | 4,700,000.000 | 4,782,579.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20240731  | 3,500,000.000 | 3,710,805.000 |  |
| 1.875% United States Treasury<br>Note/Bond 20260731 | 2,500,000.000 | 2,714,050.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20290815 | 6,900,000.000 | 7,498,851.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20220815   | 3,500,000.000 | 3,598,560.000 |  |
| 2.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20490815  | 4,600,000.000 | 5,485,500.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20210831   | 3,100,000.000 | 3,149,042.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20260831 | 2,800,000.000 | 2,955,960.000 |  |
| 1.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20240831  | 4,000,000.000 | 4,160,920.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20220915   | 3,000,000.000 | 3,087,990.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20210930   | 5,100,000.000 | 5,186,241.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20260930 | 2,500,000.000 | 2,678,125.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20240930   | 3,000,000.000 | 3,154,200.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20221015 | 2,900,000.000 | 2,978,706.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20241031   | 1,000,000.000 | 1,052,100.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20211031   | 2,550,000.000 | 2,595,900.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20261031 | 3,000,000.000 | 3,214,920.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20291115  | 6,450,000.000 | 7,091,968.500 |  |
| 2.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20491115 | 4,500,000.000 | 5,517,045.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20211130   | 1,500,000.000 | 1,528,650.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20261130 | 2,000,000.000 | 2,144,060.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20241130   | 3,000,000.000 | 3,159,120.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20221215 | 3,000,000.000 | 3,106,740.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20261231  | 2,500,000.000 | 2,701,950.000 |  |
| 1.75% United States Treasury<br>Note/Bond 20241231  | 2,500,000.000 | 2,662,300.000 |  |
| 1.625% United States Treasury<br>Note/Bond 20211231 | 1,500,000.000 | 1,533,105.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230115   | 4,000,000.000 | 4,132,960.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20250131 | 4,700,000.000 | 4,928,373.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20220131 | 2,500,000.000 | 2,547,925.000 |  |
| 1.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20230215 | 2,250,000.000 | 2,320,042.500 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20300215   | 3,600,000.000 | 3,875,040.000 |  |
| 1.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20270131   | 3,200,000.000 | 3,407,744.000 |  |
| 2% United States Treasury<br>Note/Bond 20500215     | 4,000,000.000 | 4,546,240.000 |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20220228 | 200,000.000   | 203,178.000   |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20270228 | 300,000.000   | 312,162.000   |  |
| 1.125% United States Treasury<br>Note/Bond 20250228 | 200,000.000   | 207,608.000   |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20230315   | 200,000.000   | 201,584.000   |  |
| 0.5% United States Treasury<br>Note/Bond 20250331   | 200,000.000   | 201,656.000   |  |
| 0.375% United States Treasury<br>Note/Bond 20220331 | 200,000.000   | 200,648.000   |  |
| 0.25% United States Treasury<br>Note/Bond 20230415  | 200,000.000   | 200,226.000   |  |

|          |  |               |  |  |
|----------|--|---------------|--|--|
|          | 0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331 | 300,000.000   | 302,130.000                                    |  |
|          | 0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 3,400,000.000 | 3,375,826.000                                  |  |
|          | 0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515 | 500,000.000   | 498,730.000                                    |  |
|          | 0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430 | 2,000,000.000 | 2,004,520.000                                  |  |
|          | 0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430 | 500,000.000   | 499,375.000                                    |  |
|          | 0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430   | 1,000,000.000 | 998,200.000                                    |  |
|          | 1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515  | 2,000,000.000 | 1,905,000.000                                  |  |
|          | アメリカ・ドル 小計                                       |               | アメリカ・ドル<br>813,593,781.120<br>(87,249,797,088) |  |
| イギリス・ポンド |  | イギリス・ポンド      | イギリス・ポンド                                       |  |
|          | 2% United Kingdom Gilt 20250907                  | 921,000.000   | 1,019,933.820                                  |  |
|          | 2.5% United Kingdom Gilt 20650722                | 1,682,000.000 | 3,040,046.800                                  |  |
|          | 1.5% United Kingdom Gilt 20260722                | 1,465,000.000 | 1,599,574.900                                  |  |
|          | 0.5% United Kingdom Gilt 20220722                | 2,320,000.000 | 2,346,517.600                                  |  |
|          | 1.5% United Kingdom Gilt 20470722                | 1,790,000.000 | 2,188,096.000                                  |  |
|          | 1.75% United Kingdom Gilt 20370907               | 2,750,000.000 | 3,303,025.000                                  |  |
|          | 1.75% United Kingdom Gilt 20570722               | 1,510,000.000 | 2,132,724.000                                  |  |
|          | 1.25% United Kingdom Gilt 20270722               | 1,510,000.000 | 1,639,482.500                                  |  |
|          | 0.75% United Kingdom Gilt 20230722               | 2,000,000.000 | 2,047,540.000                                  |  |
|          | 1.625% United Kingdom Gilt 20281022              | 2,500,000.000 | 2,822,475.000                                  |  |
|          | 1.625% United Kingdom Gilt 20711022              | 1,060,000.000 | 1,638,124.000                                  |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 1% United Kingdom Gilt<br>20240422     | 2,600,000.000 | 2,702,674.000 |  |
| 1.75% United Kingdom Gilt<br>20490122  | 930,000.000   | 1,208,442.000 |  |
| 1.625% United Kingdom Gilt<br>20541022 | 850,000.000   | 1,131,426.500 |  |
| 0.875% United Kingdom Gilt<br>20291022 | 2,100,000.000 | 2,241,057.000 |  |
| 0.625% United Kingdom Gilt<br>20250607 | 2,600,000.000 | 2,680,756.000 |  |
| 1.25% United Kingdom Gilt<br>20411022  | 90,000.000    | 101,673.000   |  |
| 0.125% United Kingdom Gilt<br>20230131 | 500,000.000   | 501,570.000   |  |
| 0.375% United Kingdom Gilt<br>20301022 | 500,000.000   | 506,850.000   |  |
| 0.5% United Kingdom Gilt<br>20611022   | 50,000.000    | 50,240.000    |  |
| 8% United Kingdom Gilt<br>20210607     | 1,102,000.000 | 1,187,812.740 |  |
| 6% United Kingdom Gilt<br>20281207     | 949,000.000   | 1,418,451.320 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20320607  | 1,340,000.000 | 1,959,482.000 |  |
| 5% United Kingdom Gilt<br>20250307     | 1,472,000.000 | 1,819,848.320 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20360307  | 1,912,000.000 | 3,008,149.600 |  |
| 4.75% United Kingdom Gilt<br>20381207  | 1,257,000.000 | 2,194,596.300 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20551207  | 1,608,000.000 | 3,529,238.400 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20461207  | 1,666,000.000 | 3,144,075.200 |  |
| 4.25% United Kingdom Gilt<br>20271207  | 1,232,000.000 | 1,617,221.760 |  |
| 4.5% United Kingdom Gilt<br>20421207   | 1,816,000.000 | 3,308,933.600 |  |
| 4.75% United Kingdom Gilt<br>20301207  | 1,830,000.000 | 2,691,747.000 |  |

|                |  |               |  |  |
|----------------|--|---------------|--|--|
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20491207            | 1,343,000.000 | 2,663,303.300                                  |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20390907            | 1,446,000.000 | 2,424,074.400                                  |  |
|                | 4% United Kingdom Gilt<br>20220307               | 1,382,000.000 | 1,478,380.680                                  |  |
|                | 4.5% United Kingdom Gilt<br>20340907             | 1,260,000.000 | 1,972,278.000                                  |  |
|                | 4% United Kingdom Gilt<br>20600122               | 1,574,000.000 | 3,546,064.600                                  |  |
|                | 4.25% United Kingdom Gilt<br>20401207            | 1,577,000.000 | 2,696,039.200                                  |  |
|                | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20210907            | 803,000.000   | 839,689.070                                    |  |
|                | 3.75% United Kingdom Gilt<br>20520722            | 1,552,000.000 | 3,001,102.400                                  |  |
|                | 1.75% United Kingdom Gilt<br>20220907            | 2,242,000.000 | 2,331,186.760                                  |  |
|                | 3.25% United Kingdom Gilt<br>20440122            | 2,166,000.000 | 3,415,782.000                                  |  |
|                | 2.25% United Kingdom Gilt<br>20230907            | 1,582,000.000 | 1,697,897.320                                  |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20680722             | 1,586,000.000 | 3,630,036.800                                  |  |
|                | 2.75% United Kingdom Gilt<br>20240907            | 1,092,000.000 | 1,220,255.400                                  |  |
|                | 3.5% United Kingdom Gilt<br>20450122             | 2,274,000.000 | 3,767,563.200                                  |  |
|                | イギリス・ポンド 小計                                      |               | イギリス・ポンド<br>95,465,437.490<br>(12,805,733,784) |  |
| イスラエル・<br>シュケル |  | イスラエル・シュケル    | イスラエル・シュケル                                     |  |
|                | 6.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20261030 | 1,500,000.000 | 2,043,720.000                                  |  |
|                | 5.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20220131  | 2,000,000.000 | 2,177,100.000                                  |  |
|                | 4.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20230331 | 1,800,000.000 | 2,004,948.000                                  |  |
|                | 5.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20420131  | 1,900,000.000 | 3,320,440.000                                  |  |

|            |  |               |   |  |
|------------|--|---------------|---|--|
|            | 3.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20240331 | 1,500,000.000 | 1,698,885.000                                 |  |
|            | 1.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20250831 | 1,900,000.000 | 2,034,311.000                                 |  |
|            | 2% Israel Government Bond -<br>Fixed 20270331    | 1,800,000.000 | 1,977,012.000                                 |  |
|            | 1.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20221130 | 1,000,000.000 | 1,028,060.000                                 |  |
|            | 3.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20470331 | 1,500,000.000 | 2,155,185.000                                 |  |
|            | 2.25% Israel Government Bond<br>- Fixed 20280928 | 1,500,000.000 | 1,694,670.000                                 |  |
|            | 1.5% Israel Government Bond -<br>Fixed 20231130  | 1,500,000.000 | 1,566,540.000                                 |  |
|            | 0.75% Israel Government Bond<br>- Fixed 20220731 | 1,000,000.000 | 1,013,790.000                                 |  |
|            | 1% Israel Government Bond -<br>Fixed 20300331    | 800,000.000   | 819,632.000                                   |  |
|            | イスラエル・シュケル 小計                                    |               | イスラエル・シュケル<br>23,534,293.000<br>(726,032,938) |  |
| オーストラリア・ドル |  | オーストラリア・ドル    | オーストラリア・ドル                                    |  |
|            | 5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220715     | 2,162,000.000 | 2,407,581.580                                 |  |
|            | 5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230421      | 3,568,000.000 | 4,099,275.200                                 |  |
|            | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270421     | 2,789,000.000 | 3,564,063.100                                 |  |
|            | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240421     | 2,473,000.000 | 2,704,645.910                                 |  |
|            | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290421     | 2,504,000.000 | 3,019,172.960                                 |  |
|            | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250421     | 2,498,000.000 | 2,843,298.540                                 |  |
|            | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330421      | 1,258,000.000 | 1,781,541.860                                 |  |
|            | 4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260421     | 2,948,000.000 | 3,590,133.360                                 |  |

|  |               |   |  |
|--|---------------|---|--|
| 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20370421           | 1,113,000.000 | 1,507,302.510                                   |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20350621           | 1,007,000.000 | 1,215,177.110                                   |  |
| 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20390621           | 792,000.000   | 1,015,439.040                                   |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20271121           | 2,672,000.000 | 3,071,757.920                                   |  |
| 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20280521           | 2,678,000.000 | 2,986,880.520                                   |  |
| 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20470321              | 1,152,000.000 | 1,462,625.280                                   |  |
| 2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20211221              | 800,000.000   | 820,896.000                                     |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20281121           | 2,300,000.000 | 2,665,424.000                                   |  |
| 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20221121           | 1,550,000.000 | 1,625,051.000                                   |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20291121           | 2,600,000.000 | 3,039,998.000                                   |  |
| 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300521            | 2,470,000.000 | 2,842,377.200                                   |  |
| 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20410521           | 990,000.000   | 1,186,158.600                                   |  |
| 1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20310621            | 2,840,000.000 | 2,995,149.200                                   |  |
| 1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20320521           | 500,000.000   | 513,270.000                                     |  |
| 0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT<br>BOND 20241121           | 2,400,000.000 | 2,388,840.000                                   |  |
| 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND<br>20301221              | 2,200,000.000 | 2,208,932.000                                   |  |
| オーストラリア・ドル 小計  |               | オーストラリア・ドル<br>55,554,990.890<br>(4,058,847,635) |  |
| カナダ・ドル   | カナダ・ドル        | カナダ・ドル  |  |
| 2.75% Canada Government<br>International Bond 20641201 | 405,000.000   | 648,611.550                                     |  |
| 8% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601                | 586,000.000   | 889,665.200                                     |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290601 | 983,000.000   | 1,435,907.420 |  |
| 5.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20330601 | 1,117,000.000 | 1,814,465.970 |  |
| 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20370601    | 1,012,000.000 | 1,667,603.960 |  |
| 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20410601    | 1,363,000.000 | 2,139,051.310 |  |
| 3.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210601 | 956,000.000   | 984,670.440   |  |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220601 | 1,751,000.000 | 1,836,904.060 |  |
| 3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20451201  | 1,461,000.000 | 2,260,955.940 |  |
| 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20230601  | 1,253,000.000 | 1,298,922.450 |  |
| 2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240601  | 1,405,000.000 | 1,526,532.500 |  |
| 2.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20481201 | 1,337,000.000 | 1,894,248.230 |  |
| 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250601 | 1,156,000.000 | 1,264,190.040 |  |
| 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20260601  | 969,000.000   | 1,033,680.750 |  |
| 0.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20210901 | 2,480,000.000 | 2,497,285.600 |  |
| 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601    | 1,240,000.000 | 1,289,662.000 |  |
| 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220301  | 1,440,000.000 | 1,446,840.000 |  |
| 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220901    | 1,750,000.000 | 1,778,962.500 |  |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20280601    | 1,200,000.000 | 1,345,152.000 |  |
| 1.75% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20230301 | 2,100,000.000 | 2,184,777.000 |  |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20230901    | 1,000,000.000 | 1,055,330.000 |  |
| 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20511201    | 1,390,000.000 | 1,739,557.200 |  |

|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290601 | 1,220,000.000 | 1,408,929.200                               |  |
|               | 2.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20240301 | 1,200,000.000 | 1,286,736.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20240901  | 1,400,000.000 | 1,469,524.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20210801  | 400,000.000   | 406,024.000                                 |  |
|               | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300601 | 1,350,000.000 | 1,444,270.500                               |  |
|               | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20211101 | 800,000.000   | 811,672.000                                 |  |
|               | 1.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250301 | 1,600,000.000 | 1,668,560.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220201  | 1,100,000.000 | 1,122,957.000                               |  |
|               | 1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20220501  | 5,000.000     | 5,118.350                                   |  |
|               | 0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND<br>20250901  | 1,500,000.000 | 1,511,835.000                               |  |
|               | 0.25% CANADIAN GOVERNMENT<br>BOND 20220801 | 1,500,000.000 | 1,499,355.000                               |  |
|               | カナダ・ドル 小計                                  |               | カナダ・ドル<br>46,667,957.170<br>(3,670,901,511) |  |
| シンガポール・<br>ドル |  | シンガポール・ドル     | シンガポール・ドル                                   |  |
|               | 3.5% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20270301      | 772,000.000   | 911,732.000                                 |  |
|               | 3.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20220901    | 438,000.000   | 465,024.600                                 |  |
|               | 3% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20240901        | 623,000.000   | 688,589.440                                 |  |
|               | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20300901    | 359,000.000   | 424,158.500                                 |  |
|               | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20210601     | 495,000.000   | 504,345.600                                 |  |
|               | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20420401     | 400,000.000   | 508,000.000                                 |  |
|               | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20230701     | 671,000.000   | 719,110.700                                 |  |

|                 |  |               |  |  |
|-----------------|--|---------------|--|--|
|                 | 3.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20330901  | 568,000.000   | 725,052.000                                  |  |
|                 | 2.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20290701  | 625,000.000   | 729,618.750                                  |  |
|                 | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20250601  | 524,000.000   | 571,317.200                                  |  |
|                 | 2.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20460301   | 688,000.000   | 892,336.000                                  |  |
|                 | 2.125% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20260601  | 250,000.000   | 271,550.000                                  |  |
|                 | 1.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20211001   | 460,000.000   | 465,740.800                                  |  |
|                 | 1.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20220401   | 500,000.000   | 513,060.000                                  |  |
|                 | 2.25% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20360801   | 500,000.000   | 573,615.000                                  |  |
|                 | 1.75% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20230201   | 450,000.000   | 466,425.000                                  |  |
|                 | 2.625% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20280501  | 550,000.000   | 624,965.000                                  |  |
|                 | 2% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20240201      | 490,000.000   | 518,077.000                                  |  |
|                 | 2.375% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20390701  | 150,000.000   | 177,541.500                                  |  |
|                 | 1.875% SINGAPORE GOVERNMENT<br>20500301  | 200,000.000   | 226,022.000                                  |  |
|                 | シンガポール・ドル 小計                             |               | シンガポール・ドル<br>10,976,281.090<br>(843,636,964) |  |
| スウェーデン・<br>クローナ |  | スウェーデン・クローナ   | スウェーデン・クローナ                                  |  |
|                 | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20390330 | 4,255,000.000 | 6,598,398.700                                |  |
|                 | 3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20220601 | 8,465,000.000 | 9,098,605.250                                |  |
|                 | 1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20231113 | 8,025,000.000 | 8,519,982.000                                |  |
|                 | 2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20250512 | 5,595,000.000 | 6,358,269.900                                |  |
|                 | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20261112   | 5,680,000.000 | 6,109,692.000                                |  |

|                |   |                |  |            |
|----------------|---|----------------|--|------------|
|                | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20280512   | 4,550,000.000  | 4,853,985.500                                  |            |
|                | 0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND<br>20291112   | 4,700,000.000  | 5,039,199.000                                  |            |
| スウェーデン・クローナ 小計 |   |                | スウェーデン・クローナ<br>46,578,132.350<br>(534,716,960) |            |
| デンマーク・クローネ     | 4.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20391115     | 12,662,000.000 | 23,752,645.800                                 | デンマーク・クローネ |
|                | 3% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20211115       | 7,550,000.000  | 7,931,803.500                                  |            |
|                | 1.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20231115     | 4,846,000.000  | 5,189,969.080                                  |            |
|                | 1.75% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20251115    | 6,013,000.000  | 6,754,042.120                                  |            |
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20271115     | 7,900,000.000  | 8,424,086.000                                  |            |
|                | 0.5% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20291115     | 7,590,000.000  | 8,160,768.000                                  |            |
|                | 0.25% DANISH GOVERNMENT BOND<br>20221115    | 800,000.000    | 815,624.000                                    |            |
| デンマーク・クローネ 小計  |   |                | デンマーク・クローネ<br>61,028,938.500<br>(988,058,514)  |            |
| ノルウェー・クローネ     | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20230524    | 8,204,000.000  | 8,633,643.480                                  | ノルウェー・クローネ |
|                | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20240314    | 4,095,000.000  | 4,516,989.750                                  |            |
|                | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20250313 | 3,395,000.000  | 3,628,440.200                                  |            |
|                | 1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20260219  | 3,340,000.000  | 3,556,699.200                                  |            |
|                | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20270217 | 3,450,000.000  | 3,756,084.000                                  |            |
|                | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND<br>20280426    | 3,500,000.000  | 3,911,250.000                                  |            |

|               |  |               |   |  |
|---------------|--|---------------|---|--|
|               | 1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20290906  | 3,250,000.000 | 3,606,980.000                                 |  |
|               | 1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT<br>BOND 20300819 | 4,000,000.000 | 4,313,960.000                                 |  |
| ノルウェー・クローネ 小計 |  |               | ノルウェー・クローネ<br>35,924,046.630<br>(397,679,196) |  |
| ポーランド・ズ<br>ロチ |  | ポーランド・ズロチ     | ポーランド・ズロチ                                     |  |
|               | 5.75% Poland Government Bond<br>20220923     | 2,309,000.000 | 2,594,738.750                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20260725      | 4,377,000.000 | 4,771,542.780                                 |  |
|               | 1.75% Poland Government Bond<br>20210725     | 3,051,000.000 | 3,106,314.630                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20270725      | 3,170,000.000 | 3,467,694.700                                 |  |
|               | 2.25% Poland Government Bond<br>20220425     | 2,320,000.000 | 2,406,976.800                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20230125      | 2,850,000.000 | 3,007,833.000                                 |  |
|               | 2.5% Poland Government Bond<br>20240425      | 2,870,000.000 | 3,079,596.100                                 |  |
|               | 2.75% Poland Government Bond<br>20291025     | 3,340,000.000 | 3,785,856.600                                 |  |
|               | 2.25% Poland Government Bond<br>20241025     | 2,400,000.000 | 2,560,824.000                                 |  |
|               | Poland Government Bond<br>20220725           | 1,500,000.000 | 1,491,510.000                                 |  |
|               | 5.75% Poland Government Bond<br>20290425     | 827,000.000   | 1,139,812.750                                 |  |
|               | 5.75% Poland Government Bond<br>20211025     | 1,684,000.000 | 1,812,691.280                                 |  |
|               | 4% Poland Government Bond<br>20231025        | 2,625,000.000 | 2,933,411.250                                 |  |
|               | 2.75% Poland Government Bond<br>20280425     | 2,750,000.000 | 3,066,937.500                                 |  |
|               | 3.25% Poland Government Bond<br>20250725     | 2,591,000.000 | 2,905,884.230                                 |  |
| ポーランド・ズロチ 小計  |  |               | ポーランド・ズロチ<br>42,131,624.370                   |  |

|             |   |               | (1,142,188,337) |
|-------------|---|---------------|-----------------|
| マレーシア・リンギット |   | マレーシア・リンギット   | マレーシア・リンギット     |
|             | 3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270531 | 1,273,000.000 | 1,332,410.910   |
|             | 5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280915 | 738,000.000   | 857,511.720     |
|             | 4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20300415 | 1,178,000.000 | 1,321,892.700   |
|             | 4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20210715  | 916,000.000   | 936,518.400     |
|             | 4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260415 | 1,514,000.000 | 1,649,139.640   |
|             | 4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20310630 | 1,300,000.000 | 1,428,999.000   |
|             | 3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20220815 | 875,000.000   | 896,840.000     |
|             | 3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20270315 | 731,000.000   | 779,633.430     |
|             | 4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20320415 | 618,000.000   | 671,864.880     |
|             | 3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230315  | 1,001,000.000 | 1,030,919.890   |
|             | 3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20330415 | 1,427,000.000 | 1,503,430.120   |
|             | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280615 | 1,186,000.000 | 1,247,292.480   |
|             | 4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20430930 | 600,000.000   | 702,504.000     |
|             | 4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240715 | 1,057,000.000 | 1,122,111.200   |
|             | 4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20210930 | 857,000.000   | 878,322.160     |
|             | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250915 | 1,737,000.000 | 1,857,460.950   |
|             | 3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20220930 | 1,161,000.000 | 1,200,775.860   |
|             | 4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20350531 | 1,220,000.000 | 1,335,412.000   |
|             | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230817   | 1,302,000.000 | 1,355,668.440   |

|   |                |  |  |
|---|----------------|--|--|
| 4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20460315 | 930,000.000    | 1,031,360.700                                  |  |
| 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20261130   | 650,000.000    | 695,123.000                                    |  |
| 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20211130  | 352,000.000    | 359,568.000                                    |  |
| 3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20220310 | 1,600,000.000  | 1,646,656.000                                  |  |
| 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240930 | 750,000.000    | 796,612.500                                    |  |
| 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20271116 | 890,000.000    | 951,374.400                                    |  |
| 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20370407 | 1,050,000.000  | 1,215,732.000                                  |  |
| 3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250314 | 1,200,000.000  | 1,266,288.000                                  |  |
| 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230420 | 800,000.000    | 830,616.000                                    |  |
| 4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20331107 | 700,000.000    | 794,493.000                                    |  |
| 4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20380608 | 600,000.000    | 703,770.000                                    |  |
| 3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260715 | 650,000.000    | 691,944.500                                    |  |
| 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20290815 | 1,910,000.000  | 2,057,241.900                                  |  |
| 4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20480706 | 1,000,000.000  | 1,140,640.000                                  |  |
| 3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240614 | 400,000.000    | 413,748.000                                    |  |
| 3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20340705 | 800,000.000    | 837,528.000                                    |  |
| 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20400522 | 1,000,000.000  | 1,020,020.000                                  |  |
| マレーシア・リングット 小計                          |                | マレーシア・リングット<br>38,561,423.780<br>(965,963,665) |  |
| メキシコ・ペソ                                 | メキシコ・ペソ        | メキシコ・ペソ  |  |
| 5.75% Mexican Bonos 20260305            | 20,290,000.000 | 20,577,306.400                                 |  |
| 8% Mexican Bonos 20471107               | 16,300,000.000 | 17,880,937.000                                 |  |
| 7.25% Mexican Bonos 20211209            | 19,000,000.000 | 19,638,210.000                                 |  |

|     |  |                |   |  |
|-----|--|----------------|---|--|
|     | 8% Mexican Bonos 20240905                  | 16,300,000.000 | 18,078,982.000                                |  |
|     | 6.75% Mexican Bonos 20230309               | 5,000,000.000  | 5,230,700.000                                 |  |
|     | 8% Mexican Bonos 20231207                  | 25,033,000.000 | 27,373,084.840                                |  |
|     | 10% Mexican Bonos 20241205                 | 23,919,000.000 | 28,491,116.850                                |  |
|     | 7.5% Mexican Bonos 20270603                | 26,468,000.000 | 29,143,650.120                                |  |
|     | 10% Mexican Bonos 20361120                 | 8,874,000.000  | 11,764,882.980                                |  |
|     | 8.5% Mexican Bonos 20290531                | 25,044,000.000 | 29,343,053.040                                |  |
|     | 8.5% Mexican Bonos 20381118                | 14,894,000.000 | 17,284,784.880                                |  |
|     | 6.5% Mexican Bonos 20210610                | 16,326,000.000 | 16,561,584.180                                |  |
|     | 7.75% Mexican Bonos 20310529               | 13,015,000.000 | 14,560,401.100                                |  |
|     | 6.5% Mexican Bonos 20220609                | 24,599,000.000 | 25,346,071.630                                |  |
|     | 7.75% Mexican Bonos 20421113               | 16,654,000.000 | 17,780,643.100                                |  |
|     | 7.75% Mexican Bonos 20341123               | 7,944,000.000  | 8,923,177.440                                 |  |
|     | メキシコ・ペソ 小計                                 |                | メキシコ・ペソ<br>307,978,585.560<br>(1,465,978,067) |  |
| ユーロ |  | ユーロ            | ユーロ   |  |
|     | 0.75% Finland Government Bond<br>20310415  | 414,000.000    | 453,433.500                                   |  |
|     | 0.875% Finland Government<br>Bond 20250915 | 279,000.000    | 298,979.190                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20260415   | 1,111,000.000  | 1,172,149.440                                 |  |
|     | Finland Government Bond<br>20230915        | 200,000.000    | 203,662.000                                   |  |
|     | 1.375% Finland Government<br>Bond 20470415 | 360,000.000    | 461,714.400                                   |  |
|     | Finland Government Bond<br>20220415        | 770,000.000    | 778,085.000                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20270915   | 800,000.000    | 848,568.000                                   |  |
|     | 1.125% Finland Government<br>Bond 20340415 | 370,000.000    | 424,704.500                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20280915   | 500,000.000    | 531,975.000                                   |  |
|     | 0.5% Finland Government Bond<br>20290915   | 500,000.000    | 532,655.000                                   |  |
|     | Finland Government Bond<br>20240915        | 200,000.000    | 204,518.000                                   |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 0.125% Finland Government<br>Bond 20360415 | 310,000.000   | 310,213.900   |  |
| 1.2% Austria Government Bond<br>20251020   | 873,000.000   | 952,512.840   |  |
| 0.75% Austria Government Bond<br>20261020  | 1,126,000.000 | 1,209,718.100 |  |
| 1.5% Austria Government Bond<br>20470220   | 634,000.000   | 819,108.980   |  |
| 1.5% Austria Government Bond<br>20861102   | 240,000.000   | 346,677.600   |  |
| Austria Government Bond<br>20230715        | 900,000.000   | 915,849.000   |  |
| 0.5% Austria Government Bond<br>20270420   | 780,000.000   | 826,815.600   |  |
| 2.1% Austria Government Bond<br>21170920   | 490,000.000   | 921,528.300   |  |
| Austria Government Bond<br>20220920        | 400,000.000   | 405,404.000   |  |
| 0.75% Austria Government Bond<br>20280220  | 900,000.000   | 973,404.000   |  |
| 0.5% Austria Government Bond<br>20290220   | 980,000.000   | 1,042,651.400 |  |
| Austria Government Bond<br>20240715        | 800,000.000   | 817,808.000   |  |
| Austria Government Bond<br>20300220        | 680,000.000   | 690,546.800   |  |
| Austria Government Bond<br>20230420        | 1,000,000.000 | 1,016,400.000 |  |
| 0.75% Austria Government Bond<br>20510320  | 700,000.000   | 768,768.000   |  |
| 0.8% Belgium Government Bond<br>20250622   | 1,399,000.000 | 1,486,675.330 |  |
| 1% Belgium Government Bond<br>20310622     | 1,074,000.000 | 1,189,830.900 |  |
| 1.9% Belgium Government Bond<br>20380622   | 758,000.000   | 954,337.160   |  |
| 1% Belgium Government Bond<br>20260622     | 1,283,000.000 | 1,387,821.100 |  |
| 1.6% Belgium Government Bond<br>20470622   | 1,244,000.000 | 1,534,884.520 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.15% Belgium Government Bond<br>20660622 | 640,000.000   | 980,249.600   |  |
| 0.2% Belgium Government Bond<br>20231022  | 490,000.000   | 502,455.800   |  |
| 0.8% Belgium Government Bond<br>20270622  | 1,400,000.000 | 1,505,392.000 |  |
| 0.5% Belgium Government Bond<br>20241022  | 1,050,000.000 | 1,095,580.500 |  |
| 2.25% Belgium Government Bond<br>20570622 | 460,000.000   | 685,975.000   |  |
| 1.45% Belgium Government Bond<br>20370622 | 400,000.000   | 471,308.000   |  |
| 0.8% Belgium Government Bond<br>20280622  | 1,340,000.000 | 1,448,298.800 |  |
| 1.25% Belgium Government Bond<br>20330422 | 550,000.000   | 629,799.500   |  |
| 0.9% Belgium Government Bond<br>20290622  | 1,200,000.000 | 1,311,132.000 |  |
| 1.7% Belgium Government Bond<br>20500622  | 600,000.000   | 763,470.000   |  |
| 0.1% Belgium Government Bond<br>20300622  | 1,220,000.000 | 1,238,617.200 |  |
| 0.4% Belgium Government Bond<br>20400622  | 660,000.000   | 646,423.800   |  |
| Belgium Government Bond<br>20271022       | 1,200,000.000 | 1,219,644.000 |  |
| 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240104  | 974,000.000   | 1,216,720.800 |  |
| 6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270704   | 1,167,000.000 | 1,761,353.100 |  |
| 5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280104 | 1,362,000.000 | 2,009,930.640 |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280704  | 950,000.000   | 1,363,022.000 |  |
| 6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20300104  | 951,000.000   | 1,575,493.170 |  |
| 5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20310104   | 3,448,000.000 | 5,645,238.000 |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20340704  | 1,405,000.000 | 2,426,013.500 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 4% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20370104    | 3,571,000.000 | 6,106,909.940 |  |
| 4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20390704 | 1,325,000.000 | 2,456,245.250 |  |
| 4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20400704 | 1,439,000.000 | 2,875,812.720 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20420704 | 2,874,000.000 | 5,028,235.440 |  |
| 3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210704 | 1,674,000.000 | 1,742,466.600 |  |
| 2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210904 | 1,415,000.000 | 1,465,034.400 |  |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220104    | 1,807,000.000 | 1,883,616.800 |  |
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220704 | 2,222,000.000 | 2,333,722.160 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20440704  | 2,508,000.000 | 4,067,900.760 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220904  | 1,644,000.000 | 1,724,687.520 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230215  | 1,410,000.000 | 1,494,402.600 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230515  | 1,817,000.000 | 1,935,413.890 |  |
| 2% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230815    | 1,599,000.000 | 1,737,537.360 |  |
| 1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240215 | 1,561,000.000 | 1,702,754.410 |  |
| 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20460815  | 2,679,000.000 | 4,452,899.850 |  |
| 1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240515  | 1,594,000.000 | 1,732,662.060 |  |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240815    | 1,542,000.000 | 1,651,867.500 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20250215  | 2,194,000.000 | 2,316,820.120 |  |
| 1% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20250815    | 2,134,000.000 | 2,321,429.220 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20260215  | 2,368,000.000 | 2,526,016.640 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20260815       | 2,420,000.000 | 2,516,993.600 |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270215 | 6,200,000.000 | 6,566,544.000 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20270815  | 2,300,000.000 | 2,484,299.000 |  |
| 1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20480815 | 1,750,000.000 | 2,359,560.000 |  |
| 0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280215  | 1,900,000.000 | 2,059,980.000 |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20280815 | 4,400,000.000 | 4,691,544.000 |  |
| 0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20290215 | 2,200,000.000 | 2,348,896.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20290815       | 1,900,000.000 | 1,985,215.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20500815       | 1,050,000.000 | 1,039,290.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20300215       | 1,050,000.000 | 1,096,294.500 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20350515       | 700,000.000   | 722,722.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20271115       | 500,000.000   | 521,045.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210611       | 100,000.000   | 100,647.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20210910       | 500,000.000   | 504,055.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20211210       | 800,000.000   | 808,024.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220311       | 300,000.000   | 303,483.000   |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20211008       | 1,400,000.000 | 1,411,816.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20220408       | 1,160,000.000 | 1,174,221.600 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20221007       | 2,100,000.000 | 2,133,747.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20230414       | 5,730,000.000 | 5,845,516.800 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20231013       | 1,900,000.000 | 1,945,410.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20240405       | 1,920,000.000 | 1,970,937.600 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20241018       | 1,700,000.000 | 1,750,473.000 |  |
| GERMAN GOVERNMENT BOND<br>20250411       | 2,400,000.000 | 2,478,240.000 |  |
| 8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230425  | 1,985,000.000 | 2,503,879.000 |  |
| 6% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20251025    | 3,025,000.000 | 4,082,933.250 |  |
| 5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20290425  | 3,323,000.000 | 5,013,277.180 |  |
| 5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20321025 | 2,927,000.000 | 4,991,969.230 |  |
| 4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20350425 | 2,659,000.000 | 4,442,151.990 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20550425    | 1,514,000.000 | 3,069,256.500 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20381025    | 2,374,000.000 | 3,926,311.120 |  |
| 4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20231025 | 4,097,000.000 | 4,771,161.350 |  |
| 4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20410425  | 3,764,000.000 | 6,825,298.840 |  |
| 4% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20600425    | 1,287,000.000 | 2,746,702.530 |  |
| 3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260425  | 3,146,000.000 | 3,874,959.660 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20211025 | 4,150,000.000 | 4,365,800.000 |  |
| 3% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220425    | 3,630,000.000 | 3,873,318.900 |  |
| 2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20271025 | 3,699,000.000 | 4,539,708.720 |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20221025 | 2,694,000.000 | 2,876,222.160 |  |
| 3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20450525 | 2,588,000.000 | 4,216,964.840 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230525 | 3,347,000.000 | 3,577,943.000 |  |
| 2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20240525 | 3,086,000.000 | 3,430,366.740 |  |
| 2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20300525  | 4,387,000.000 | 5,525,382.630 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20241125 | 3,899,000.000 | 4,297,204.870 |  |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20250525  | 3,492,000.000 | 3,665,063.520 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20251125    | 3,101,000.000 | 3,345,979.000 |  |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20310525  | 4,420,000.000 | 5,160,217.400 |  |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260525  | 3,287,000.000 | 3,464,235.040 |  |
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20360525 | 2,969,000.000 | 3,422,752.270 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20660525 | 1,087,000.000 | 1,517,386.780 |  |
| 0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20261125 | 2,800,000.000 | 2,908,752.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220525       | 4,000,000.000 | 4,046,840.000 |  |
| 1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20390625 | 2,170,000.000 | 2,720,702.600 |  |
| 1% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20270525    | 3,400,000.000 | 3,711,032.000 |  |
| 2% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20480525    | 2,300,000.000 | 3,118,731.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230325       | 2,400,000.000 | 2,438,232.000 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20280525 | 3,400,000.000 | 3,669,858.000 |  |
| 1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20340525 | 3,950,000.000 | 4,540,248.500 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20281125 | 3,150,000.000 | 3,405,055.500 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20240325       | 3,400,000.000 | 3,470,822.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20220225            | 1,400,000.000 | 1,413,608.000 |  |
| 1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20500525       | 2,500,000.000 | 3,083,000.000 |  |
| 0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20290525       | 5,250,000.000 | 5,563,215.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20250325            | 3,130,000.000 | 3,202,209.100 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20291125            | 2,300,000.000 | 2,324,081.000 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20230225            | 2,400,000.000 | 2,436,288.000 |  |
| 0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20520525      | 1,370,000.000 | 1,396,345.100 |  |
| FRENCH GOVERNMENT BOND<br>20260225            | 3,000,000.000 | 3,067,200.000 |  |
| 7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230115  | 548,000.000   | 664,559.600   |  |
| 5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20280115  | 1,139,000.000 | 1,656,834.960 |  |
| 4% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20370115    | 1,485,000.000 | 2,493,255.600 |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230115 | 791,000.000   | 881,640.690   |  |
| 3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20420115 | 1,779,000.000 | 3,212,251.350 |  |
| 3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20210715 | 1,463,000.000 | 1,524,153.400 |  |
| 2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20220715 | 1,438,000.000 | 1,525,142.800 |  |
| 2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20330115  | 1,168,000.000 | 1,565,376.960 |  |
| 1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20230715 | 1,385,000.000 | 1,487,254.550 |  |
| 2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20470115 | 1,579,000.000 | 2,693,379.250 |  |
| 2% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20240715    | 1,514,000.000 | 1,676,739.860 |  |
| 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT<br>BOND 20250715 | 1,291,000.000 | 1,344,460.310 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715  | 1,638,000.000 | 1,738,065.420 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115       | 1,200,000.000 | 1,211,508.000 |  |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715 | 1,200,000.000 | 1,302,048.000 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115       | 1,400,000.000 | 1,430,954.000 |  |
| 0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715 | 1,150,000.000 | 1,256,697.000 |  |
| 0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715 | 1,200,000.000 | 1,262,232.000 |  |
| 0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115  | 600,000.000   | 657,540.000   |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715       | 1,100,000.000 | 1,127,401.000 |  |
| 9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101        | 1,106,000.000 | 1,421,862.540 |  |
| 7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101     | 1,110,000.000 | 1,534,430.700 |  |
| 6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101      | 2,392,000.000 | 3,278,618.720 |  |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201      | 1,814,000.000 | 1,953,496.600 |  |
| 3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901     | 1,509,000.000 | 1,776,379.710 |  |
| 1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415     | 1,629,000.000 | 1,663,290.450 |  |
| 1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601      | 1,687,000.000 | 1,743,312.060 |  |
| 1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301     | 1,765,000.000 | 1,778,255.150 |  |
| 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201        | 1,891,000.000 | 2,002,398.810 |  |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915     | 1,504,000.000 | 1,544,577.920 |  |
| 2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301      | 1,610,000.000 | 1,733,760.700 |  |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315     | 1,359,000.000 | 1,382,062.230 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20260601  | 1,786,000.000 | 1,851,439.040 |  |
| 0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20210601 | 1,674,000.000 | 1,681,181.460 |  |
| 2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20360901 | 1,324,000.000 | 1,386,969.440 |  |
| 1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20261201 | 1,068,000.000 | 1,082,161.680 |  |
| 0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20231015 | 1,550,000.000 | 1,561,067.000 |  |
| 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20211101 | 1,358,000.000 | 1,363,445.580 |  |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20670301  | 968,000.000   | 1,034,472.560 |  |
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20330901 | 1,500,000.000 | 1,625,280.000 |  |
| 2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20270601  | 1,510,000.000 | 1,617,965.000 |  |
| 1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20240515 | 1,300,000.000 | 1,362,140.000 |  |
| 1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220401  | 1,250,000.000 | 1,272,650.000 |  |
| 3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20480301 | 1,850,000.000 | 2,255,501.500 |  |
| 2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20270801 | 1,700,000.000 | 1,803,751.000 |  |
| 0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220801  | 1,700,000.000 | 1,724,854.000 |  |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20241115 | 1,600,000.000 | 1,651,744.000 |  |
| 2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20380901 | 1,300,000.000 | 1,474,005.000 |  |
| 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20280201    | 2,100,000.000 | 2,220,939.000 |  |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20230301 | 1,900,000.000 | 1,932,129.000 |  |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20250515 | 1,300,000.000 | 1,339,806.000 |  |
| 2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20281201  | 1,550,000.000 | 1,737,627.500 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20231001           | 1,400,000.000 | 1,491,140.000 |  |
| 2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20251115            | 1,550,000.000 | 1,680,417.000 |  |
| 2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20211015            | 1,200,000.000 | 1,235,676.000 |  |
| 3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20350301           | 1,270,000.000 | 1,510,499.900 |  |
| 3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20490901           | 1,250,000.000 | 1,629,950.000 |  |
| 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20220715              | 1,550,000.000 | 1,575,404.500 |  |
| 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20290801              | 1,900,000.000 | 2,169,420.000 |  |
| 1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20240701           | 2,200,000.000 | 2,296,668.000 |  |
| 2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20260715            | 1,600,000.000 | 1,702,368.000 |  |
| 3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20400301            | 850,000.000   | 981,189.000   |  |
| 1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20300401           | 1,900,000.000 | 1,890,367.000 |  |
| 0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20230115           | 740,000.000   | 735,441.600   |  |
| 0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20250201           | 1,100,000.000 | 1,080,717.000 |  |
| 0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20270115           | 2,350,000.000 | 2,316,066.000 |  |
| 2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20500901           | 1,200,000.000 | 1,216,308.000 |  |
| 1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20360301           | 1,500,000.000 | 1,416,810.000 |  |
| 0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20230615            | 2,000,000.000 | 2,012,740.000 |  |
| 1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20250701           | 2,300,000.000 | 2,411,090.000 |  |
| 0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND<br>20300801           | 1,500,000.000 | 1,432,725.000 |  |
| 5.25% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20291101 | 2,754,000.000 | 3,687,137.820 |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501    | 2,849,000.000 | 4,107,118.400 |  |
| 5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201 | 1,805,000.000 | 2,628,783.950 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801    | 2,298,000.000 | 3,194,587.680 |  |
| 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201    | 2,740,000.000 | 3,505,884.800 |  |
| 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210801 | 2,734,000.000 | 2,848,609.280 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801    | 2,044,000.000 | 2,971,996.440 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801 | 2,251,000.000 | 2,553,691.970 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301    | 2,118,000.000 | 2,530,861.740 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901    | 2,043,000.000 | 2,976,528.420 |  |
| 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301  | 2,070,000.000 | 2,476,692.900 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901 | 2,281,000.000 | 2,410,925.760 |  |
| 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301    | 2,012,000.000 | 2,178,734.440 |  |
| 5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901  | 1,657,000.000 | 1,849,659.390 |  |
| 5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101  | 1,960,000.000 | 2,201,236.800 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901 | 2,410,000.000 | 3,061,832.700 |  |
| 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501  | 1,894,000.000 | 2,117,870.800 |  |
| 4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901 | 1,613,000.000 | 2,339,075.820 |  |
| 4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301  | 2,194,000.000 | 2,508,180.800 |  |
| 3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901 | 2,201,000.000 | 2,478,502.080 |  |
| 3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301  | 2,838,000.000 | 3,370,153.380 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 2.15% Italy Buoni Poliennali<br>Del Tesoro 20211215 | 1,593,000.000 | 1,642,574.160 |  |
| 5.5% Belgium Government Bond<br>20280328            | 1,706,000.000 | 2,472,198.720 |  |
| 5% Belgium Government Bond<br>20350328              | 2,104,000.000 | 3,557,821.920 |  |
| 4% Belgium Government Bond<br>20220328              | 877,000.000   | 949,177.100   |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20410328           | 1,604,000.000 | 2,774,615.240 |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20210928           | 1,446,000.000 | 1,535,521.860 |  |
| 4.5% Belgium Government Bond<br>20260328            | 1,001,000.000 | 1,286,164.880 |  |
| 4.25% Belgium Government Bond<br>20220928           | 1,316,000.000 | 1,462,799.800 |  |
| 4% Belgium Government Bond<br>20320328              | 780,000.000   | 1,140,094.800 |  |
| 2.25% Belgium Government Bond<br>20230622           | 1,338,000.000 | 1,452,907.440 |  |
| 3.75% Belgium Government Bond<br>20450622           | 843,000.000   | 1,458,052.800 |  |
| 2.6% Belgium Government Bond<br>20240622            | 1,505,000.000 | 1,695,397.550 |  |
| 3% Belgium Government Bond<br>20340622              | 747,000.000   | 1,036,880.820 |  |
| 5.4% IRISH TREASURY 20250313                        | 1,031,000.000 | 1,313,514.620 |  |
| 3.9% IRISH TREASURY 20230320                        | 624,000.000   | 699,316.800   |  |
| 3.4% IRISH TREASURY 20240318                        | 607,000.000   | 694,316.950   |  |
| 2.4% IRISH TREASURY 20300515                        | 961,000.000   | 1,181,155.490 |  |
| 0.8% IRISH TREASURY 20220315                        | 516,000.000   | 527,785.440   |  |
| 2% IRISH TREASURY 20450218                          | 781,000.000   | 1,034,387.640 |  |
| 1% IRISH TREASURY 20260515                          | 1,073,000.000 | 1,151,650.900 |  |
| 1.7% IRISH TREASURY 20370515                        | 550,000.000   | 663,646.500   |  |
| IRISH TREASURY 20221018                             | 350,000.000   | 353,944.500   |  |
| 0.9% IRISH TREASURY 20280515                        | 800,000.000   | 861,576.000   |  |
| 1.3% IRISH TREASURY 20330515                        | 550,000.000   | 623,865.000   |  |
| 1.35% IRISH TREASURY 20310318                       | 200,000.000   | 225,962.000   |  |
| 1.1% IRISH TREASURY 20290515                        | 1,200,000.000 | 1,317,636.000 |  |
| 1.5% IRISH TREASURY 20500515                        | 400,000.000   | 481,904.000   |  |

|  |               |               |  |
|--|---------------|---------------|--|
| 0.4% IRISH TREASURY 20350515               | 250,000.000   | 251,422.500   |  |
| 0.2% IRISH TREASURY 20270515               | 800,000.000   | 818,752.000   |  |
| 6.25% Austria Government Bond<br>20270715  | 825,000.000   | 1,213,162.500 |  |
| 3.5% Austria Government Bond<br>20210915   | 1,337,000.000 | 1,404,999.820 |  |
| 4.15% Austria Government Bond<br>20370315  | 1,273,000.000 | 2,120,576.130 |  |
| 4.85% Austria Government Bond<br>20260315  | 875,000.000   | 1,145,305.000 |  |
| 3.65% Austria Government Bond<br>20220420  | 797,000.000   | 859,636.230   |  |
| 3.4% Austria Government Bond<br>20221122   | 872,000.000   | 957,604.240   |  |
| 3.8% Austria Government Bond<br>20620126   | 338,000.000   | 760,489.860   |  |
| 3.15% Austria Government Bond<br>20440620  | 623,000.000   | 1,040,596.900 |  |
| 1.75% Austria Government Bond<br>20231020  | 959,000.000   | 1,034,847.310 |  |
| 2.4% Austria Government Bond<br>20340523   | 771,000.000   | 1,023,648.990 |  |
| 1.65% Austria Government Bond<br>20241021  | 932,000.000   | 1,022,767.480 |  |
| 4% Finland Government Bond<br>20250704     | 667,000.000   | 821,137.030   |  |
| 2.75% Finland Government Bond<br>20280704  | 389,000.000   | 485,133.570   |  |
| 1.625% Finland Government<br>Bond 20220915 | 312,000.000   | 327,568.800   |  |
| 1.5% Finland Government Bond<br>20230415   | 446,000.000   | 472,380.900   |  |
| 2.625% Finland Government<br>Bond 20420704 | 407,000.000   | 620,377.890   |  |
| 2% Finland Government Bond<br>20240415     | 529,000.000   | 581,677.820   |  |
| 6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20290131     | 2,352,000.000 | 3,465,789.600 |  |
| 1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20250430   | 2,045,000.000 | 2,206,820.850 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20300730 | 2,052,000.000 | 2,335,791.600 |  |
| 2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20251031 | 2,192,000.000 | 2,441,208.480 |  |
| 1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20260430 | 1,733,000.000 | 1,923,023.450 |  |
| 0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20210730 | 1,747,000.000 | 1,769,571.240 |  |
| 2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20461031  | 1,652,000.000 | 2,221,180.080 |  |
| 3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20660730 | 950,000.000   | 1,498,910.000 |  |
| 1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20261031  | 2,030,000.000 | 2,177,256.200 |  |
| 0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20220430  | 2,080,000.000 | 2,109,598.400 |  |
| 1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20270430  | 1,900,000.000 | 2,067,922.000 |  |
| 2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20330730 | 1,700,000.000 | 2,033,489.000 |  |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20271031 | 2,050,000.000 | 2,223,532.500 |  |
| 0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20221031 | 1,600,000.000 | 1,629,184.000 |  |
| 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20280430  | 1,900,000.000 | 2,058,479.000 |  |
| 2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20481031  | 1,300,000.000 | 1,699,438.000 |  |
| 0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20230730 | 1,400,000.000 | 1,423,856.000 |  |
| 1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20280730  | 1,900,000.000 | 2,060,417.000 |  |
| 0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20211031 | 1,700,000.000 | 1,709,282.000 |  |
| 1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20290430 | 1,900,000.000 | 2,067,333.000 |  |
| 1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20350730 | 1,200,000.000 | 1,359,000.000 |  |
| 0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20240730 | 2,300,000.000 | 2,334,178.000 |  |

|   |               |               |  |
|---|---------------|---------------|--|
| 0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20291031  | 1,900,000.000 | 1,922,648.000 |  |
| 0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20300430  | 1,360,000.000 | 1,357,484.000 |  |
| SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20230430       | 2,460,000.000 | 2,474,415.600 |  |
| SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20250131       | 500,000.000   | 500,855.000   |  |
| 1% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20501031    | 1,200,000.000 | 1,076,172.000 |  |
| 0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20270730  | 2,400,000.000 | 2,491,440.000 |  |
| 1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20301031 | 2,900,000.000 | 3,092,473.000 |  |
| 5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20320730 | 1,979,000.000 | 3,151,359.600 |  |
| 4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20370131  | 1,854,000.000 | 2,777,069.520 |  |
| 4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20400730  | 2,158,000.000 | 3,609,255.000 |  |
| 4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20240131  | 1,682,000.000 | 1,985,432.800 |  |
| 4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20410730  | 1,873,000.000 | 3,104,984.480 |  |
| 4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20250730 | 2,189,000.000 | 2,710,726.260 |  |
| 5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20260730  | 1,965,000.000 | 2,657,092.650 |  |
| 5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20220131 | 1,978,000.000 | 2,178,529.640 |  |
| 5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20230131  | 1,958,000.000 | 2,249,369.980 |  |
| 4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20231031  | 1,901,000.000 | 2,196,206.290 |  |
| 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20281031 | 1,770,000.000 | 2,465,680.800 |  |
| 5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20441031 | 1,299,000.000 | 2,343,655.800 |  |
| 3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20240430  | 1,970,000.000 | 2,271,252.400 |  |

|      |   |               |  |  |
|------|---|---------------|--|--|
|      | 2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND<br>20241031 | 2,097,000.000 | 2,357,321.580                              |  |
|      | ユーロ 小計                                    |               | ユーロ<br>631,027,342.800<br>(76,152,379,728) |  |
| 国債証券 | 合計  |               | 191,001,914,387<br>[191,001,914,387]       |  |
| 合計   |   |               | 191,001,914,387<br>[191,001,914,387]       |  |

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

| 通貨           | 銘柄数        | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|--------------|------------|--------------|----------------|
| アメリカ・ドル      | 国債証券 243銘柄 | 100%         | 45.7%          |
| イギリス・ポンド     | 国債証券 45銘柄  | 100%         | 6.7%           |
| イスラエル・シケル    | 国債証券 13銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| オーストラリア・ドル   | 国債証券 24銘柄  | 100%         | 2.1%           |
| カナダ・ドル       | 国債証券 33銘柄  | 100%         | 1.9%           |
| シンガポール・ドル    | 国債証券 20銘柄  | 100%         | 0.4%           |
| スウェーデン・クローナ  | 国債証券 7銘柄   | 100%         | 0.3%           |
| デンマーク・クローネ   | 国債証券 7銘柄   | 100%         | 0.5%           |
| ノルウェー・クローネ   | 国債証券 8銘柄   | 100%         | 0.2%           |
| ポーランド・ズロチ    | 国債証券 15銘柄  | 100%         | 0.6%           |
| マレーシア・リングギット | 国債証券 36銘柄  | 100%         | 0.5%           |
| メキシコ・ペソ      | 国債証券 16銘柄  | 100%         | 0.8%           |
| ユーロ          | 国債証券 320銘柄 | 100%         | 39.9%          |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 4,010,802           | 5,245,355           |
| 親投資信託受益証券       | 1,343,240,672       | 1,705,371,088       |
| 未収入金            | 1,761,613           | -                   |
| 流動資産合計          | 1,349,013,087       | 1,710,616,443       |
| 資産合計            | 1,349,013,087       | 1,710,616,443       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 1,751,509           | -                   |
| 未払受託者報酬         | 139,538             | 182,581             |
| 未払委託者報酬         | 2,582,155           | 3,378,768           |
| その他未払費用         | 52,797              | 68,417              |
| 流動負債合計          | 4,525,999           | 3,629,766           |
| 負債合計            | 4,525,999           | 3,629,766           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,219,423,623       | 1,483,316,344       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 125,063,465         | 223,670,333         |
| （分配準備積立金）       | 22,979,887          | 73,620,693          |
| 元本等合計           | 1,344,487,088       | 1,706,986,677       |
| 純資産合計           | 1,344,487,088       | 1,706,986,677       |
| 負債純資産合計         | 1,349,013,087       | 1,710,616,443       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期                          |             | 第4期                          |             |
|-------------------------|------------------------------|-------------|------------------------------|-------------|
|                         | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |             |
| 営業収益                    |                              |             |                              |             |
| 受取利息                    |                              | -           |                              | 9           |
| 有価証券売買等損益               |                              | 38,289,799  |                              | 66,026,341  |
| その他収益                   |                              | 9,051       |                              | -           |
| 営業収益合計                  |                              | 38,298,850  |                              | 66,026,350  |
| 営業費用                    |                              |             |                              |             |
| 支払利息                    |                              | 2,179       |                              | 1,483       |
| 受託者報酬                   |                              | 273,887     |                              | 335,746     |
| 委託者報酬                   |                              | 5,068,595   |                              | 6,213,205   |
| その他費用                   |                              | 102,709     |                              | 126,385     |
| 営業費用合計                  |                              | 5,447,370   |                              | 6,676,819   |
| 営業利益                    |                              | 32,851,480  |                              | 59,349,531  |
| 経常利益                    |                              | 32,851,480  |                              | 59,349,531  |
| 当期純利益                   |                              | 32,851,480  |                              | 59,349,531  |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |                              | 3,144,254   |                              | 4,200,680   |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         |                              | 82,989,999  |                              | 125,063,465 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |                              | 31,900,927  |                              | 76,013,432  |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | 31,900,927  |                              | 76,013,432  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |                              | 19,534,687  |                              | 32,555,415  |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |                              | 19,534,687  |                              | 32,555,415  |
| 分配金                     |                              | 1 -         |                              | 1 -         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )         |                              | 125,063,465 |                              | 223,670,333 |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 1,112,542,866円 | 1,219,423,623円 |
| 期中追加設定元本額           | 364,448,905円   | 564,211,268円   |
| 期中一部解約元本額           | 257,568,148円   | 300,318,547円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,219,423,623口 | 1,483,316,344口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,783円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(12,330,655円)、投資信託約款に規定される収益調整金(102,083,578円)及び分配準備積立金(10,643,449円)より分配対象額は125,063,465円(1万口当たり1,025.59円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(55,150,179円)、投資信託約款に規定される収益調整金(150,050,968円)及び分配準備積立金(18,470,514円)より分配対象額は223,671,661円(1万口当たり1,507.92円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                      | 第4期                      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 2019年6月17日現在             | 2020年6月15日現在             |
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 35,599,704               | 61,275,165               |
| 合計        | 35,599,704               | 61,275,165               |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1026円<br>(11,026円) | 1.1508円<br>(11,508円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                    | 券面総額        | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|------------------------|-------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 252,653,861 | 340,627,935   |    |
|              | 外国債券インデックスマザーファンド      | 461,248,869 | 1,364,743,153 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                        |             | 1,705,371,088 |    |
| 合計           |                        |             | 1,705,371,088 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

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

## 「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|                 | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在   |
|-----------------|-----------------|----------------|
|                 | 金額(円)           | 金額(円)          |
| 資産の部            |                 |                |
| 流動資産            |                 |                |
| 預金              | 120,906,887     | 200,898,705    |
| コール・ローン         | 157,354,876     | 166,446,311    |
| 国債証券            | 12,113,022,561  | 15,042,824,100 |
| 派生商品評価勘定        | 1,139,592       | 764,928        |
| 未収入金            | 1,186,355       | 3,115,881      |
| 未収利息            | 212,291,160     | 237,696,108    |
| 前払費用            | 21,089,750      | 20,165,260     |
| 流動資産合計          | 12,626,991,181  | 15,671,911,293 |
| 資産合計            | 12,626,991,181  | 15,671,911,293 |
| 負債の部            |                 |                |
| 流動負債            |                 |                |
| 派生商品評価勘定        | 175,948         | 189,985        |
| 未払金             | 15,991,480      | 366,305        |
| 未払解約金           | 3,481,657       | 1,102,437      |
| その他未払費用         | -               | 35,364         |
| 流動負債合計          | 19,649,085      | 1,694,091      |
| 負債合計            | 19,649,085      | 1,694,091      |
| 純資産の部           |                 |                |
| 元本等             |                 |                |
| 元本              | 1 9,313,186,541 | 11,622,687,317 |
| 剰余金             |                 |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 3,294,155,555   | 4,047,529,885  |
| 元本等合計           | 12,607,342,096  | 15,670,217,202 |
| 純資産合計           | 12,607,342,096  | 15,670,217,202 |
| 負債純資産合計         | 12,626,991,181  | 15,671,911,293 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|    |                              |
|----|------------------------------|
| 区分 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|----|------------------------------|

|                            |   |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>  |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法     | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>   |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分               | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
|-------------------|----------------|----------------|
| 1. 1 期首           | 2018年6月16日     | 2019年6月18日     |
| 期首元本額             | 6,882,755,540円 | 9,313,186,541円 |
| 期中追加設定元本額         | 2,872,245,706円 | 3,357,716,803円 |
| 期中一部解約元本額         | 441,814,705円   | 1,048,216,027円 |
| 期末元本額の内訳<br>ファンド名 |                |                |

|  |                |                 |
|--|----------------|-----------------|
| 新興国債券インデックスファン<br>ド(FOFs用)(適格機関投<br>資家専用)                | 9,240,531円     | 53,585,601円     |
| ダイワファンドラップ 外国<br>債券インデックス エマー<br>ジングプラス(為替ヘッジな<br>し)     | 199,537,093円   | 252,653,861円    |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国債券インデックス<br>エマーシングプラス(為替<br>ヘッジなし) | 403,369,138円   | 351,443,596円    |
| D-I's 新興国債券イン<br>デックス                                    | 58,417,356円    | 53,898,062円     |
| iFree 新興国債券イン<br>デックス                                    | 2,157,305,281円 | 2,766,222,665円  |
| iFree 8資産バランス  | 1,267,577,936円 | 1,846,779,551円  |
| DCダイワ新興国債券イン<br>デックスファンド                                 | 5,006,795,753円 | 6,087,719,147円  |
| ダイワ・インデックスセレク<br>ト 新興国債券                                 | 179,398,402円   | 173,142,345円    |
| ダイワ・ノーロード 新興国<br>債券ファンド                                  | 31,545,051円    | 37,242,489円     |
| 計  | 9,313,186,541円 | 11,622,687,317円 |
| 2. 期末日における受益権の総数   | 9,313,186,541口 | 11,622,687,317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6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|-----------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。<br>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。<br>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。 |

|                            |  |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。<br>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。 |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

| 種 類  | 2019年6月17日現在       | 2020年6月15日現在       |
|------|--------------------|--------------------|
|      | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 373,038,039        | 399,332,571        |
| 合計   | 373,038,039        | 399,332,571        |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年7月6日から2019年6月17日まで、及び2019年7月6日から2020年6月15日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

| 種 類             | 2019年6月17日 現在 |           |             |             | 2020年6月15日 現在 |           |             |             |
|-----------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
|                 | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|                 | (円)           | うち<br>1年超 |             |             | (円)           | うち<br>1年超 |             |             |
| 市場取引以外の<br>取引   |               |           |             |             |               |           |             |             |
| 為替予約取引          |               |           |             |             |               |           |             |             |
| 買 建             | 99,642,186    | -         | 100,605,830 | 963,644     | 147,632,375   | -         | 148,207,318 | 574,943     |
| タイ・バーツ          | 14,610,960    | -         | 14,574,000  | 36,960      | -             | -         | -           | -           |
| チェコ・コルナ         | 15,462,080    | -         | 15,660,400  | 198,320     | 33,496,114    | -         | 33,948,000  | 451,886     |
| トルコ・リラ          | 8,589,875     | -         | 8,544,600   | 45,275      | 20,796,080    | -         | 20,634,850  | 161,230     |
| ハンガリー・<br>フォリント | 3,319,219     | -         | 3,287,730   | 31,489      | 4,007,423     | -         | 3,978,668   | 28,755      |
| ポーランド・<br>ズロチ   | 11,990,924    | -         | 12,012,000  | 21,076      | 68,665,590    | -         | 68,779,800  | 114,210     |
| メキシコ・ペソ         | 21,441,736    | -         | 22,091,500  | 649,764     | -             | -         | -           | -           |
| ルーマニア・<br>レイ    | 17,599,779    | -         | 17,774,400  | 174,621     | 20,421,792    | -         | 20,617,200  | 195,408     |
| 南アフリカ・<br>ランド   | 6,627,613     | -         | 6,661,200   | 33,587      | 245,376       | -         | 248,800     | 3,424       |
| 合計              | 99,642,186    | -         | 100,605,830 | 963,644     | 147,632,375   | -         | 148,207,318 | 574,943     |

## (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6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3537円<br>(13,537円) | 1.3482円<br>(13,482円) |

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種類  | 通貨                | 銘柄   | 券面総額               | 評価額                | 備考 |
|---|-------------------|--|--------------------|--------------------|----|
| 国債証券                                      | インドネシア・ルピア        |  | インドネシア・ルピア         | インドネシア・ルピア         |    |
|   |                   | 8.25% Indonesia Treasury Bond<br>20360515  | 8,250,000,000.000  | 8,552,280,000.000  |    |
|   |                   | 8.75% Indonesia Treasury Bond<br>20310515  | 6,000,000,000.000  | 6,507,540,000.000  |    |
|   |                   | 7.5% Indonesia Treasury Bond<br>20320815   | 5,500,000,000.000  | 5,398,910,000.000  |    |
|   |                   | 7.5% Indonesia Treasury Bond<br>20380515   | 7,300,000,000.000  | 7,114,069,000.000  |    |
|   |                   | 8.125% Indonesia Treasury<br>Bond 20240515 | 10,000,000,000.000 | 10,491,200,000.000 |    |
|   |                   | 8.375% Indonesia Treasury<br>Bond 20390415 | 5,000,000,000.000  | 5,222,850,000.000  |    |
|   |                   | 8.25% Indonesia Treasury Bond<br>20290515  | 12,000,000,000.000 | 12,775,320,000.000 |    |
|   |                   | 7% Indonesia Treasury Bond<br>20300915     | 8,100,000,000.000  | 7,986,438,000.000  |    |
|   |                   | 6.5% Indonesia Treasury Bond<br>20250615   | 9,000,000,000.000  | 8,891,280,000.000  |    |
|   |                   | 7.5% Indonesia Treasury Bond<br>20350615   | 6,100,000,000.000  | 6,009,781,000.000  |    |
|   |                   | 11% Indonesia Treasury Bond<br>20250915    | 3,600,000,000.000  | 4,259,304,000.000  |    |
| 10.5% Indonesia Treasury Bond<br>20300815 | 2,180,000,000.000 | 2,658,183,000.000                          |                    |                    |    |

|               |  |                    |  |  |
|---------------|--|--------------------|--|--|
|               | 8.25% Indonesia Treasury Bond<br>20210715                | 9,210,000,000.000  | 9,486,944,700.000                                    |  |
|               | 9.5% Indonesia Treasury Bond<br>20310715                 | 2,970,000,000.000  | 3,384,760,500.000                                    |  |
|               | 8.375% Indonesia Treasury<br>Bond 20260915               | 10,224,000,000.000 | 10,949,495,040.000                                   |  |
|               | 8.25% Indonesia Treasury Bond<br>20320615                | 4,750,000,000.000  | 4,949,595,000.000                                    |  |
|               | 7% Indonesia Treasury Bond<br>20270515                   | 10,330,000,000.000 | 10,299,629,800.000                                   |  |
|               | 7% Indonesia Treasury Bond<br>20220515                   | 11,060,000,000.000 | 11,284,296,800.000                                   |  |
|               | 5.625% Indonesia Treasury<br>Bond 20230515               | 10,910,000,000.000 | 10,711,656,200.000                                   |  |
|               | 6.125% Indonesia Treasury<br>Bond 20280515               | 8,700,000,000.000  | 8,125,191,000.000                                    |  |
|               | 6.625% Indonesia Treasury<br>Bond 20330515               | 7,075,000,000.000  | 6,441,080,000.000                                    |  |
|               | 8.375% Indonesia Treasury<br>Bond 20340315               | 12,520,000,000.000 | 13,077,390,400.000                                   |  |
|               | 8.375% Indonesia Treasury<br>Bond 20240315               | 13,150,000,000.000 | 13,869,699,500.000                                   |  |
|               | 9% Indonesia Treasury Bond<br>20290315                   | 11,120,000,000.000 | 12,295,050,400.000                                   |  |
|               | インドネシア・ルピア 小計  |                    | インドネシア・ルピア<br>200,741,944,340.000<br>(1,545,712,971) |  |
| ウルグアイ・ペ<br>ソ  | 9.875% Uruguay Government<br>International Bond 20220620 | 5,300,000.000      | 5,289,400.000  |  |
|               | 8.5% Uruguay Government<br>International Bond 20280315   | 2,800,000.000      | 2,512,244.000  |  |
|               | ウルグアイ・ペソ 小計  |                    | ウルグアイ・ペソ<br>7,801,644.000<br>(19,660,144)            |  |
| オフショア・人<br>民元 | 3.29% China Government Bond<br>20231018                  | 1,800,000.000      | 1,854,342.000  |  |

|              |   |                   |   |  |
|--------------|---|-------------------|---|--|
|              | 3.22% China Government Bond<br>20251206                   | 2,100,000.000     | 2,154,600.000                                   |  |
|              | 3.25% China Government Bond<br>20281122                   | 1,800,000.000     | 1,848,888.000                                   |  |
|              | 3.19% China Government Bond<br>20240411                   | 2,700,000.000     | 2,772,657.000                                   |  |
|              | 3.29% China Government Bond<br>20290523                   | 2,600,000.000     | 2,694,874.000                                   |  |
|              | 3.25% China Government Bond<br>20260606                   | 4,800,000.000     | 4,934,640.000                                   |  |
|              | 3.12% China Government Bond<br>20261205                   | 4,500,000.000     | 4,602,285.000                                   |  |
|              | 3.13% China Government Bond<br>20291121                   | 4,500,000.000     | 4,612,725.000                                   |  |
|              | 2.94% China Government Bond<br>20241017                   | 4,500,000.000     | 4,592,745.000                                   |  |
|              | オフショア・人民元 小計  |                   | オフショア・人民元<br>30,067,756.000<br>(454,925,148)    |  |
| コロンビア・ペ<br>ソ |   | コロンビア・ペソ          | コロンビア・ペソ  |  |
|              | 9.85% Colombia Government<br>International Bond 20270628  | 90,000,000.000    | 113,444,100.000                                 |  |
|              | 4.375% Colombia Government<br>International Bond 20230321 | 45,000,000.000    | 45,256,500.000                                  |  |
|              | 7% Colombian TES 20220504                                 | 4,335,000,000.000 | 4,600,302,000.000                               |  |
|              | 10% Colombian TES 20240724                                | 3,650,000,000.000 | 4,423,252,500.000                               |  |
|              | 6% Colombian TES 20280428                                 | 4,090,000,000.000 | 4,104,028,700.000                               |  |
|              | 7.5% Colombian TES 20260826                               | 4,310,000,000.000 | 4,819,528,200.000                               |  |
|              | 7.75% Colombian TES 20300918                              | 2,700,000,000.000 | 2,954,205,000.000                               |  |
|              | 7% Colombian TES 20320630                                 | 3,000,000,000.000 | 3,113,700,000.000                               |  |
|              | 6.25% Colombian TES 20251126                              | 2,300,000,000.000 | 2,435,263,000.000                               |  |
|              | 7.25% Colombian TES 20341018                              | 2,200,000,000.000 | 2,296,140,000.000                               |  |
|              | コロンビア・ペソ 小計   |                   | コロンビア・ペソ<br>28,905,120,000.000<br>(820,905,408) |  |
| タイ・パーツ       |   | タイ・パーツ            | タイ・パーツ  |  |
|              | 4.875% Thailand Government<br>Bond 20290622               | 26,050,000.000    | 34,293,262.000                                  |  |

|         |   |                |  |  |
|---------|---|----------------|--|--|
|         | 3.625% Thailand Government Bond 20230616      | 23,300,000.000 | 25,375,564.000                               |  |
|         | 3.85% Thailand Government Bond 20251212       | 22,610,000.000 | 26,198,885.300                               |  |
|         | 3.65% Thailand Government Bond 20211217       | 30,600,000.000 | 32,053,806.000                               |  |
|         | 3.65% Thailand Government Bond 20310620       | 22,700,000.000 | 27,783,438.000                               |  |
|         | 1.875% Thailand Government Bond 20220617      | 17,200,000.000 | 17,662,508.000                               |  |
|         | 3.4% Thailand Government Bond 20360617        | 16,600,000.000 | 20,670,652.000                               |  |
|         | 2.125% Thailand Government Bond 20261217      | 24,900,000.000 | 26,676,117.000                               |  |
|         | 2% Thailand Government Bond 20221217          | 20,000,000.000 | 20,707,800.000                               |  |
|         | 3.775% Thailand Government Bond 20320625      | 29,000,000.000 | 36,311,190.000                               |  |
|         | 2.875% Thailand Government Bond 20460617      | 24,900,000.000 | 29,421,840.000                               |  |
|         | 2.4% Thailand Government Bond 20231217        | 22,000,000.000 | 23,321,320.000                               |  |
|         | 2.875% Thailand Government Bond 20281217      | 20,000,000.000 | 22,752,200.000                               |  |
|         | 3.3% Thailand Government Bond 20380617        | 21,000,000.000 | 26,241,600.000                               |  |
|         | 1.45% Thailand Government Bond 20241217       | 22,000,000.000 | 22,654,940.000                               |  |
|         | 1.6% Thailand Government Bond 20291217        | 9,000,000.000  | 9,352,080.000                                |  |
|         | 1.6% Thailand Government Bond 20350617        | 12,000,000.000 | 12,152,040.000                               |  |
|         | タイ・パーツ 小計                                     |                | タイ・パーツ<br>413,629,242.300<br>(1,435,293,470) |  |
| チェコ・コロナ | 3.85% Czech Republic Government Bond 20210929 | 8,200,000.000  | 8,606,638.000                                |  |
|         | 2.5% Czech Republic Government Bond 20280825  | 12,600,000.000 | 14,282,730.000                               |  |

|            |  |                 |   |  |
|------------|--|-----------------|---|--|
|            | 5.7% Czech Republic<br>Government Bond 20240525  | 8,600,000.000   | 10,388,800.000                              |  |
|            | 4.7% Czech Republic<br>Government Bond 20220912  | 10,200,000.000  | 11,235,810.000                              |  |
|            | 2.4% Czech Republic<br>Government Bond 20250917  | 16,100,000.000  | 17,518,410.000                              |  |
|            | 1% Czech Republic Government<br>Bond 20260626    | 17,900,000.000  | 18,054,477.000                              |  |
|            | 0.95% Czech Republic<br>Government Bond 20300515 | 12,000,000.000  | 12,043,200.000                              |  |
|            | 0.45% Czech Republic<br>Government Bond 20231025 | 9,900,000.000   | 9,928,314.000                               |  |
|            | 0.25% Czech Republic<br>Government Bond 20270210 | 13,000,000.000  | 12,562,550.000                              |  |
|            | 2.75% Czech Republic<br>Government Bond 20290723 | 12,000,000.000  | 14,031,720.000                              |  |
|            | 2% Czech Republic Government<br>Bond 20331013    | 20,000,000.000  | 22,460,800.000                              |  |
| チェコ・コルナ 小計 |  |                 | チェコ・コルナ<br>151,113,449.000<br>(680,010,521) |  |
| チリ・ペソ      |  | チリ・ペソ           | チリ・ペソ                                       |  |
|            | 4.5% BONOS TESORERIA PESOS<br>20260301           | 550,000,000.000 | 639,793,000.000                             |  |
|            | 5% BONOS TESORERIA PESOS<br>20350301             | 570,000,000.000 | 710,265,600.000                             |  |
|            | 6% BONOS TESORERIA PESOS<br>20430101             | 410,000,000.000 | 606,377,700.000                             |  |
|            | 4.7% BONOS TESORERIA PESOS<br>20300901           | 410,000,000.000 | 490,355,900.000                             |  |
|            | 4% BONOS TESORERIA PESOS<br>20230301             | 250,000,000.000 | 273,695,000.000                             |  |
| チリ・ペソ 小計   |  |                 | チリ・ペソ<br>2,720,487,200.000<br>(367,537,821) |  |
| トルコ・リラ     |  | トルコ・リラ          | トルコ・リラ                                      |  |
|            | 9.5% Turkey Government Bond<br>20220112          | 1,660,000.000   | 1,673,678.400                               |  |
|            | 8.5% Turkey Government Bond<br>20220914          | 790,000.000     | 783,490.400                                 |  |

|                 |   |                               |   |  |
|-----------------|---|-------------------------------|---|--|
|                 | 7.1% Turkey Government Bond<br>20230308                 | 2,780,000.000                 | 2,603,720.200                             |  |
|                 | 10.4% Turkey Government Bond<br>20240320                | 680,000.000                   | 677,599.600                               |  |
|                 | 9% Turkey Government Bond<br>20240724                   | 1,630,000.000                 | 1,562,925.500                             |  |
|                 | 8% Turkey Government Bond<br>20250312                   | 2,690,000.000                 | 2,390,280.200                             |  |
|                 | 10.6% Turkey Government Bond<br>20260211                | 2,570,000.000                 | 2,479,947.200                             |  |
|                 | 9.2% Turkey Government Bond<br>20210922                 | 2,010,000.000                 | 2,025,296.100                             |  |
|                 | 11% Turkey Government Bond<br>20220302                  | 2,400,000.000                 | 2,472,096.000                             |  |
|                 | 11% Turkey Government Bond<br>20270224                  | 2,970,000.000                 | 2,861,892.000                             |  |
|                 | 10.7% Turkey Government Bond<br>20220817                | 1,900,000.000                 | 1,955,765.000                             |  |
|                 | 10.5% Turkey Government Bond<br>20270811                | 1,700,000.000                 | 1,594,600.000                             |  |
|                 | 12.2% Turkey Government Bond<br>20230118                | 1,400,000.000                 | 1,483,678.000                             |  |
|                 | 12.4% Turkey Government Bond<br>20280308                | 2,000,000.000                 | 2,044,000.000                             |  |
|                 | 16.2% Turkey Government Bond<br>20230614                | 1,400,000.000                 | 1,624,098.000                             |  |
|                 | トルコ・リラ 小計   |                               | トルコ・リラ<br>28,233,066.600<br>(444,106,138) |  |
| ドミニカ・ペソ         | 9.75% Dominican Republic<br>International Bond 20260605 | ドミニカ・ペソ<br>11,000,000.000     | ドミニカ・ペソ<br>9,685,280.000                  |  |
| ドミニカ・ペソ         | 小計  |                               | ドミニカ・ペソ<br>9,685,280.000<br>(17,820,915)  |  |
| ハンガリー・<br>フォリント | 3% Hungary Government Bond<br>20240626                  | ハンガリー・フォリント<br>98,500,000.000 | ハンガリー・フォリント<br>105,155,645.000            |  |
|                 | 3% Hungary Government Bond<br>20271027                  | 170,000,000.000               | 184,002,900.000                           |  |

|          |  |                            |   |  |
|----------|--|----------------------------|---|--|
|          | 2.5% Hungary Government Bond<br>20211027                   | 89,000,000.000             | 91,162,700.000                                    |  |
|          | 1.75% Hungary Government Bond<br>20221026                  | 140,000,000.000            | 142,879,800.000                                   |  |
|          | 2.75% Hungary Government Bond<br>20261222                  | 130,000,000.000            | 138,625,500.000                                   |  |
|          | 6.75% Hungary Government Bond<br>20281022                  | 88,000,000.000             | 120,630,400.000                                   |  |
|          | 3% Hungary Government Bond<br>20300821                     | 120,000,000.000            | 128,920,800.000                                   |  |
|          | 2.5% Hungary Government Bond<br>20241024                   | 160,000,000.000            | 167,788,800.000                                   |  |
|          | 3.25% Hungary Government Bond<br>20311022                  | 65,000,000.000             | 71,603,350.000                                    |  |
|          | 6% Hungary Government Bond<br>20231124                     | 131,800,000.000            | 153,350,618.000                                   |  |
|          | 7% Hungary Government Bond<br>20220624                     | 125,000,000.000            | 140,431,250.000                                   |  |
|          | 5.5% Hungary Government Bond<br>20250624                   | 142,500,000.000            | 170,536,875.000                                   |  |
|          | ハンガリー・フォリント 小計   |                            | ハンガリー・フォリント<br>1,615,088,638.000<br>(561,404,810) |  |
| フィリピン・ペソ | 6.25% Philippine Government<br>International Bond 20360114 | フィリピン・ペソ<br>10,000,000.000 | フィリピン・ペソ<br>12,309,000.000                        |  |
|          | フィリピン・ペソ 小計  |                            | フィリピン・ペソ<br>12,309,000.000<br>(26,341,260)        |  |
| ブラジル・リアル | 10% Brazil Notas do Tesouro<br>Nacional Serie F 20230101   | ブラジル・リアル<br>13,310,000.000 | ブラジル・リアル<br>15,119,228.300                        |  |
|          | 10% Brazil Notas do Tesouro<br>Nacional Serie F 20250101   | 9,490,000.000              | 11,151,793.900                                    |  |
|          | 10% Brazil Notas do Tesouro<br>Nacional Serie F 20270101   | 7,250,000.000              | 8,644,247.500                                     |  |
|          | 10% Brazil Notas do Tesouro<br>Nacional Serie F 20290101   | 3,800,000.000              | 4,611,566.000                                     |  |

|           |  |                            |   |  |
|-----------|--|----------------------------|---|--|
|           | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20210701 | 6,030,000.000              | 5,873,099.400                                 |  |
|           | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101 | 7,200,000.000              | 6,863,616.000                                 |  |
|           | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701 | 6,100,000.000              | 5,662,752.000                                 |  |
|           | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701 | 12,700,000.000             | 11,041,761.000                                |  |
|           | Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101 | 4,500,000.000              | 3,770,235.000                                 |  |
|           | ブラジル・レアル 小計                                |                            | ブラジル・レアル<br>72,738,299.100<br>(1,544,234,090) |  |
| ペルー・ソル    | 5.7% Peru Government Bond<br>20240812      | ペルー・ソル<br>730,000.000      | ペルー・ソル<br>843,953.000                         |  |
|           | 6.35% Peru Government Bond<br>20280812     | 1,970,000.000              | 2,320,088.700                                 |  |
|           | 6.15% Peru Government Bond<br>20320812     | 1,850,000.000              | 2,122,024.000                                 |  |
|           | 5.94% Peru Government Bond<br>20290212     | 1,900,000.000              | 2,180,041.000                                 |  |
|           | 5.4% Peru Government Bond<br>20340812      | 1,250,000.000              | 1,325,000.000                                 |  |
|           | 5.35% Peru Government Bond<br>20400812     | 1,400,000.000              | 1,421,420.000                                 |  |
|           | 8.2% Peru Government Bond<br>20260812      | 1,965,000.000              | 2,537,208.000                                 |  |
|           | 6.9% Peru Government Bond<br>20370812      | 2,065,000.000              | 2,506,455.700                                 |  |
|           | 6.95% Peru Government Bond<br>20310812     | 1,920,000.000              | 2,344,012.800                                 |  |
|           | ペルー・ソル 小計                                  |                            | ペルー・ソル<br>17,600,203.200<br>(544,374,285)     |  |
| ポーランド・ズロチ | 5.75% Poland Government Bond<br>20220923   | ポーランド・ズロチ<br>3,610,000.000 | ポーランド・ズロチ<br>4,056,737.500                    |  |
|           | 2.5% Poland Government Bond<br>20260725    | 3,740,000.000              | 4,077,123.600                                 |  |

|             |   |               |  |  |
|-------------|---|---------------|--|--|
|             | 1.75% Poland Government Bond<br>20210725                | 4,230,000.000 | 4,306,689.900                                  |  |
|             | 2.5% Poland Government Bond<br>20270725                 | 3,640,000.000 | 3,981,832.400                                  |  |
|             | 2.25% Poland Government Bond<br>20220425                | 3,200,000.000 | 3,319,968.000                                  |  |
|             | 2.5% Poland Government Bond<br>20230125                 | 3,000,000.000 | 3,166,140.000                                  |  |
|             | 2.5% Poland Government Bond<br>20240425                 | 3,500,000.000 | 3,755,605.000                                  |  |
|             | 2.75% Poland Government Bond<br>20291025                | 4,450,000.000 | 5,044,030.500                                  |  |
|             | 5.75% Poland Government Bond<br>20211025                | 1,820,000.000 | 1,959,084.400                                  |  |
|             | 4% Poland Government Bond<br>20231025                   | 2,530,000.000 | 2,827,249.700                                  |  |
|             | 2.75% Poland Government Bond<br>20280425                | 5,400,000.000 | 6,022,350.000                                  |  |
|             | 3.25% Poland Government Bond<br>20250725                | 3,550,000.000 | 3,981,431.500                                  |  |
|             | ポーランド・ズロチ 小計  |               | ポーランド・ズロチ<br>46,498,242.500<br>(1,260,567,354) |  |
| マレーシア・リンギット |   | マレーシア・リンギット   | マレーシア・リンギット                                    |  |
|             | 3.948% Malaysia Government<br>Investment Issue 20220414 | 3,400,000.000 | 3,502,680.000                                  |  |
|             | 4.258% Malaysia Government<br>Investment Issue 20270726 | 1,800,000.000 | 1,968,174.000                                  |  |
|             | 4.094% Malaysia Government<br>Investment Issue 20231130 | 2,000,000.000 | 2,108,900.000                                  |  |
|             | 4.369% Malaysia Government<br>Investment Issue 20281031 | 1,700,000.000 | 1,880,404.000                                  |  |
|             | 4.13% Malaysia Government<br>Investment Issue 20290709  | 2,600,000.000 | 2,835,898.000                                  |  |
|             | 3.655% Malaysia Government<br>Investment Issue 20241015 | 1,700,000.000 | 1,777,928.000                                  |  |
|             | 3.726% Malaysia Government<br>Investment Issue 20260331 | 1,400,000.000 | 1,477,238.000                                  |  |
|             | 3.465% Malaysia Government<br>Investment Issue 20301015 | 1,500,000.000 | 1,575,660.000                                  |  |

|         |   |                |   |  |
|---------|---|----------------|---|--|
|         | 4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20210715  | 1,350,000.000  | 1,380,240.000                                     |  |
|         | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20280615 | 2,350,000.000  | 2,471,448.000                                     |  |
|         | 4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240715 | 1,740,000.000  | 1,847,184.000                                     |  |
|         | 3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20250915 | 1,850,000.000  | 1,978,297.500                                     |  |
|         | 3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230817   | 1,400,000.000  | 1,457,708.000                                     |  |
|         | 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20261130   | 3,000,000.000  | 3,208,260.000                                     |  |
|         | 3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20211130  | 1,200,000.000  | 1,225,800.000                                     |  |
|         | 4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20240930 | 1,420,000.000  | 1,508,253.000                                     |  |
|         | 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20271116 | 2,120,000.000  | 2,266,195.200                                     |  |
|         | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20370407 | 1,700,000.000  | 1,968,328.000                                     |  |
|         | 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20230420 | 1,400,000.000  | 1,453,578.000                                     |  |
|         | 3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20260715 | 2,000,000.000  | 2,129,060.000                                     |  |
|         | 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT<br>20290815 | 1,400,000.000  | 1,507,926.000                                     |  |
|         | マレーシア・リングgit 小計                         |                | マレーシア・リングgit<br>41,529,159.700<br>(1,040,305,451) |  |
| メキシコ・ペソ |   | メキシコ・ペソ        | メキシコ・ペソ   |  |
|         | 5.75% Mexican Bonos 20260305            | 18,900,000.000 | 19,167,624.000                                    |  |
|         | 8% Mexican Bonos 20471107               | 17,500,000.000 | 19,197,325.000                                    |  |
|         | 7.25% Mexican Bonos 20211209            | 10,000,000.000 | 10,335,900.000                                    |  |
|         | 8% Mexican Bonos 20240905               | 22,000,000.000 | 24,401,080.000                                    |  |
|         | 8% Mexican Bonos 20231207               | 22,750,000.000 | 24,876,670.000                                    |  |
|         | 10% Mexican Bonos 20241205              | 20,350,000.000 | 24,239,902.500                                    |  |
|         | 7.5% Mexican Bonos 20270603             | 30,230,000.000 | 33,285,950.700                                    |  |
|         | 10% Mexican Bonos 20361120              | 7,390,000.000  | 9,797,440.300                                     |  |
|         | 8.5% Mexican Bonos 20290531             | 30,730,000.000 | 36,005,111.800                                    |  |
|         | 8.5% Mexican Bonos 20381118             | 14,100,000.000 | 16,363,332.000                                    |  |

|   |  |                |   |  |
|---|--|----------------|---|--|
|   | 7.75% Mexican Bonos 20310529                 | 17,950,000.000 | 20,081,383.000                                |  |
|   | 6.5% Mexican Bonos 20220609                  | 31,450,000.000 | 32,405,136.500                                |  |
|   | 7.75% Mexican Bonos 20421113                 | 17,820,000.000 | 19,025,523.000                                |  |
|   | 7.75% Mexican Bonos 20341123                 | 7,130,000.000  | 8,008,843.800                                 |  |
| メキシコ・ペソ 小計                                |  |                | メキシコ・ペソ<br>297,191,222.600<br>(1,414,630,219) |  |
| ルーマニア・レイ                                  |  | ルーマニア・レイ       | ルーマニア・レイ                                      |  |
|   | 5.85% Romania Government Bond<br>20230426    | 1,430,000.000  | 1,520,604.800                                 |  |
|   | 4.75% Romania Government Bond<br>20250224    | 1,150,000.000  | 1,202,946.000                                 |  |
|   | 5.8% Romania Government Bond<br>20270726     | 2,100,000.000  | 2,390,829.000                                 |  |
|   | 3.5% Romania Government Bond<br>20221219     | 1,090,000.000  | 1,091,896.600                                 |  |
|   | 3.25% Romania Government Bond<br>20240429    | 1,600,000.000  | 1,579,456.000                                 |  |
|   | 3.4% Romania Government Bond<br>20220308     | 1,700,000.000  | 1,699,813.000                                 |  |
|   | 4.25% Romania Government Bond<br>20230628    | 1,500,000.000  | 1,531,380.000                                 |  |
|   | 4% Romania Government Bond<br>20211027       | 1,000,000.000  | 1,009,430.000                                 |  |
|   | 5% Romania Government Bond<br>20290212       | 2,600,000.000  | 2,801,552.000                                 |  |
| 4.85% Romania Government Bond<br>20260422 | 1,000,000.000                                | 1,056,190.000  |   |  |
| 3.65% Romania Government Bond<br>20310924 | 1,400,000.000                                | 1,327,018.000  |   |  |
| ルーマニア・レイ 小計                               |  |                | ルーマニア・レイ<br>17,211,115.400<br>(429,417,329)   |  |
| ロシア・ルーブル                                  |  | ロシア・ルーブル       | ロシア・ルーブル                                      |  |
|   | 8.15% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20270203 | 31,760,000.000 | 37,017,550.400                                |  |
|   | 7.6% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20220720  | 32,910,000.000 | 34,890,523.800                                |  |

|  |                |  |  |
|--|----------------|--|--|
| 7% Russian Federal Bond - OFZ<br>20230125    | 14,400,000.000 | 15,200,064.000                                 |  |
| 7.05% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20280119 | 46,160,000.000 | 51,269,912.000                                 |  |
| 7% Russian Federal Bond - OFZ<br>20230816    | 24,300,000.000 | 25,910,118.000                                 |  |
| 7.5% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20210818  | 29,300,000.000 | 30,321,398.000                                 |  |
| 8.5% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20310917  | 31,000,000.000 | 38,145,190.000                                 |  |
| 7.75% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20260916 | 43,100,000.000 | 49,134,000.000                                 |  |
| 7.4% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20221207  | 59,000,000.000 | 62,722,900.000                                 |  |
| 7.7% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20330323  | 37,000,000.000 | 43,155,690.000                                 |  |
| 7.1% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20241016  | 35,600,000.000 | 38,557,292.000                                 |  |
| 7% Russian Federal Bond - OFZ<br>20211215    | 49,000,000.000 | 50,815,450.000                                 |  |
| 6.5% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20240228  | 38,000,000.000 | 40,097,980.000                                 |  |
| 7.25% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20340510 | 45,000,000.000 | 50,834,700.000                                 |  |
| 6.9% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20290523  | 51,000,000.000 | 56,031,150.000                                 |  |
| 7.95% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20261007 | 51,000,000.000 | 58,645,920.000                                 |  |
| 7.4% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20240717  | 55,000,000.000 | 60,053,950.000                                 |  |
| 7.15% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20251112 | 22,000,000.000 | 24,119,480.000                                 |  |
| 7.65% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20300410 | 40,000,000.000 | 46,324,000.000                                 |  |
| 7.7% Russian Federal Bond -<br>OFZ 20390316  | 33,000,000.000 | 39,508,260.000                                 |  |
| ロシア・ルーブル 小計                                  |                | ロシア・ルーブル<br>852,755,528.200<br>(1,313,243,513) |  |

|              |  |   |                             |  |
|--------------|--|---|-----------------------------|--|
| 南アフリカ・ランド    | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221  | 南アフリカ・ランド<br>30,050,000.000                     | 南アフリカ・ランド<br>34,286,148.500 |  |
|              | 6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331  | 11,220,000.000                                  | 7,429,547.400               |  |
|              | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228   | 9,880,000.000                                   | 6,232,205.200               |  |
|              | 7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228     | 15,940,000.000                                  | 13,147,790.200              |  |
|              | 7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228  | 13,880,000.000                                  | 14,733,481.200              |  |
|              | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228  | 29,520,000.000                                  | 23,172,904.800              |  |
|              | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131   | 14,500,000.000                                  | 11,720,640.000              |  |
|              | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131     | 22,900,000.000                                  | 21,182,729.000              |  |
|              | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131  | 16,600,000.000                                  | 13,127,446.000              |  |
|              | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331  | 15,300,000.000                                  | 13,357,359.000              |  |
|              | 8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228 | 14,100,000.000                                  | 12,157,161.000              |  |
|              | 9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131     | 11,300,000.000                                  | 9,313,686.000               |  |
| 南アフリカ・ランド 小計 |  | 南アフリカ・ランド<br>179,861,098.300<br>(1,122,333,253) |                             |  |
| 国債証券 合計      |  | 15,042,824,100<br>[15,042,824,100]              |                             |  |
| 合計           |  | 15,042,824,100<br>[15,042,824,100]              |                             |  |

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

| 通貨         | 銘柄数       | 組入債券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-----------|--------------|----------------|
| インドネシア・ルピア | 国債証券 24銘柄 | 100%         | 10.3%          |

|              |      |      |      |       |
|--------------|------|------|------|-------|
| ウルグアイ・ペソ     | 国債証券 | 2銘柄  | 100% | 0.1%  |
| オフショア・人民元    | 国債証券 | 9銘柄  | 100% | 3.0%  |
| コロンビア・ペソ     | 国債証券 | 10銘柄 | 100% | 5.5%  |
| タイ・バーツ       | 国債証券 | 17銘柄 | 100% | 9.5%  |
| チェコ・コルナ      | 国債証券 | 11銘柄 | 100% | 4.5%  |
| チリ・ペソ        | 国債証券 | 5銘柄  | 100% | 2.4%  |
| トルコ・リラ       | 国債証券 | 15銘柄 | 100% | 3.0%  |
| ドミニカ・ペソ      | 国債証券 | 1銘柄  | 100% | 0.1%  |
| ハンガリー・フォリント  | 国債証券 | 12銘柄 | 100% | 3.7%  |
| フィリピン・ペソ     | 国債証券 | 1銘柄  | 100% | 0.2%  |
| ブラジル・リアル     | 国債証券 | 9銘柄  | 100% | 10.3% |
| ペルー・ソル       | 国債証券 | 9銘柄  | 100% | 3.6%  |
| ポーランド・ズロチ    | 国債証券 | 12銘柄 | 100% | 8.4%  |
| マレーシア・リングgit | 国債証券 | 21銘柄 | 100% | 6.9%  |
| メキシコ・ペソ      | 国債証券 | 14銘柄 | 100% | 9.4%  |
| ルーマニア・レイ     | 国債証券 | 11銘柄 | 100% | 2.9%  |
| ロシア・ルーブル     | 国債証券 | 20銘柄 | 100% | 8.7%  |
| 南アフリカ・ランド    | 国債証券 | 12銘柄 | 100% | 7.5%  |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### 【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 15,515,511          | 14,916,403          |
| 親投資信託受益証券       | 3,252,858,304       | 4,079,375,775       |
| 未収入金            | 3,042,000           | -                   |
| 流動資産合計          | 3,271,415,815       | 4,094,292,178       |
| 資産合計            | 3,271,415,815       | 4,094,292,178       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 12,068,718          | 5,747,521           |
| 未払受託者報酬         | 308,957             | 446,406             |
| 未払委託者報酬         | 4,480,382           | 6,473,523           |
| その他未払費用         | 77,948              | 111,563             |
| 流動負債合計          | 16,936,005          | 12,779,013          |
| 負債合計            | 16,936,005          | 12,779,013          |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1 2,753,769,433     | 1 3,955,757,912     |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 500,710,377         | 125,755,253         |
| （分配準備積立金）       | 435,415,462         | 334,107,541         |
| 元本等合計           | 3,254,479,810       | 4,081,513,165       |
| 純資産合計           | 3,254,479,810       | 4,081,513,165       |
| 負債純資産合計         | 3,271,415,815       | 4,094,292,178       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|                         | 第3期                          |             | 第4期                          |             |
|-------------------------|------------------------------|-------------|------------------------------|-------------|
|                         | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |             |
| <b>営業収益</b>             |                              |             |                              |             |
| 受取利息                    |                              | 3           |                              | 58          |
| 有価証券売買等損益               |                              | 400,376,017 |                              | 585,452,529 |
| 営業収益合計                  |                              | 400,376,020 |                              | 585,452,471 |
| <b>営業費用</b>             |                              |             |                              |             |
| 支払利息                    |                              | 8,027       |                              | 5,185       |
| 受託者報酬                   |                              | 583,375     |                              | 861,943     |
| 委託者報酬                   |                              | 8,460,193   |                              | 12,499,478  |
| その他費用                   |                              | 146,582     |                              | 216,465     |
| 営業費用合計                  |                              | 9,198,177   |                              | 13,583,071  |
| 営業利益又は営業損失（ ）           |                              | 391,177,843 |                              | 599,035,542 |
| 経常利益又は経常損失（ ）           |                              | 391,177,843 |                              | 599,035,542 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）         |                              | 391,177,843 |                              | 599,035,542 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額      |                              | 33,481,973  |                              | 44,895,810  |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）         |                              | 57,450,905  |                              | 500,710,377 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          |                              | 104,380,406 |                              | 436,598,202 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 |                              | 104,380,406 |                              | 436,598,202 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          |                              | 18,816,804  |                              | 167,621,974 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 |                              | 18,816,804  |                              | 167,621,974 |
| 分配金                     |                              | 1 -         |                              | 1 -         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）         |                              | 500,710,377 |                              | 125,755,253 |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 2,297,924,064円 | 2,753,769,433円 |
| 期中追加設定元本額           | 1,052,662,291円 | 2,033,327,838円 |
| 期中一部解約元本額           | 596,816,922円   | 831,339,359円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 2,753,769,433口 | 3,955,757,912口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(357,700,099円)、投資信託約款に規定される収益調整金(65,302,064円)及び分配準備積立金(77,715,363円)より分配対象額は500,717,526円(1万口当たり1,818.30円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(350,262,609円)及び分配準備積立金(334,107,541円)より分配対象額は684,370,150円(1万口当たり1,730.06円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|---|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|----------------------------|---|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>   |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>   |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>   |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                  | 第4期                  |
|-----------|----------------------|----------------------|
|           | 2019年6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 385,994,237          | 612,994,032          |
| 合計        | 385,994,237          | 612,994,032          |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1818円<br>(11,818円) | 1.0318円<br>(10,318円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄              | 券面総額          | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | ダイワJ-REITマザーファンド | 1,595,500,538 | 4,079,375,775 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                  |               | 4,079,375,775 |    |
| 合計           |                  |               | 4,079,375,775 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「ダイワJ-REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 「ダイワJ-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

|      | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|------|--------------|--------------|
|      | 金 額 (円)      | 金 額 (円)      |
| 資産の部 |              |              |
| 流動資産 |              |              |

|                 |   |                 |                 |
|-----------------|---|-----------------|-----------------|
| コール・ローン         |   | 3,926,297,899   | 7,793,194,074   |
| 投資証券            | 2 | 274,642,114,000 | 312,729,669,700 |
| 派生商品評価勘定        |   | 27,184,000      | -               |
| 未収入金            |   | -               | 2,239,422,708   |
| 未収配当金           |   | 1,704,536,535   | 2,337,843,577   |
| 前払金             |   | -               | 213,945,200     |
| 差入委託証拠金         |   | -               | 23,464,000      |
| 流動資産合計          |   | 280,300,132,434 | 325,337,539,259 |
| 資産合計            |   | 280,300,132,434 | 325,337,539,259 |
| 負債の部            |   |                 |                 |
| 流動負債            |   |                 |                 |
| 派生商品評価勘定        |   | -               | 605,628,480     |
| 前受金             |   | 34,400,000      | -               |
| 未払金             |   | 604,206,193     | 83,013,000      |
| 未払解約金           |   | 670,176,100     | 106,784,000     |
| その他未払費用         |   | -               | 20,322          |
| 流動負債合計          |   | 1,308,782,293   | 795,445,802     |
| 負債合計            |   | 1,308,782,293   | 795,445,802     |
| 純資産の部           |   |                 |                 |
| 元本等             |   |                 |                 |
| 元本              | 1 | 95,580,504,970  | 126,932,759,051 |
| 剰余金             |   |                 |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) |   | 183,410,845,171 | 197,609,334,406 |
| 元本等合計           |   | 278,991,350,141 | 324,542,093,457 |
| 純資産合計           |   | 278,991,350,141 | 324,542,093,457 |
| 負債純資産合計         |   | 280,300,132,434 | 325,337,539,259 |

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |
|--------------------|------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券                         |

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分                       | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在     |
|---------------------------|-----------------|------------------|
| 1. 1 期首                   | 2018年6月16日      | 2019年6月18日       |
| 期首元本額                     | 84,131,299,324円 | 95,580,504,970円  |
| 期中追加設定元本額                 | 19,598,932,151円 | 47,652,104,674円  |
| 期中一部解約元本額                 | 8,149,726,505円  | 16,299,850,593円  |
| 期末元本額の内訳                  |                 |                  |
| ファンド名                     |                 |                  |
| ダイワJ-REITオープン             | 6,706,584,651円  | 5,794,841,087円   |
| ダイワJ-REITオープン<br>(毎月分配型)  | 80,193,938,516円 | 110,923,691,743円 |
| ダイワJ-REITオープン<br>(年1回決算型) | 338,060,927円    | 311,434,660円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050    | 79,957円         | 1,050,856円       |
| iFree J-REITイ<br>ンデックス    | 96,476,948円     | 138,691,083円     |
| iFree 8資産バランス             | 590,869,858円    | 1,004,463,405円   |
| DC・ダイワJ-REIT<br>オープン      | 4,402,876,383円  | 5,260,587,366円   |

|    |  |   |   |
|----|--|---|---|
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020                 | 2,455,804円  | 2,744,770円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030                 | 4,838,857円  | 4,982,707円  |
|    | DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                 | 1,399,634円  | 2,440,608円  |
|    | ダイワ・ノーロード J - R<br>EITファンド             | 50,397,512円   | 103,161,629円  |
|    | ダイワファンドラップ J -<br>REITインデックス           | 1,114,412,383円  | 1,595,500,538円  |
|    | ダイワ J - REITインデッ<br>クス(ダイワSMA専用)       | 438,357,130円  | 229,542,915円  |
|    | ダイワファンドラップオンラ<br>イン J - REITインデッ<br>クス | 374,445,092円  | 418,298,119円  |
|    | ダイワ・インデックスセレク<br>ト J - REIT            | 1,265,311,318円  | 1,141,327,565円  |
|    | 計                                      | 95,580,504,970円   | 126,932,759,051円  |
| 2. | 期末日における受益権の総数                          | 95,580,504,970口   | 126,932,759,051口  |
| 3. | 2 差入委託証拠金代用有価証券                        | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>投資証券 455,400,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠<br>金代用有価証券として以下の<br>とおり差入を行っております。<br>投資証券 2,874,650,000円 |

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15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<br>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<br>の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | <p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類 | 2019年6月17日現在       | 2020年6月15日現在       |
|-----|--------------------|--------------------|
|     | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に含まれた評価差額（円） |
|     |                    |                    |

|      |               |                |
|------|---------------|----------------|
| 投資証券 | 8,449,127,430 | 15,546,572,937 |
| 合計   | 8,449,127,430 | 15,546,572,937 |

(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3月16日から2019年6月17日まで、及び2020年3月17日から2020年6月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 不動産投信関連

| 種 類             | 2019年6月17日 現在 |           |               |             | 2020年6月15日 現在 |           |               |             |
|-----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
|                 | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) | 契約額等<br>(円)   | うち<br>1年超 | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|                 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 市場取引            |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 不動産投信<br>指数先物取引 |               |           |               |             |               |           |               |             |
| 買 建             | 3,803,600,000 | -         | 3,831,000,000 | 27,400,000  | 9,075,323,200 | -         | 8,470,272,000 | 605,051,200 |
| 合計              | 3,803,600,000 | -         | 3,831,000,000 | 27,400,000  | 9,075,323,200 | -         | 8,470,272,000 | 605,051,200 |

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

|              | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.9189円      | 2.5568円      |
| (1万口当たり純資産額) | (29,189円)    | (25,568円)    |

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類           | 銘 柄                          | 券面総額          | 評価額<br>(円)     | 備考 |
|---------------|------------------------------|---------------|----------------|----|
| 投資証券          | エスコンジャパンリート                  | 4,500         | 463,950,000    |    |
|               | サンケイリアルエステート                 | 5,361         | 511,439,400    |    |
|               | SOSILA物流リート投                 | 8,242         | 1,017,062,800  |    |
|               | 日本アコモデーションファンド投資法人           | 12,293        | 7,707,711,000  |    |
|               | M C U B S M i d C i t y 投資法人 | 47,461        | 3,739,926,800  |    |
|               | 森ヒルズリート                      | 42,562        | 5,852,275,000  |    |
|               | 産業ファンド                       | 47,642        | 7,713,239,800  |    |
|               | アドバンス・レジデンス                  | 35,087        | 10,392,769,400 |    |
|               | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人      | 24,134        | 4,276,544,800  |    |
|               | A P I 投資法人                   | 18,537        | 6,784,542,000  |    |
|               | G L P 投資法人                   | 92,138        | 12,715,044,000 |    |
|               | コンフォリア・レジデンシャル               | 16,107        | 5,001,223,500  |    |
|               | 日本プロロジスリート                   | 55,665        | 16,415,608,500 |    |
|               | 星野リゾート・リート                   | 5,629         | 2,465,502,000  |    |
|               | O N E リート投資法人                | 5,766         | 1,455,915,000  |    |
|               | イオンリート投資                     | 39,923        | 4,367,576,200  |    |
|               | ヒューリックリート投資法                 | 31,461        | 4,133,975,400  |    |
|               | 日本リート投資法人                    | 12,016        | 4,085,440,000  |    |
|               | インベスコ・オフィス・Jリート              | 237,663       | 3,465,126,540  |    |
|               | 積水ハウス・リート投資                  | 108,165       | 7,311,954,000  |    |
|               | トーセイ・リート投資法人                 | 8,052         | 810,836,400    |    |
|               | ケネディクス商業リート                  | 14,288        | 2,807,592,000  |    |
|               | ヘルスケア&メディカル投資                | 7,890         | 948,378,000    |    |
|               | サムティ・レジデンシャル                 | 7,405         | 753,088,500    |    |
|               | 野村不動産マスターF                   | 119,426       | 16,289,706,400 |    |
|               | いちごホテルリート投資                  | 6,128         | 419,768,000    |    |
|               | ラサールロジポート投資                  | 34,395        | 5,296,830,000  |    |
|               | スターアジア不動産投                   | 12,277        | 1,119,662,400  |    |
|               | マリモ地方創生リート                   | 3,646         | 397,414,000    |    |
|               | 三井不ロジパーク                     | 10,528        | 4,721,808,000  |    |
| 大江戸温泉リート      | 6,285                        | 415,438,500   |                |    |
| さくら総合リート      | 8,004                        | 628,314,000   |                |    |
| 投資法人みらい       | 42,070                       | 1,623,902,000 |                |    |
| 森トラスト・ホテルリート投 | 8,679                        | 838,391,400   |                |    |
| 三菱地所物流REIT    | 7,282                        | 2,818,134,000 |                |    |

|                   |           |                 |  |
|-------------------|-----------|-----------------|--|
| CREロジスティクスファンド    | 6,955     | 1,014,039,000   |  |
| ザイマックス・リート        | 5,369     | 510,055,000     |  |
| タカラレーベン不動産投       | 10,499    | 930,211,400     |  |
| 伊藤忠アドバンスロジ        | 7,699     | 992,401,100     |  |
| 日本ビルファンド          | 35,823    | 23,213,304,000  |  |
| ジャパンリアルエステイト      | 36,993    | 20,531,115,000  |  |
| 日本リテールファンド        | 69,917    | 9,627,570,900   |  |
| オリックス不動産投資        | 73,708    | 10,407,569,600  |  |
| 日本プライムリアルティ       | 24,311    | 7,803,831,000   |  |
| プレミア投資法人          | 33,413    | 3,708,843,000   |  |
| 東急リアル・エステート       | 24,802    | 3,588,849,400   |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人   | 25,688    | 2,442,928,800   |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 83,062    | 9,643,498,200   |  |
| 森トラスト総合リート        | 26,439    | 3,418,562,700   |  |
| インヴィンシブル投資法人      | 162,268   | 4,868,040,000   |  |
| フロンティア不動産投資       | 13,140    | 4,480,740,000   |  |
| 平和不動産リート          | 23,037    | 2,368,203,600   |  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 24,171    | 6,775,131,300   |  |
| 福岡リート投資法人         | 19,132    | 2,351,322,800   |  |
| ケネディクス・オフィス投資法人   | 11,444    | 6,637,520,000   |  |
| いちごオフィスリート投資法人    | 28,645    | 2,114,001,000   |  |
| 大和証券オフィス投資法人      | 8,538     | 4,986,192,000   |  |
| 阪急阪神リート投資法人       | 16,709    | 2,132,068,400   |  |
| スタートアップロシード投資法人   | 5,761     | 1,139,525,800   |  |
| 大和ハウスリート投資法人      | 52,782    | 13,517,470,200  |  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 119,171   | 5,166,062,850   |  |
| 大和証券リビング投資法人      | 45,286.05 | 4,265,945,910   |  |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 34,218    | 4,328,577,000   |  |
| 投資証券 合計           |           | 312,729,669,700 |  |
| 合計                |           | 312,729,669,700 |  |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

|            |        |              |        |
|------------|--------|--------------|--------|
| 日本プロロジスリート | 2,500口 | 野村不動産マスターF   | 4,000口 |
| 日本ビルファンド   | 1,600口 | ジャパンリアルエステイト | 1,000口 |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在         | 第4期<br>2020年6月15日現在         |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |                             |
| 流動資産            |                             |                             |
| コール・ローン         | 62,263,405                  | 30,397,777                  |
| 親投資信託受益証券       | 10,918,058,430              | 12,036,678,078              |
| 派生商品評価勘定        | 5,228,448                   | 42,247,946                  |
| 未収入金            | 924,258                     | 72,836                      |
| 流動資産合計          | 10,986,474,541              | 12,109,396,637              |
| 資産合計            |                             |                             |
|                 | 10,986,474,541              | 12,109,396,637              |
| <b>負債の部</b>     |                             |                             |
| 流動負債            |                             |                             |
| 派生商品評価勘定        | 40,949,810                  | 22,322,990                  |
| 未払金             | 59,460                      | 154,358                     |
| 未払解約金           | 27,724,774                  | 4,318,330                   |
| 未払受託者報酬         | 1,103,445                   | 1,283,878                   |
| 未払委託者報酬         | 20,690,411                  | 24,073,468                  |
| その他未払費用         | 278,664                     | 321,031                     |
| 流動負債合計          | 90,806,564                  | 52,474,055                  |
| 負債合計            |                             |                             |
|                 | 90,806,564                  | 52,474,055                  |
| <b>純資産の部</b>    |                             |                             |
| 元本等             |                             |                             |
| 元本              | <sup>1</sup> 10,126,367,998 | <sup>1</sup> 13,224,446,669 |
| 剰余金             |                             |                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | <sup>2</sup> 769,299,979    | <sup>2</sup> 1,167,524,087  |
| (分配準備積立金)       | 1,089,204,741               | 864,954,858                 |
| 元本等合計           | 10,895,667,977              | 12,056,922,582              |
| 純資産合計           |                             |                             |
|                 | 10,895,667,977              | 12,056,922,582              |
| 負債純資産合計         |                             |                             |
|                 | 10,986,474,541              | 12,109,396,637              |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |                      | 第4期                          |                      |
|---|------------------------------|----------------------|------------------------------|----------------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |                      | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |                      |
| <b>営業収益</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 受取利息                                      |                              | 1                    |                              | 79                   |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 1,025,505,531        |                              | 1,872,220,352        |
| 為替差損益                                     |                              | 49,909,833           |                              | 13,684,259           |
| その他収益                                     |                              | 19,940               |                              | -                    |
| <b>営業収益合計</b>                             |                              | <b>1,075,435,305</b> |                              | <b>1,885,904,532</b> |
| <b>営業費用</b>                               |                              |                      |                              |                      |
| 支払利息                                      |                              | 29,554               |                              | 17,448               |
| 受託者報酬                                     |                              | 2,123,649            |                              | 2,548,251            |
| 委託者報酬                                     |                              | 39,819,913           |                              | 47,781,335           |
| その他費用                                     |                              | 543,953              |                              | 651,228              |
| <b>営業費用合計</b>                             |                              | <b>42,517,069</b>    |                              | <b>50,998,262</b>    |
| <b>営業利益又は営業損失（ ）</b>                      |                              | <b>1,032,918,236</b> |                              | <b>1,936,902,794</b> |
| <b>経常利益又は経常損失（ ）</b>                      |                              | <b>1,032,918,236</b> |                              | <b>1,936,902,794</b> |
| <b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>                    |                              | <b>1,032,918,236</b> |                              | <b>1,936,902,794</b> |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） |                              | 93,196,250           |                              | 102,569,111          |
| <b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>                    |                              | <b>248,502,484</b>   |                              | <b>769,299,979</b>   |
| <b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>                     |                              | <b>78,080,477</b>    |                              | <b>96,195,205</b>    |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 58,732,152           |                              | -                    |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 19,348,325           |                              | 96,195,205           |
| <b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>                     |                              | <b>-</b>             |                              | <b>198,685,588</b>   |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | -                    |                              | 198,685,588          |
| <b>分配金</b>                                |                              | <b>1 -</b>           |                              | <b>1 -</b>           |
| <b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>                    |                              | <b>769,299,979</b>   |                              | <b>1,167,524,087</b> |

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分                        | 第4期  |              |
|----------------------------|--|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日   | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。   |              |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法     | 為替予約取引<br><br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |              |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。  |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期             | 第4期             |
|---------------------|-----------------|-----------------|
|                     | 2019年6月17日現在    | 2020年6月15日現在    |
| 1. 1 期首元本額          | 8,936,929,166円  | 10,126,367,998円 |
| 期中追加設定元本額           | 3,628,593,466円  | 5,683,570,118円  |
| 期中一部解約元本額           | 2,439,154,634円  | 2,585,491,447円  |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 10,126,367,998口 | 13,224,446,669口 |

|            |  |   |
|------------|--|---|
| 3. 2 元本の欠損 |  | 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,167,524,087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3期<br>自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日  | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15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(939,720,575円)、投資信託約款に規定される収益調整金(258,405,632円)及び分配準備積立金(149,484,166円)より分配対象額は1,347,610,373円(1万口当たり1,330.79円)であり、分配を行っておりません。 | 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(894,949,389円)及び分配準備積立金(864,954,858円)より分配対象額は1,759,904,247円(1万口当たり1,330.80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4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期<br>2020年6月15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<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期<br>2019年6月17日現在      | 第4期<br>2020年6月15日現在      |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
|           | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当計算期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 949,388,259              | 1,821,781,199            |
| 合計        | 949,388,259              | 1,821,781,199            |

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 通貨関連

| 種 類             | 第3期<br>2019年6月17日 現在 |           |                |            | 第4期<br>2020年6月15日 現在 |           |                |            |
|-----------------|----------------------|-----------|----------------|------------|----------------------|-----------|----------------|------------|
|                 | 契約額等                 | うち<br>1年超 | 時価             | 評価損益       | 契約額等                 | うち<br>1年超 | 時価             | 評価損益       |
|                 | (円)                  |           | (円)            | (円)        | (円)                  |           | (円)            | (円)        |
| 市場取引以外の<br>取引   |                      |           |                |            |                      |           |                |            |
| 為替予約取引          |                      |           |                |            |                      |           |                |            |
| 売 建             | 10,388,616,746       | -         | 10,424,338,108 | 35,721,362 | 11,617,959,085       | -         | 11,598,034,129 | 19,924,956 |
| アメリカ・ドル         | 7,577,552,770        | -         | 7,608,954,604  | 31,401,834 | 8,759,616,738        | -         | 8,718,834,600  | 40,782,138 |
| イギリス・ポンド        | 526,336,857          | -         | 525,580,694    | 756,163    | 616,065,166          | -         | 619,536,027    | 3,470,861  |
| イスラエル・<br>シュケル  | 7,082,849            | -         | 7,154,770      | 71,921     | 8,372,831            | -         | 8,443,992      | 71,161     |
| オーストラリア・<br>ドル  | 716,355,818          | -         | 712,088,035    | 4,267,783  | 756,761,477          | -         | 766,994,778    | 10,233,301 |
| カナダ・ドル          | 198,288,878          | -         | 200,397,947    | 2,109,069  | 212,973,061          | -         | 213,421,852    | 448,791    |
| シンガポール・<br>ドル   | 368,077,807          | -         | 370,121,952    | 2,044,145  | 459,724,940          | -         | 462,233,622    | 2,508,682  |
| ニュージー<br>ランド・ドル | 49,032,688           | -         | 48,863,894     | 168,794    | 50,656,838           | -         | 51,909,033     | 1,252,195  |
| ユーロ             | 672,549,584          | -         | 676,738,700    | 4,189,116  | 545,912,256          | -         | 549,576,720    | 3,664,464  |
| 香港・ドル           | 273,339,495          | -         | 274,437,512    | 1,098,017  | 207,875,778          | -         | 207,083,505    | 792,273    |
| 合計              | 10,388,616,746       | -         | 10,424,338,108 | 35,721,362 | 11,617,959,085       | -         | 11,598,034,129 | 19,924,956 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

|  |
|--|
| <p>第4期<br/>自 2019年6月18日<br/>至 2020年6月15日</p>                             |
| <p>市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。</p> |

( 1口当たり情報 )

|                | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|----------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額      | 1.0760円             | 0.9117円             |
| ( 1万口当たり純資産額 ) | (10,760円)           | (9,117円)            |

(4) 【 附属明細表 】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額<br>( 円 ) | 備考 |
|-----|-----|------|--------------|----|
|     |     |      |              |    |

|              |                             |               |                |  |
|--------------|-----------------------------|---------------|----------------|--|
| 親投資信託受益証券    | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 5,819,881,094 | 12,036,678,078 |  |
| 親投資信託受益証券 合計 |                             |               | 12,036,678,078 |  |
| 合計           |                             |               | 12,036,678,078 |  |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### (参考)

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

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

### 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

|          | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
|----------|----------------|----------------|
|          | 金額(円)          | 金額(円)          |
| 資産の部     |                |                |
| 流動資産     |                |                |
| 預金       | 31,637,876     | 41,057,234     |
| コール・ローン  | 206,694,603    | 423,504,486    |
| 投資信託受益証券 | 139,379,269    | 540,422,575    |
| 投資証券     | 22,264,457,330 | 23,424,809,404 |
| 派生商品評価勘定 | 9,191,356      | 119,248,888    |
| 未収入金     | 527,362        | 1,385,735      |
| 未収配当金    | 41,015,642     | 46,237,902     |
| 差入委託証拠金  | 51,198,111     | 210,886,807    |
| 流動資産合計   | 22,744,101,549 | 24,807,553,031 |
| 資産合計     | 22,744,101,549 | 24,807,553,031 |
| 負債の部     |                |                |

|                 |                |                |
|-----------------|----------------|----------------|
| 流動負債            |                |                |
| 派生商品評価勘定        | 77,705         | 1,441,168      |
| 未払金             | 54,858,688     | 47,266,751     |
| 未払解約金           | 9,222,000      | 6,871,220      |
| その他未払費用         | -              | 981            |
| 流動負債合計          | 64,158,393     | 55,580,120     |
| 負債合計            | 64,158,393     | 55,580,120     |
| 純資産の部           |                |                |
| 元本等             |                |                |
| 元本              | 1              | 9,341,984,740  |
| 剰余金             |                |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 13,337,958,416 | 12,783,922,529 |
| 元本等合計           | 22,679,943,156 | 24,751,972,911 |
| 純資産合計           | 22,679,943,156 | 24,751,972,911 |
| 負債純資産合計         | 22,744,101,549 | 24,807,553,031 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 区 分                | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。<br/>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> |

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

| 区 分   | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
|---|----------------|----------------|
| 1. 1 期首                                       | 2018年6月16日     | 2019年6月18日     |
| 期首元本額   | 7,648,262,213円 | 9,341,984,740円 |
| 期中追加設定元本額                                     | 2,725,741,065円 | 5,262,156,766円 |
| 期中一部解約元本額                                     | 1,032,018,538円 | 2,636,091,124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<br>REITインデックス(為替<br>ヘッジあり)      | 4,497,284,850円 | 5,819,881,094円 |
| ダイワファンドラップ 外国<br>REITインデックス(為替<br>ヘッジなし)      | 686,878,821円   | 1,011,439,969円 |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国REITインデッ<br>クス(為替ヘッジあり) | 334,635,641円   | 361,708,622円   |
| ダイワファンドラップオンラ<br>イン 外国REITインデッ<br>クス(為替ヘッジなし) | 229,637,689円   | 265,959,373円   |
| D-I's グローバルREI<br>Tインデックス                     | 1,216,249円     | 2,318,298円     |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2050                        | 79,996円        | 1,315,316円     |
| iFree 外国REITイ<br>ンデックス                        | 83,862,326円    | 123,706,507円   |
| iFree 8資産バランス                                 | 710,450,097円   | 1,258,447,888円 |

|  |                |                 |
|--|----------------|-----------------|
| グローバル・リート・イン<br>デックスファンド(資産形成<br>型)        | - 円            | 6,556,810円      |
| グローバル・リート・イン<br>デックスファンド(毎月決算<br>型)        | - 円            | 8,697,140円      |
| DCダイワ・グローバルRE<br>ITインデックスファンド              | 1,995,608,217円 | 2,515,002,695円  |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2020                     | 2,943,144円     | 3,470,362円      |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2030                     | 5,830,872円     | 6,613,190円      |
| DCダイワ・ターゲットイ<br>ヤー2040                     | 1,473,077円     | 3,162,363円      |
| ダイワ・インデックスセレク<br>ト グローバルREIT               | 247,516,568円   | 251,500,581円    |
| ダイワ・ノーロード グロー<br>バルREITファンド                | 29,860,566円    | 50,417,933円     |
| ダイワ外国REITインデッ<br>クス(為替ヘッジあり)(ダ<br>イワSMA専用) | 294,668,334円   | 65,156,054円     |
| ダイワ外国REITインデッ<br>クス(為替ヘッジなし)(ダ<br>イワSMA専用) | 220,038,293円   | 212,696,187円    |
| 計  | 9,341,984,740円 | 11,968,050,382円 |
| 2. 期末日における受益権の総数                           | 9,341,984,740口 | 11,968,050,382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6月18日<br>至 2020年6月15日   |
|-----------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。 |

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 2020年6月15日現在   |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | <p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | <p>(1)有価証券<br/>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br/>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

|  |              |              |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--|--------------|--------------|

| 種 類      | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) | 当期間の損益に<br>含まれた評価差額(円) |
|----------|------------------------|------------------------|
| 投資信託受益証券 | 3,679,934              | 37,000,267             |
| 投資証券     | 1,672,277,308          | 5,278,779,365          |
| 合計       | 1,675,957,242          | 5,241,779,098          |

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(2018年12月1日から2019年6月17日まで、及び2019年12月3日から2020年6月15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6月17日 現在 |           |             |             | 2020年6月15日 現在 |           |             |             |
|-----------------|---------------|-----------|-------------|-------------|---------------|-----------|-------------|-------------|
|                 | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円)   | 評価損益<br>(円) |
|                 | (円)           | うち<br>1年超 |             |             | (円)           | うち<br>1年超 |             |             |
| 市場取引            |               |           |             |             |               |           |             |             |
| 不動産投信<br>指数先物取引 |               |           |             |             |               |           |             |             |
| 買 建             | 208,985,320   | -         | 217,708,695 | 8,723,375   | 668,355,950   | -         | 786,576,726 | 118,220,776 |
| 合計              | 208,985,320   | -         | 217,708,695 | 8,723,375   | 668,355,950   | -         | 786,576,726 | 118,220,776 |

#### (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6月17日 現在 |           |           |             | 2020年6月15日 現在 |           |           |             |
|-----|---------------|-----------|-----------|-------------|---------------|-----------|-----------|-------------|
|     | 契約額等          |           | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) | 契約額等          |           | 時価<br>(円) | 評価損益<br>(円) |
|     | (円)           | うち<br>1年超 |           |             | (円)           | うち<br>1年超 |           |             |
|     |               |           |           |             |               |           |           |             |

|             |             |   |             |         |             |   |             |           |
|-------------|-------------|---|-------------|---------|-------------|---|-------------|-----------|
| 市場取引以外の取引   |             |   |             |         |             |   |             |           |
| 為替予約取引      |             |   |             |         |             |   |             |           |
| 買建          | 133,244,999 | - | 133,635,275 | 390,276 | 417,170,856 | - | 416,757,800 | 413,056   |
| アメリカ・ドル     | 97,266,586  | - | 97,695,000  | 428,414 | 283,042,880 | - | 281,918,500 | 1,124,380 |
| イギリス・ポンド    | 8,257,836   | - | 8,200,200   | 57,636  | -           | - | -           | -         |
| オーストラリア・ドル  | 4,259,296   | - | 4,259,040   | 256     | 3,731,865   | - | 3,651,000   | 80,865    |
| カナダ・ドル      | 11,135,297  | - | 11,169,420  | 34,123  | -           | - | -           | -         |
| シンガポール・ドル   | 7,920,800   | - | 7,915,000   | 5,800   | -           | - | -           | -         |
| ニュージーランド・ドル | 1,419,360   | - | 1,410,800   | 8,560   | 2,010,873   | - | 2,060,700   | 49,827    |
| ユーロ         | 2,985,824   | - | 2,985,815   | 9       | 128,385,238 | - | 129,127,600 | 742,362   |
| 合計          | 133,244,999 | - | 133,635,275 | 390,276 | 417,170,856 | - | 416,757,800 | 413,056   |

## (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6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|--------------|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額    | 2.4277円      | 2.0682円      |
| (1万口当たり純資産額) | (24,277円)    | (20,682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<br>受益証券                | アメリカ・ドル | VANGUARD REAL ESTATE ETF     | 62,500.000 | アメリカ・ドル<br>5,039,375.000                  |    |
|                             | アメリカ・ドル | 小計                           |            | アメリカ・ドル<br>5,039,375.000<br>(540,422,575) |    |
| 投資信託受益証券 合計                 |         |                              |            | 540,422,575<br>[540,422,575]              |    |
| 投資証券                        | アメリカ・ドル | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST      | 26,300     | 392,396.000                               |    |
|                             |         | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP  | 13,700     | 48,361.000                                |    |
|                             |         | URBAN EDGE PROPERTIES        | 21,982     | 244,659.660                               |    |
|                             |         | XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 21,400     | 246,314.000                               |    |
|                             |         | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 27,600     | 4,519,500.000                             |    |
|                             |         | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 60,347     | 4,585,165.060                             |    |
|                             |         | BOSTON PROPERTIES INC        | 28,300     | 2,732,082.000                             |    |
|                             |         | APARTMENT INVT & MGMT CO -A  | 29,267     | 1,153,997.810                             |    |
|                             |         | VORNADO REALTY TRUST         | 31,164     | 1,251,857.880                             |    |
|                             |         | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 14,600     | 349,086.000                               |    |
|                             |         | NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 11,700     | 352,404.000                               |    |
|                             |         | NEXPOINT RESIDENTIAL         | 4,800      | 166,512.000                               |    |
|                             |         | QTS REALTY TRUST INC-CL A    | 11,400     | 710,676.000                               |    |
|                             |         | EQUITY RESIDENTIAL           | 68,900     | 4,379,973.000                             |    |
|                             |         | APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 43,800     | 492,312.000                               |    |
|                             |         | EPR PROPERTIES               | 16,100     | 591,836.000                               |    |
|                             |         | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH  | 3,500      | 29,400.000                                |    |
|                             |         | CITY OFFICE REIT INC         | 9,300      | 93,093.000                                |    |
|                             |         | GLOBAL NET LEASE INC         | 17,433     | 270,211.500                               |    |
|                             |         | EQUINIX INC                  | 17,400     | 11,773,536.000                            |    |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 13,829  | 319,726.480                  |            |   |    |
| CHATHAM LODGING TRUST       | 7,400   | 56,906.000                   |            |   |    |

|                              |         |               |  |
|------------------------------|---------|---------------|--|
| SERITAGE GROWTH PROP- A REIT | 7,100   | 98,761.000    |  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 11,300  | 423,750.000   |  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 22,700  | 261,050.000   |  |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 4,200   | 166,572.000   |  |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 4,113   | 16,534.260    |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 141,100 | 1,783,504.000 |  |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 50,108  | 1,360,432.200 |  |
| CORESITE REALTY CORP         | 8,100   | 966,735.000   |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 30,500  | 798,490.000   |  |
| RLJ LODGING TRUST            | 35,871  | 398,526.810   |  |
| FARMLAND PARTNERS INC        | 2,900   | 19,778.000    |  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST      | 38,800  | 685,984.000   |  |
| CYRUSONE INC                 | 22,300  | 1,622,102.000 |  |
| KIMCO REALTY CORP            | 83,000  | 1,142,080.000 |  |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 7,000   | 82,950.000    |  |
| HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A | 40,750  | 1,107,177.500 |  |
| WHITESTONE REIT              | 8,500   | 61,965.000    |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 40,100  | 1,535,028.000 |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 25,400  | 441,706.000   |  |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | 47,480  | 550,293.200   |  |
| COLONY CAPITAL INC           | 93,511  | 257,155.250   |  |
| INVITATION HOMES INC         | 105,897 | 2,930,169.990 |  |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 23,232  | 715,080.960   |  |
| CLIPPER REALTY INC           | 1,400   | 10,444.000    |  |
| GLADSTONE LAND CORP          | 2,500   | 38,375.000    |  |
| AMERICOLD REALTY TRUST       | 37,700  | 1,312,337.000 |  |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 12,300  | 245,385.000   |  |
| VICI PROPERTIES INC          | 90,700  | 2,021,703.000 |  |
| RETAIL VALUE INC             | 2,815   | 37,974.350    |  |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A | 12,500  | 147,250.000   |  |
| BRT APARTMENTS CORP          | 1,300   | 14,872.000    |  |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP  | 10,100  | 81,810.000    |  |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 3,400   | 306,306.000   |  |
| SAFEHOLD INC                 | 2,600   | 159,250.000   |  |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC   | 29,960  | 31,757.600    |  |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC   | 22,400  | 190,400.000   |  |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 17,500  | 300,125.000   |  |
| CORECIVIC INC                | 25,224  | 312,273.120   |  |
| COREPOINT LODGING INC        | 6,700   | 27,403.000    |  |

|                              |         |                |  |
|------------------------------|---------|----------------|--|
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 3,400   | 49,062.000     |  |
| STORE CAPITAL CORP           | 43,500  | 1,024,425.000  |  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC  | 22,400  | 162,848.000    |  |
| LIFE STORAGE INC             | 9,200   | 887,340.000    |  |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC    | 10,100  | 302,495.000    |  |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 20,082  | 226,725.780    |  |
| PREFERRED APARTMENT COMMUN-A | 9,200   | 73,232.000     |  |
| PARAMOUNT GROUP INC          | 40,700  | 327,228.000    |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A  | 29,200  | 209,656.000    |  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 23,300  | 955,067.000    |  |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC  | 23,700  | 328,482.000    |  |
| STAG INDUSTRIAL INC          | 29,200  | 807,964.000    |  |
| VENTAS INC                   | 73,279  | 2,887,925.390  |  |
| CARETRUST REIT INC           | 19,603  | 367,948.310    |  |
| GEO GROUP INC/THE            | 24,100  | 306,070.000    |  |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC   | 60,800  | 817,760.000    |  |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 10,600  | 296,959.000    |  |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC   | 42,487  | 623,709.160    |  |
| UMH PROPERTIES INC           | 5,600   | 71,848.000     |  |
| IRON MOUNTAIN INC            | 56,500  | 1,571,830.000  |  |
| TERRENO REALTY CORP          | 13,200  | 690,624.000    |  |
| VEREIT INC                   | 210,008 | 1,367,152.080  |  |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC    | 19,620  | 681,206.400    |  |
| SUN COMMUNITIES INC          | 18,200  | 2,519,426.000  |  |
| ACADIA REALTY TRUST          | 17,011  | 241,215.980    |  |
| ALEXANDER'S INC              | 400     | 103,308.000    |  |
| PROLOGIS INC                 | 147,019 | 13,887,414.740 |  |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 24,200  | 3,854,334.000  |  |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 34,700  | 373,025.000    |  |
| SAUL CENTERS INC             | 2,400   | 82,752.000     |  |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 22,945  | 7,638.390      |  |
| MACK-CALI REALTY CORP        | 17,700  | 291,165.000    |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 19,000  | 1,810,890.000  |  |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 28,906  | 926,726.360    |  |
| SITE CENTERS CORP            | 31,878  | 256,299.120    |  |
| DUKE REALTY CORP             | 72,300  | 2,555,805.000  |  |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 7,600   | 911,316.000    |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 12,967  | 3,237,600.560  |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 25,000  | 976,750.000    |  |

|                              |        |               |  |
|------------------------------|--------|---------------|--|
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 13,800 | 1,248,486.000 |  |
| GETTY REALTY CORP            | 7,703  | 226,468.200   |  |
| WELLTOWER INC                | 80,000 | 4,419,200.000 |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 97,400 | 2,676,552.000 |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 20,400 | 803,964.000   |  |
| SERVICE PROPERTIES TRUST     | 31,700 | 310,343.000   |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 26,300 | 813,985.000   |  |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 23,975 | 793,812.250   |  |
| KILROY REALTY CORP           | 19,200 | 1,213,440.000 |  |
| LTC PROPERTIES INC           | 8,400  | 316,008.000   |  |
| LEXINGTON REALTY TRUST       | 48,800 | 499,712.000   |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 22,428 | 2,670,726.240 |  |
| MACERICH CO/THE              | 21,979 | 214,515.040   |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 35,800 | 2,272,942.000 |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 8,800  | 520,872.000   |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES   | 33,800 | 1,204,632.000 |  |
| REALTY INCOME CORP           | 67,517 | 4,080,052.310 |  |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES  | 22,000 | 566,940.000   |  |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST  | 8,600  | 12,986.000    |  |
| PUBLIC STORAGE               | 29,800 | 5,854,806.000 |  |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA     | 3,900  | 515,190.000   |  |
| REGENCY CENTERS CORP         | 33,020 | 1,581,327.800 |  |
| RPT REALTY                   | 17,800 | 131,008.000   |  |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 17,600 | 135,872.000   |  |
| SL GREEN REALTY CORP         | 16,000 | 835,200.000   |  |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 49,000 | 220,745.000   |  |
| TAUBMAN CENTERS INC          | 12,000 | 444,960.000   |  |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A     | 6,000  | 78,000.000    |  |
| UDR INC                      | 57,600 | 2,251,584.000 |  |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 2,600  | 237,172.000   |  |
| WP CAREY INC                 | 33,900 | 2,342,829.000 |  |
| WASHINGTON REIT              | 15,900 | 366,972.000   |  |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS  | 23,800 | 481,950.000   |  |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 11,300 | 10,170.000    |  |
| AGREE REALTY CORP            | 9,900  | 658,449.000   |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 42,948 | 1,300,894.920 |  |
| CUBESMART                    | 38,100 | 1,058,037.000 |  |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 45,526 | 444,333.760   |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 52,178 | 7,096,208.000 |  |

|  |                              |         |  |  |
|--|------------------------------|---------|--|--|
|  | CEDAR REALTY TRUST INC       | 10,800  | 13,284.000                                     |  |
|  | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 25,500  | 2,466,105.000                                  |  |
|  | HERSHA HOSPITALITY TRUST     | 7,875   | 57,566.250                                     |  |
|  | INVESTORS REAL ESTATE TRUST  | 2,060   | 147,599.000                                    |  |
|  | KITE REALTY GROUP TRUST      | 15,650  | 188,113.000                                    |  |
|  | MONMOUTH REAL ESTATE INV COR | 21,000  | 282,870.000                                    |  |
|  | ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 2,200   | 39,358.000                                     |  |
|  | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES  | 27,000  | 978,750.000                                    |  |
|  | GLADSTONE COMMERCIAL CORP    | 6,300   | 114,786.000                                    |  |
|  | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO   | 42,342  | 272,259.060                                    |  |
|  | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 101,800 | 1,972,884.000                                  |  |
|  | FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 21,000  | 112,560.000                                    |  |
|  | DOUGLAS EMMETT INC           | 32,400  | 1,006,668.000                                  |  |
|  | RETAIL PROPERTIES OF AME - A | 40,200  | 271,752.000                                    |  |
|  | MANULIFE US REAL ESTATE INV  | 279,462 | 210,993.810                                    |  |
|  | ARA US HOSPITALITY TRUST     | 87,800  | 36,437.000                                     |  |
|  | EAGLE HOSPITALITY TRUST      | 90,000  | 12,330.000                                     |  |
|  | PRIME US REIT                | 99,000  | 77,715.000                                     |  |
|  | アメリカ・ドル 小計                   |         | アメリカ・ドル<br>163,670,093.540<br>(17,551,980,832) |  |
|  | イギリス・ポンド                     |         | イギリス・ポンド                                       |  |
|  | ASSURA PLC                   | 467,550 | 375,910.200                                    |  |
|  | CAPITAL & REGIONAL PLC       | 10,000  | 10,300.000                                     |  |
|  | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 129,570 | 76,575.870                                     |  |
|  | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT  | 177,710 | 115,156.080                                    |  |
|  | PICTON PROPERTY INCOME LTD   | 121,110 | 82,960.350                                     |  |
|  | REGIONAL REIT LTD            | 81,310  | 64,397.520                                     |  |
|  | NEWRIVER REIT PLC            | 69,330  | 46,520.430                                     |  |
|  | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE | 166,290 | 279,866.070                                    |  |
|  | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC   | 135,490 | 146,058.220                                    |  |
|  | LXI REIT PLC                 | 94,038  | 104,758.330                                    |  |
|  | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING  | 75,200  | 71,440.000                                     |  |
|  | AEW UK REIT PLC              | 25,610  | 17,158.700                                     |  |
|  | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS | 150,000 | 113,250.000                                    |  |
|  | RDI REIT PLC                 | 41,036  | 31,597.720                                     |  |
|  | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 150,491 | 932,442.230                                    |  |
|  | SEGRO PLC                    | 217,460 | 1,895,381.360                                  |  |

|                |                              |           |  |  |
|----------------|------------------------------|-----------|--|--|
|                | HAMMERSON PLC                | 159,920   | 177,031.440                                  |  |
|                | UNITE GROUP PLC/THE          | 73,160    | 670,145.600                                  |  |
|                | BRITISH LAND CO PLC          | 188,770   | 779,431.330                                  |  |
|                | GREAT PORTLAND ESTATES PLC   | 49,381    | 323,544.310                                  |  |
|                | INTU PROPERTIES PLC          | 145,670   | 10,815.990                                   |  |
|                | DERWENT LONDON PLC           | 21,190    | 636,971.400                                  |  |
|                | PRIMARY HEALTH PROPERTIES    | 236,370   | 361,173.360                                  |  |
|                | WORKSPACE GROUP PLC          | 26,460    | 183,764.700                                  |  |
|                | SAFESTORE HOLDINGS PLC       | 40,730    | 284,091.750                                  |  |
|                | SHAFTESBURY PLC              | 43,050    | 251,196.750                                  |  |
|                | BIG YELLOW GROUP PLC         | 30,170    | 302,001.700                                  |  |
|                | LONDONMETRIC PROPERTY PLC    | 171,340   | 354,331.120                                  |  |
|                | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 121,600   | 41,404.800                                   |  |
|                | TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 332,260   | 461,841.400                                  |  |
| イギリス・ボンド 小計    |                              |           | イギリス・ボンド<br>9,201,518.730<br>(1,234,291,723) |  |
| イスラエル・<br>シュケル | REIT 1 LTD                   | 28,840    | イスラエル・シュケル<br>413,565.600                    |  |
| イスラエル・シュケル 小計  |                              |           | イスラエル・シュケル<br>413,565.600<br>(12,758,499)    |  |
| オーストラリ<br>ア・ドル |                              |           | オーストラリア・ドル                                   |  |
|                | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 47,520    | 114,048.000                                  |  |
|                | CROMWELL PROPERTY GROUP      | 396,284   | 336,841.400                                  |  |
|                | RURAL FUNDS GROUP            | 78,595    | 156,404.050                                  |  |
|                | WAYPOINT REIT                | 143,830   | 384,026.100                                  |  |
|                | CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 89,168    | 395,014.240                                  |  |
|                | CENTURIA OFFICE REIT         | 84,950    | 164,378.250                                  |  |
|                | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 222,860   | 514,806.600                                  |  |
|                | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 57,547    | 180,697.580                                  |  |
|                | NATIONAL STORAGE REIT        | 206,195   | 382,491.720                                  |  |
|                | APN INDUSTRIA REIT           | 29,760    | 75,292.800                                   |  |
|                | GDI PROPERTY GROUP           | 123,310   | 140,573.400                                  |  |
|                | SCENTRE GROUP                | 1,111,440 | 2,545,197.600                                |  |
|                | ARENA REIT                   | 59,890    | 138,345.900                                  |  |
|                | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 38,300    | 103,793.000                                  |  |
|                | BWP TRUST                    | 105,550   | 402,145.500                                  |  |

|        |                              |         |   |  |
|--------|------------------------------|---------|---|--|
|        | DEXUS                        | 226,310 | 2,181,628.400                                   |  |
|        | GPT GROUP                    | 393,130 | 1,678,665.100                                   |  |
|        | CHARTER HALL RETAIL REIT     | 95,400  | 322,452.000                                     |  |
|        | MIRVAC GROUP                 | 832,570 | 1,964,865.200                                   |  |
|        | STOCKLAND                    | 496,760 | 1,793,303.600                                   |  |
|        | ABACUS PROPERTY GROUP        | 81,120  | 213,345.600                                     |  |
|        | GOODMAN GROUP                | 333,730 | 4,925,854.800                                   |  |
|        | VICINITY CENTRES             | 850,710 | 1,344,121.800                                   |  |
|        | CHARTER HALL GROUP           | 94,460  | 909,649.800                                     |  |
|        | INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 45,220  | 193,089.400                                     |  |
|        | オーストラリア・ドル 小計                |         | オーストラリア・ドル<br>21,561,031.840<br>(1,575,248,987) |  |
| カナダ・ドル |                              |         | カナダ・ドル  |  |
|        | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 13,100  | 104,276.000                                     |  |
|        | SLATE RETAIL REIT - U        | 3,100   | 31,527.000                                      |  |
|        | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 10,200  | 181,866.000                                     |  |
|        | SLATE OFFICE REIT            | 5,100   | 19,482.000                                      |  |
|        | MINTO APARTMENT REAL ESTATE  | 4,200   | 88,830.000                                      |  |
|        | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 15,200  | 166,440.000                                     |  |
|        | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 14,700  | 168,315.000                                     |  |
|        | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 11,200  | 63,728.000                                      |  |
|        | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 6,200   | 413,912.000                                     |  |
|        | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 14,900  | 160,622.000                                     |  |
|        | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 13,500  | 196,425.000                                     |  |
|        | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 22,200  | 326,118.000                                     |  |
|        | CHOICE PROPERTIES REIT       | 31,000  | 399,280.000                                     |  |
|        | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 4,200   | 64,680.000                                      |  |
|        | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 11,900  | 162,435.000                                     |  |
|        | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 14,300  | 309,881.000                                     |  |
|        | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 17,800  | 873,802.000                                     |  |
|        | COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 16,790  | 138,181.700                                     |  |
|        | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 28,566  | 303,656.580                                     |  |
|        | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 31,700  | 528,122.000                                     |  |
|        | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 5,400   | 114,858.000                                     |  |
|        | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 4,700   | 140,060.000                                     |  |
|        | NORTHVIEW APARTMENT REAL EST | 7,400   | 256,040.000                                     |  |
|        | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 9,500   | 123,785.000                                     |  |
|        | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 12,300  | 515,862.000                                     |  |

|             |                               |         |  |
|-------------|-------------------------------|---------|--|
| カナダ・ドル      | 小計                            |         | カナダ・ドル<br>5,852,184.280<br>(460,332,816)     |
| シンガポール・ドル   |                               |         | シンガポール・ドル                                    |
|             | KEPPEL DC REIT                | 249,483 | 611,233.350                                  |
|             | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST  | 126,200 | 88,340.000                                   |
|             | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC  | 455,000 | 432,250.000                                  |
|             | AIMS APAC REIT                | 89,000  | 110,360.000                                  |
|             | FRASERS HOSPITALITY TRUST     | 121,800 | 59,682.000                                   |
|             | FRASERS LOGISTICS & COMMERC I | 515,890 | 593,273.500                                  |
|             | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME  | 86,000  | 65,790.000                                   |
|             | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST   | 582,475 | 1,025,156.000                                |
|             | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT  | 626,516 | 1,942,199.600                                |
|             | CAPITALAND MALL TRUST         | 599,500 | 1,228,975.000                                |
|             | SUNTEC REIT                   | 474,300 | 697,221.000                                  |
|             | MAPLETREE LOGISTICS TRUST     | 634,000 | 1,198,260.000                                |
|             | KEPPEL REIT                   | 388,400 | 446,660.000                                  |
|             | ASCOTT RESIDENCE TRUST        | 377,456 | 388,779.680                                  |
|             | ESR-REIT                      | 459,902 | 183,960.800                                  |
|             | CDL HOSPITALITY TRUSTS        | 161,600 | 179,376.000                                  |
|             | FRASERS CENTREPOINT TRUST     | 148,168 | 354,121.520                                  |
|             | STARHILL GLOBAL REIT          | 308,800 | 165,208.000                                  |
|             | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS  | 149,396 | 198,696.680                                  |
|             | PARKWAYLIFE REAL ESTATE       | 86,300  | 292,557.000                                  |
|             | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL  | 467,200 | 66,809.600                                   |
|             | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST    | 309,780 | 830,210.400                                  |
|             | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST     | 244,500 | 129,585.000                                  |
|             | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST    | 438,484 | 894,507.360                                  |
|             | FAR EAST HOSPITALITY TRUST    | 182,100 | 96,513.000                                   |
|             | SPH REIT                      | 166,600 | 144,942.000                                  |
|             | SOILBUILD BUSINESS SPACE REI  | 202,100 | 77,808.500                                   |
|             | SABANA SHARIAH COMP IND REIT  | 219,400 | 78,984.000                                   |
|             | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I  | 541,063 | 216,425.200                                  |
| シンガポール・ドル   | 小計                            |         | シンガポール・ドル<br>12,797,885.190<br>(983,645,456) |
| ニュージーランド・ドル |                               |         | ニュージーランド・ドル                                  |
|             | ARGOSY PROPERTY LTD           | 158,520 | 183,883.200                                  |

|                              |                              |             |   |     |
|------------------------------|------------------------------|-------------|---|-----|
|                              | KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 320,920     | 328,943.000                                   |     |
|                              | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 76,800      | 195,072.000                                   |     |
|                              | GOODMAN PROPERTY TRUST       | 226,220     | 472,799.800                                   |     |
|                              | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL | 219,820     | 357,207.500                                   |     |
| ニュージーランド・ドル 小計               |                              |             | ニュージーランド・ドル<br>1,537,905.500<br>(105,715,624) |     |
| ユーロ                          | ALSTRIA OFFICE REIT-AG       | 27,210      | 368,423.400                                   | ユーロ |
|                              | HAMBORNER REIT AG            | 11,980      | 102,692.560                                   |     |
|                              | WERELDHAVE NV                | 6,470       | 53,603.950                                    |     |
|                              | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 24,530      | 1,406,550.200                                 |     |
|                              | EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV   | 8,230       | 106,002.400                                   |     |
|                              | NSI NV                       | 3,231       | 118,254.600                                   |     |
|                              | VASTNED RETAIL NV            | 3,750       | 75,000.000                                    |     |
|                              | ICADE                        | 4,850       | 317,675.000                                   |     |
|                              | ALTAREA                      | 740         | 104,192.000                                   |     |
|                              | GECINA SA                    | 9,471       | 1,104,318.600                                 |     |
|                              | KLEPIERRE                    | 37,560      | 691,291.800                                   |     |
|                              | COVIVIO                      | 7,662       | 501,094.800                                   |     |
|                              | MERCIALYS                    | 4,030       | 32,240.000                                    |     |
|                              | AEDIFICA                     | 4,744       | 459,693.600                                   |     |
|                              | COFINIMMO                    | 4,240       | 528,304.000                                   |     |
|                              | BEFIMMO                      | 4,420       | 177,905.000                                   |     |
|                              | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 4,610       | 105,108.000                                   |     |
|                              | RETAIL ESTATES               | 1,940       | 113,878.000                                   |     |
|                              | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 23,340      | 573,347.100                                   |     |
|                              | MONTEA                       | 2,150       | 191,350.000                                   |     |
|                              | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 6,240       | 21,372.000                                    |     |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 10,530                       | 51,544.350  |   |     |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 42,053                       | 343,783.270 |   |     |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA  | 66,100                       | 532,105.000 |   |     |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 82,050                       | 112,244.400 |   |     |
| HIBERNIA REIT PLC            | 116,240                      | 125,306.720 |   |     |
| ユーロ 小計                       |                              |             | ユーロ<br>8,317,280.750<br>(1,003,729,441)       |     |
| 韓国・ウォン                       | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD    | 6,000       | 韓国・ウォン<br>40,500,000.000                      |     |
| 韓国・ウォン 小計                    |                              |             | 韓国・ウォン  |     |

|          |                              |         |                  |  |
|----------|------------------------------|---------|------------------|--|
|          |                              |         | 40,500,000.000   |  |
|          |                              |         | (3,596,400)      |  |
| 香港・ドル    |                              |         | 香港・ドル            |  |
|          | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 287,000 | 1,024,590.000    |  |
|          | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST  | 193,000 | 758,490.000      |  |
|          | FORTUNE REIT                 | 311,000 | 2,145,900.000    |  |
|          | PROSPERITY REIT              | 300,000 | 684,000.000      |  |
|          | LINK REIT                    | 436,400 | 29,282,440.000   |  |
|          | CHAMPION REIT                | 431,000 | 1,762,790.000    |  |
| 香港・ドル 小計 |                              |         | 香港・ドル            |  |
|          |                              |         | 35,658,210.000   |  |
|          |                              |         | (493,509,626)    |  |
| 投資証券 合計  |                              |         | 23,424,809,404   |  |
|          |                              |         | [23,424,809,404] |  |
| 合計       |                              |         | 23,965,231,979   |  |
|          |                              |         | [23,965,231,979] |  |

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

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

| 通貨          | 銘柄数                                  | 組入<br>投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入<br>投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|-------------|--------------------------------------|----------------------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル     | 投資信託<br>受益証券<br>1銘柄<br>投資証券<br>157銘柄 | 3.0%                       | 97.0%              | 75.4%          |
| イギリス・ポンド    | 投資証券<br>30銘柄                         | -%                         | 100%               | 5.2%           |
| イスラエル・シケル   | 投資証券<br>1銘柄                          | -%                         | 100%               | 0.1%           |
| オーストラリア・ドル  | 投資証券<br>25銘柄                         | -%                         | 100%               | 6.6%           |
| カナダ・ドル      | 投資証券<br>25銘柄                         | -%                         | 100%               | 1.9%           |
| シンガポール・ドル   | 投資証券<br>29銘柄                         | -%                         | 100%               | 4.1%           |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券<br>5銘柄                          | -%                         | 100%               | 0.4%           |
| ユーロ         | 投資証券<br>26銘柄                         | -%                         | 100%               | 4.2%           |
| 韓国・ウォン      | 投資証券<br>1銘柄                          | -%                         | 100%               | 0.0%           |
| 香港・ドル       | 投資証券<br>6銘柄                          | -%                         | 100%               | 2.1%           |

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年6月18日から2020年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

|                 | 第3期<br>2019年6月17日現在 | 第4期<br>2020年6月15日現在 |
|-----------------|---------------------|---------------------|
| <b>資産の部</b>     |                     |                     |
| 流動資産            |                     |                     |
| コール・ローン         | 4,709,600           | 5,714,339           |
| 親投資信託受益証券       | 1,667,535,713       | 2,091,860,143       |
| 未収入金            | 57,000              | 542,000             |
| 流動資産合計          | 1,672,302,313       | 2,098,116,482       |
| 資産合計            | 1,672,302,313       | 2,098,116,482       |
| <b>負債の部</b>     |                     |                     |
| 流動負債            |                     |                     |
| 未払解約金           | 1,393,062           | 1,892,692           |
| 未払受託者報酬         | 160,288             | 214,250             |
| 未払委託者報酬         | 3,006,396           | 4,018,166           |
| その他未払費用         | 40,404              | 53,512              |
| 流動負債合計          | 4,600,150           | 6,178,620           |
| 負債合計            | 4,600,150           | 6,178,620           |
| <b>純資産の部</b>    |                     |                     |
| 元本等             |                     |                     |
| 元本              | 1,397,806,976       | 2,067,091,677       |
| 剰余金             |                     |                     |
| 期末剰余金又は期末欠損金( ) | 269,895,187         | 24,846,185          |
| (分配準備積立金)       | 146,911,049         | 116,515,068         |
| 元本等合計           | 1,667,702,163       | 2,091,937,862       |
| 純資産合計           | 1,667,702,163       | 2,091,937,862       |
| 負債純資産合計         | 1,672,302,313       | 2,098,116,482       |

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

|   | 第3期                          |             | 第4期                          |             |
|---|------------------------------|-------------|------------------------------|-------------|
|   | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 |             | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |             |
| 営業収益                                      |                              |             |                              |             |
| 受取利息                                      |                              | -           |                              | 10          |
| 有価証券売買等損益                                 |                              | 138,406,467 |                              | 308,288,570 |
| その他収益                                     |                              | 4,269       |                              | -           |
| 営業収益合計                                    |                              | 138,410,736 |                              | 308,288,560 |
| 営業費用                                      |                              |             |                              |             |
| 支払利息                                      |                              | 2,306       |                              | 1,493       |
| 受託者報酬                                     |                              | 302,336     |                              | 408,668     |
| 委託者報酬                                     |                              | 5,670,404   |                              | 7,664,237   |
| その他費用                                     |                              | 75,571      |                              | 102,544     |
| 営業費用合計                                    |                              | 6,050,617   |                              | 8,176,942   |
| 営業利益又は営業損失( )                             |                              | 132,360,119 |                              | 316,465,502 |
| 経常利益又は経常損失( )                             |                              | 132,360,119 |                              | 316,465,502 |
| 当期純利益又は当期純損失( )                           |                              | 132,360,119 |                              | 316,465,502 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( ) |                              | 12,601,767  |                              | 12,177,674  |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )                           |                              | 94,605,099  |                              | 269,895,187 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |                              | 81,446,671  |                              | 130,069,336 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |                              | 81,446,671  |                              | 130,069,336 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |                              | 25,914,935  |                              | 70,830,510  |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |                              | 25,914,935  |                              | 70,830,510  |
| 分配金                                       |                              | 1 -         |                              | 1 -         |
| 期末剰余金又は期末欠損金( )                           |                              | 269,895,187 |                              | 24,846,185  |

## (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4期   |              |
|----------------------------|---|--------------|
|                            | 自 2019年6月18日  | 至 2020年6月15日 |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法         | 親投資信託受益証券<br><br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。      |              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間末日<br><br>2019年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年6月17日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |              |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分                 | 第3期            | 第4期            |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2019年6月17日現在   | 2020年6月15日現在   |
| 1. 1 期首元本額          | 1,094,522,792円 | 1,397,806,976円 |
| 期中追加設定元本額           | 579,621,490円   | 1,036,279,306円 |
| 期中一部解約元本額           | 276,337,306円   | 366,994,605円   |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 1,397,806,976口 | 2,067,091,677口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区 分 | 第3期                          | 第4期                          |
|-----|------------------------------|------------------------------|
|     | 自 2018年6月16日<br>至 2019年6月17日 | 自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日 |

|            |  |   |
|------------|--|---|
| 1 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(2,111円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(119,755,520円)、投資信託約款に規定される収益調整金(122,984,138円)及び分配準備積立金(27,153,418円)より分配対象額は269,895,187円(1万口当たり1,930.85円)であり、分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(164,156,489円)及び分配準備積立金(116,515,068円)より分配対象額は280,671,557円(1万口当たり1,357.81円)であり、分配を行っておりません。</p> |
|------------|--|---|

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

| 区 分                        | 第4期<br>自 2019年6月18日<br>至 2020年6月15日  |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針            | <p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>  |
| 2. 金融商品の内容及びリスク            | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制          | <p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>  |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>  |

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分                      | 第4期   |
|--------------------------|---|
|                          | 2020年6月15日現在  |
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 金融商品の時価の算定方法          | (1)有価証券<br>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

| 種 類       | 第3期                  | 第4期                  |
|-----------|----------------------|----------------------|
|           | 2019年6月17日現在         | 2020年6月15日現在         |
|           | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 親投資信託受益証券 | 133,605,371          | 302,114,140          |
| 合計        | 133,605,371          | 302,114,140          |

## （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3期          | 第4期          |
|--------------|--------------|
| 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
| 該当事項はありません。  | 該当事項はありません。  |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第4期   |
|---|
| 自 2019年6月18日  |
| 至 2020年6月15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3期          | 第4期          |
|--|--------------|--------------|
|  | 2019年6月17日現在 | 2020年6月15日現在 |
|  |              |              |

|                           |                      |                      |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.1931円<br>(11,931円) | 1.0120円<br>(10,120円) |
|---------------------------|----------------------|----------------------|

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

| 種 類          | 銘 柄                         | 券面総額          | 評価額<br>(円)    | 備考 |
|--------------|-----------------------------|---------------|---------------|----|
| 親投資信託受益証券    | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 1,011,439,969 | 2,091,860,143 |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                             |               | 2,091,860,143 |    |
| 合計           |                             |               | 2,091,860,143 |    |

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

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

## 2 【ファンドの現況】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

## 【純資産額計算書】

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 11,472,394,252円 |
| 負債総額            | 5,730,382円      |
| 純資産総額( - )      | 11,466,663,870円 |
| 発行済数量           | 9,181,835,299口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.2488円         |

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 167,520,023,701円 |
| 負債総額            | 21,231,287,526円  |
| 純資産総額( - )      | 146,288,736,175円 |
| 発行済数量           | 142,060,889,074口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.0298円          |

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 11,615,008,632円 |
| 負債総額            | 1,913,500円      |
| 純資産総額( - )      | 11,613,095,132円 |
| 発行済数量           | 8,148,974,195口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.4251円         |

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 184,192,003,544円 |
| 負債総額            | 19,000,312,245円  |
| 純資産総額( - )      | 165,191,691,299円 |
| 発行済数量           | 57,917,841,533口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.8522円          |

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 43,004,462,270円 |
| 負債総額            | 59,749,114円     |
| 純資産総額( - )      | 42,944,713,156円 |
| 発行済数量           | 33,178,178,682口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.2944円         |

(参考) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 55,429,131,626円 |
| 負債総額            | 229,828,701円    |
| 純資産総額( - )      | 55,199,302,925円 |
| 発行済数量           | 27,674,488,513口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.9946円         |

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 5,879,554,283円 |
| 負債総額            | 9,123,222円     |
| 純資産総額( - )      | 5,870,431,061円 |
| 発行済数量           | 4,070,994,246口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.4420円        |

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 132,359,198,705円 |
| 負債総額            | 152,248,171円     |
| 純資産総額( - )      | 132,206,950,534円 |
| 発行済数量           | 51,053,723,244口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.5896円          |

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

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 1,825,492,783円 |
| 負債総額            | 346,711円       |
| 純資産総額( - )      | 1,825,146,072円 |
| 発行済数量           | 1,330,338,863口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.3719円        |

## (参考) 外国株式インデックスマザーファンド

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

## (参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 8,806,535,512円 |
| 負債総額            | 20,878,186円    |
| 純資産総額( - )      | 8,785,657,326円 |
| 発行済数量           | 6,590,512,441口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.3331円        |

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 33,314,479,423円 |
| 負債総額            | 32,806,856円     |
| 純資産総額( - )      | 33,281,672,567円 |
| 発行済数量           | 33,326,680,491口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 0.9986円         |

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 98,290,125,303円 |
| 負債総額            | 3,205,060円      |
| 純資産総額( - )      | 98,286,920,243円 |
| 発行済数量           | 69,383,023,460口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.4166円         |

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 88,783,699,124円 |
| 負債総額            | 151,444,862円    |
| 純資産総額( - )      | 88,632,254,262円 |
| 発行済数量           | 84,356,581,351口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.0507円         |

(参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 115,392,964,492円 |
| 負債総額            | 715,356,929円     |
| 純資産総額( - )      | 114,677,607,563円 |
| 発行済数量           | 107,463,631,395口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.0671円          |

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 5,095,505,679円 |
| 負債総額            | 11,459,848円    |
| 純資産総額( - )      | 5,084,045,831円 |
| 発行済数量           | 4,353,891,147口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.1677円        |

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 198,419,722,878円 |
| 負債総額            | 852,839,338円     |
| 純資産総額( - )      | 197,566,883,540円 |
| 発行済数量           | 66,198,223,430口  |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.9845円          |

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

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 1,727,214,789円 |
| 負債総額            | 306,886円       |
| 純資産総額( - )      | 1,726,907,903円 |
| 発行済数量           | 1,491,934,577口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.1575円        |

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

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

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 15,850,397,036円 |
| 負債総額            | 24,462,641円     |
| 純資産総額( - )      | 15,825,934,395円 |
| 発行済数量           | 11,793,274,623口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.3419円         |

ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 4,225,928,243円 |
| 負債総額            | 5,096,860円     |
| 純資産総額( - )      | 4,220,831,383円 |
| 発行済数量           | 4,002,784,857口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 1.0545円        |

## (参考) ダイワ J - R E I Tマザーファンド

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 資産総額            | 338,226,094,253円 |
| 負債総額            | 1,837,636,418円   |
| 純資産総額( - )      | 336,388,457,835円 |
| 発行済数量           | 128,716,096,246口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.6134円          |

ダイワファンドラップ 外国 R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 11,804,216,250円 |
| 負債総額            | 46,628,047円     |
| 純資産総額( - )      | 11,757,588,203円 |
| 発行済数量           | 13,326,065,204口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 0.8823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6月30日

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額            | 24,415,223,799円 |
| 負債総額            | 154,833,390円    |
| 純資産総額( - )      | 24,260,390,409円 |
| 発行済数量           | 12,067,110,119口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 2.0105円         |

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

## 純資産額計算書

2020年6月30日

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産総額            | 2,065,495,531円 |
| 負債総額            | 3,230,370円     |
| 純資産総額( - )      | 2,062,265,161円 |
| 発行済数量           | 2,096,628,973口 |
| 1単位当たり純資産額( / ) | 0.9836円        |

## (参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)」の記載と同じ。

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2020年6月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

| 基本的性格      | 本数（本） | 純資産額の合計額（百万円） |
|------------|-------|---------------|
| 単位型株式投資信託  | 51    | 85,644        |
| 追加型株式投資信託  | 697   | 16,490,066    |
| 株式投資信託 合計  | 748   | 16,575,710    |
| 単位型公社債投資信託 | 28    | 93,923        |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 1,453,222     |
| 公社債投資信託 合計 | 42    | 1,547,145     |
| 総合計        | 790   | 18,122,855    |

## 3 【委託会社等の経理状況】

- 1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（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<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(2020年3月31日) |
|-------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>資産の部</b> |                       |                       |
| <b>流動資産</b> |                       |                       |
| 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                |
| <b>固定資産</b> |                       |                       |
| 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<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(2020年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>負債の部</b>  |                       |                       |
| <b>流動負債</b>  |                       |                       |
| 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                |
| <b>固定負債</b>  |                       |                       |
| 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                |
| <b>純資産の部</b> |                       |                       |
| <b>株主資本</b>  |                       |                       |
| 資本金          | 15,174                | 15,174                |
| 資本剰余金        |                       |                       |
| 資本準備金        | 11,495                | 11,495                |
| 資本剰余金合計      | 11,495                | 11,495                |
| 利益剰余金        |                       |                       |
| 利益準備金        | 374                   | 374                   |
| その他利益剰余金     |                       |                       |
| 繰越利益剰余金      | 13,052                | 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<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>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<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31<br>日) | 当事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>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<br>剰余金 | 利益剰余金<br>合計 |        |
|                             |        |        |       | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>証券評価<br>差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>剰余金 | 利益剰余金<br>合計 |        |
|       |        |        |       | 繰越利益<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>証券評価<br>差額金 | 評価・換算<br>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<br>項目の当期変動<br>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<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>株式数 |
|-------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 発行済株式 |                |                |                |               |
| 普通株式  | 2,608          | -              | -              | 2,608         |
| 合計    | 2,608          | -              | -              | 2,608         |

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

| 決議                   | 株式の種類 | 剰余金の配当の<br>総額(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 2018年6月25日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 12,669             | 4,857           | 2018年<br>3月31日 | 2018年<br>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<br>株式数 | 当事業年度<br>増加株式数 | 当事業年度<br>減少株式数 | 当事業年度末<br>株式数 |
|-------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 発行済株式 |                |                |                |               |
| 普通株式  | 2,608          | -              | -              | 2,608         |
| 合計    | 2,608          | -              | -              | 2,608         |

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

| 決議                   | 株式の種類 | 剰余金の配当の<br>総額(百万円) | 1株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|--------------------|-----------------|----------------|----------------|
| 2019年6月21日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 11,868             | 4,550           | 2019年<br>3月31日 | 2019年<br>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<br>その他有価証券 |       | 8,380    | 8,380    | -  |
| 資産計                         |       | 48,338   | 48,338   | -  |
| (1) 未払手数料                   |       | (4,610)  | (4,610)  | -  |
| (2) その他未払金                  |       | (3,882)  | (3,882)  | -  |
| (3) 未払費用(*2)                |       | (2,805)  | (2,805)  | -  |
| 負債計                         |       | (11,298) | (11,298) | -  |

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

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<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(2020年3月31日) |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) その他有価証券<br>非上場株式       | 666                   | 666                   |
| (2) 子会社株式及び関連会社株式<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超  |
|-------------------|--------|-------------|--------------|-------|
| 現金・預金             | 28,489 | -           | -            | -     |
| 未収委託者報酬           | 11,468 | -           | -            | -     |
| 有価証券及び投資有価証券      |        |             |              |       |
| その他有価証券のうち満期があるもの | 554    | 4,284       | 2,227        | 1,227 |
| 合計                | 40,512 | 4,284       | 2,227        | 1,227 |

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

|                   | 1年以内   | 1年超<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|-------------------|--------|-------------|--------------|------|
| 現金・預金             | 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              | 21,900 | -           | -            | -    |
| その他有価証券のうち満期があるもの | 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. その他有価証券

前事業年度(2019年3月31日)

|                      | 貸借対照表計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                   |               |             |
| (1) 株式               | 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<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                   |               |             |
| (1) 株式               | 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<br>(百万円) | 売却益の合計額<br>(百万円) | 売却損の合計額<br>(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<br>(百万円) | 売却益の合計額<br>(百万円) | 売却損の合計額<br>(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                         | 当事業年度                         |
|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                 | (自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | (自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) |
| 退職給付債務の期首<br>残高 | 2,350百万<br>円                  | 2,389百<br>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<br>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                         | 当事業年度                         |
|-------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
|                         | (自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | (自 2019年4月1日<br>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<br>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<br>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                         | 当事業年度                         |
|--|-------------------------------|-------------------------------|
|  | (自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | (自 2019年4月1日<br>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の主な原因別内訳

(単位：百万円)

|                  | 前事業年度<br>(2019年3月31日) | 当事業年度<br>(2020年3月31日) |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>繰延税金資産</b>    |                       |                       |
| 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                 |
| <b>繰延税金負債</b>    |                       |                       |
| 連結法人間取引(譲渡<br>益) | 159                   | 159                   |
| その他有価証券評価差<br>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<br>(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有<br>(被所有)<br>割合<br>(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(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㈱             | 東京都千代田区 | 100,000        | 金融商品取引業 | -                 | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料(注2) | 19,975        | 未払手数料   | 3,400         |
| 同一の親会社をもつ会社 | ㈱大和総研ビジネス・イノベーション | 東京都江東区  | 3,000          | 情報サービス業 | -                 | ソフトウェアの開発       | ソフトウェアの購入(注3)    | 1,052         | 未払費用    | 173           |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和プロパティ㈱          | 東京都中央区  | 100            | 不動産管理業  | -                 | 本社ビルの管理         | 不動産の賃借料(注4)      | 1,063         | 長期差入保証金 | 1,055         |

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれておりません。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

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<br>(百万円) | 事業の内容   | 議決権等の所有<br>(被所有)割合<br>(%) | 関連当事者との関係       | 取引の内容            | 取引金額<br>(百万円)<br>(注1) | 科目      | 期末残高<br>(百万円)<br>(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<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) |            | 当事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>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<br>(自 2018年4月1日<br>至 2019年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>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】

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】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

&lt;FW 日経225インデックス&gt;

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（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。

&lt;その他各ファンド&gt;

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<br>単位：百万円<br>(2020年3月<br>末日現在) | 事業の内容 |
|----------|--------------------------------------|-------|
| 大和証券株式会社 | 100,000                              | (注)   |

(注) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

## 3 【資本関係】

該当事項はありません。

< 再信託受託会社の概要 >

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 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

| (提出年月日)    | (書類名)           |
|------------|-----------------|
| 2019年9月11日 | 有価証券届出書、有価証券報告書 |
| 2020年3月10日 | 半期報告書、有価証券届出書   |

**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

東京事務所

|                    |       |        |   |
|--------------------|-------|--------|---|
| 指定有限責任社員業<br>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<br>務執行社員 | 公認会計士 | 間瀬 友未 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

|                    |       |       |   |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員業<br>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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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」に掲げられているダイワファンドラップTOPIXインデックスの2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップTOPIXインデックスの2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井 康治 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

|                    |       |       |   |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林 英之 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日経225インデックスの2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの2020年6月15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。

**独立監査人の監査報告書**

2020年7月17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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 深井 康治 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

|                    |       |       |   |
|--------------------|-------|-------|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 小林 英之 | 印 |
|--------------------|-------|-------|---|

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2019年6月18日から2020年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2020年6月15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。